

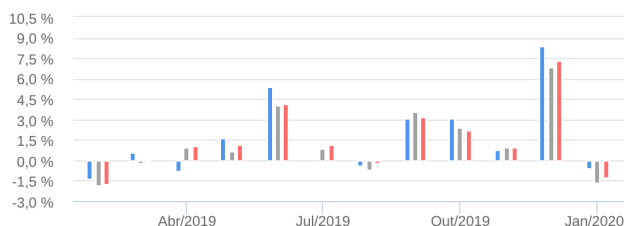
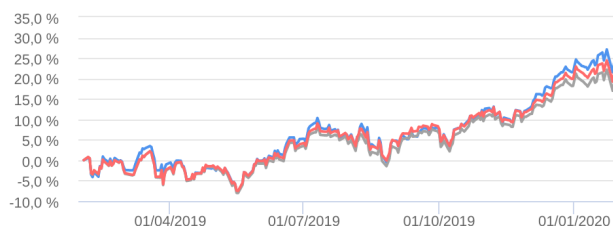
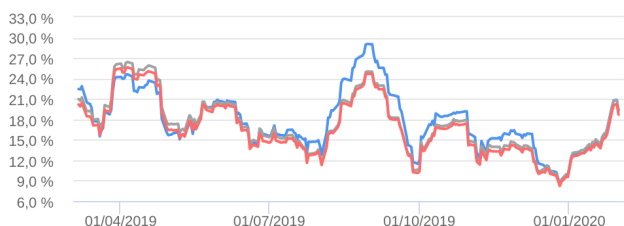
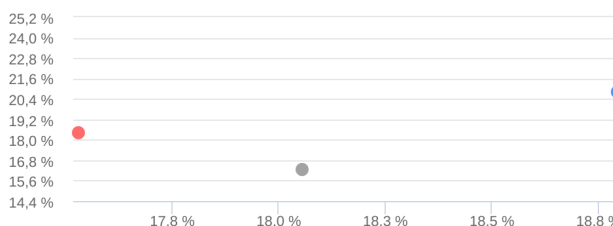
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 09.635.172/0001-06	Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00
Gestão: Bahia Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 10.000,00
Administrador: BEM DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 50.000,00
Taxa de Administração: 1,90%	Resgate Mínimo: R\$ 10.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 2,20%	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Ações Livre	Conversão da Cota para Resgate: D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)
Código de Referência: 253839	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)
Início do Fundo: 26/07/2010	

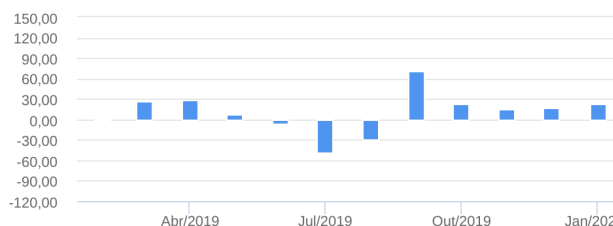
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	212,04	-0,58	20,81	47,18	85,47	-0,58	8,34	0,76	3,07	3,06	-0,37	0,00	5,34	1,67	-0,74	0,52	-1,40
Excesso do Ibovespa	140,83	1,05	4,56	12,52	12,69	1,05	1,49	-0,19	0,71	-0,51	0,29	-0,84	1,29	0,96	-1,72	0,70	0,46
CDI	143,17	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	71,22	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	130,94	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	78,26	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	3,120413	1.203.119,29	992.239,26	18,80%	-10,94%	8,93%	1,01	4,25%	8,34%	-0,74%	7
Ibovespa	-	-	-	18,06%	-10,00%	8,57%	1,00	0,00%	6,85%	-1,63%	0

Gráficos

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

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

jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

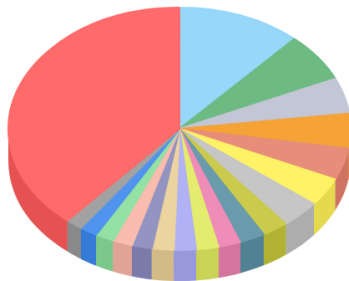
:: BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	100,27%	100,35%	100,23%	100,24%	100,22%	100,24%	99,90%	100,25%
Valores a receber	0,14%	0,43%	0,02%	0,08%	0,08%	8,05%	7,28%	0,04%
Operações Compromissadas	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,44%	-0,81%	-0,28%	-0,35%	-0,33%	-8,32%	-7,21%	-0,32%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.203.119,29	1.187.934,67	1.079.962,16	1.056.896,88	1.002.997,84	905.233,31	937.554,14	986.362,08
Data da Divulgação	05/02/2020	07/01/2020	04/12/2019	05/11/2019	06/10/2019	04/09/2019	05/08/2019	02/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2021	11,90 %
PETROBRAS PN - PETR4	6,63 %
VALE ON N1 - VALE3	4,85 %
B3 ON NM - B3SA3	4,71 %
BRASIL ON NM - BBAS3	4,33 %
BRADERCO PN N1 - BBDC4	3,82 %
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	3,78 %
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	2,53 %
Obrigações por compra a termo a pagar – PETR4	2,46 %
AZUL PN N2 - AZUL4	2,14 %
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	2,12 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	2,12 %
LOJAS AMERIC PN - LAME4	2,09 %
Recibo de Subscrição – ELET9	1,93 %
Outros Valores a receber	1,89 %
B2W DIGITAL ON NM - BTOW3	1,78 %
BRF SA ON NM - BRFS3	1,70 %
Obrigações por compra a termo a pagar – BBAS3	1,63 %
Lançamentos positivos menores que 1,63%	39,32 %

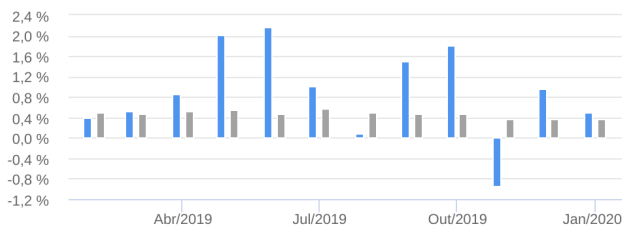
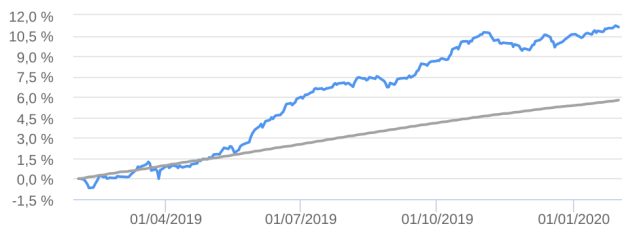
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 25.078.994/0001-90	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 300.000,00
Taxa de Administração: 0,30%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+3 du
Código de Referência: 423041	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du
Início do Fundo: 31/08/2016	

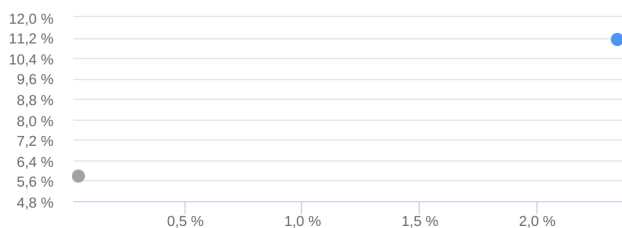
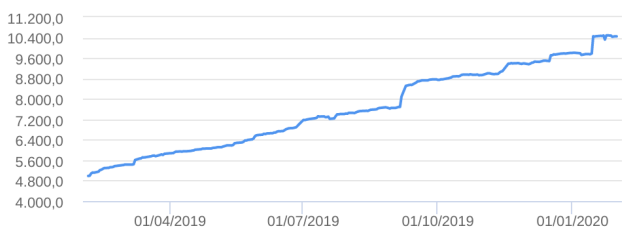
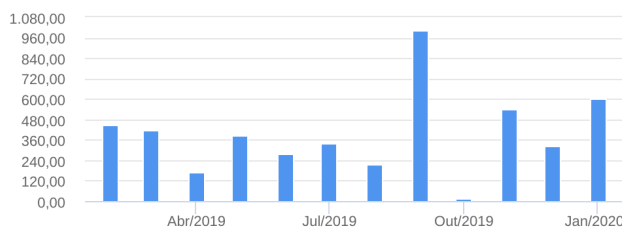
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	46,09	0,49	11,13	22,80	37,67	0,49	0,96	-0,94	1,80	1,50	0,08	1,02	2,17	2,02	0,87	0,52	0,39
% do CDI	154,27	129,00	193,24	181,53	161,50	129,00	255,89	-246,60	375,35	323,21	16,89	179,14	462,90	371,55	167,82	110,74	78,80
CDI	29,88	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	96,47	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	100,01	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	16,36	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	1,460916445	10.446.730,36	7.638.773,78	2,35%	-1,22%	1,11%	2,93	2,34%	2,17%	-0,94%	9
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

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

jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

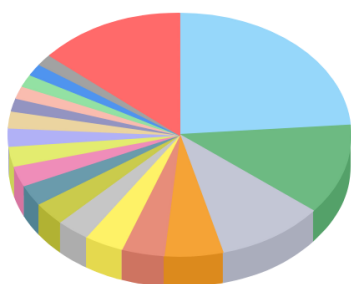
:: BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	99,99%	100,00%	100,00%	100,00%	99,96%	99,98%	99,99%	99,79%
Valores a receber	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,04%	0,02%	0,01%	0,21%
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)	10.446.730,36	9.800.245,40	9.385.285,18	8.931.824,90	8.760.808,47	7.645.235,51	7.419.279,08	7.006.317,80
Data da Divulgação	05/02/2020	06/01/2020	05/12/2019	05/11/2019	03/10/2019	04/09/2019	08/08/2019	05/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2022	23,77 %
LTN - Venc.: 01/07/2020	12,02 %
LTN - Venc.: 01/10/2020	10,16 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	5,53 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2021	4,02 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	3,69 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	3,12 %
LTN - Venc.: 01/04/2020	3,09 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2,77 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	2,71 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	2,67 %
LTN - Venc.: 01/07/2023	2,41 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	2,25 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	1,71 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	1,68 %
LTN - Venc.: 01/07/2021	1,67 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	1,58 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	1,55 %
Lançamentos positivos menores que 1,55%	13,66 %

Características do FIDC

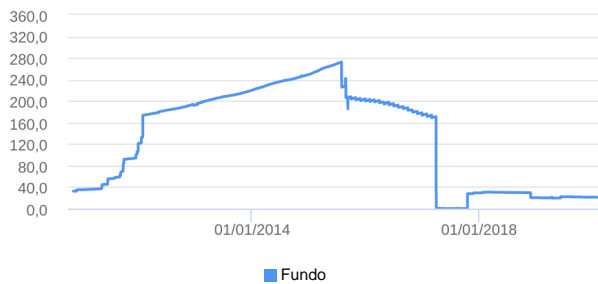
Gestão: Brasil Plural	Condomínio: Aberto
Administrador: Santander Securities Services	Prazo do Fundo: Indeterminado
Custodiante: Banco Santander	Classificação Legal: FIDC
Auditoria: Grant Thornton	Data de Registro: 16/03/2010
Classificação Anbima: FIDC Outros	Direito Creditório: Multiclasse
Foco de Atuação: FIDC Multicarteira Outros	Razão de Garantia Mínima: Não se aplica
Cedente: Multicedente	Política de Investimento: Aplica em direitos creditórios oriundos dos segmentos industrial, comercial, agropecuário, financeiro, imobiliário e de prestação de serviços.

Características da Série

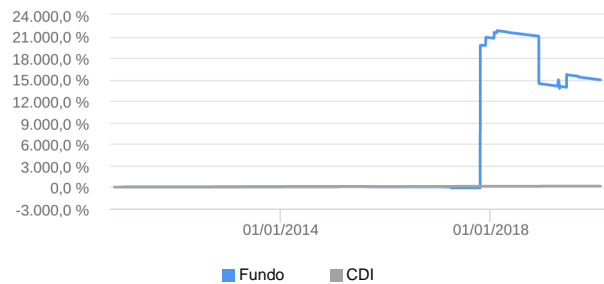
Classe: Única	Situação Atual: Em funcionamento normal
Série: 1	Prazo da Série: Indeterminado
Rating Agência: LF Rating	Rating Última Atualização: 10/02/2020
Rating Atual: diária	Rating Monitoramento: Manutenção
Rentabilidade Alvo: -	% Mínimo de Cotas Subordinadas: O fundo emitirá somente uma classe de cotas.
Amortização Tipo Regra: Não há	Próxima data de Amortização: Não se aplica
Início da Série: 04/11/2010	Amortização Principal a Pagar: Não se aplica

Retorno (%)	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Série	-0,52	-0,52	-3,68	4,74	-30,45	-0,52	-0,57	-0,50	-0,50	-1,19	-0,52	-0,49	11,87	-0,59	-0,56	-0,57	-0,58
CDI	0,38	0,38	2,53	5,76	12,56	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
% CDI	-138,43	-138,43	-145,21	82,37	-242,39	-138,43	-153,35	-130,25	-103,61	-256,52	-104,05	-86,60	2.532,90	-108,43	-107,68	-121,85	-117,71
+ CDI	-0,90	-0,90	-6,21	-1,02	-43,01	-0,90	-0,95	-0,88	-0,98	-1,65	-1,02	-1,06	11,41	-1,13	-1,08	-1,04	-1,07
IPCA	0,21	0,21	2,04	4,17	8,14	0,21	1,15	0,51	0,10	-0,04	0,11	0,19	0,01	0,13	0,57	0,75	0,43
+ IPCA	-0,73	-0,73	-5,72	0,57	-38,59	-0,73	-1,72	-1,01	-0,60	-1,15	-0,63	-0,68	11,86	-0,72	-1,13	-1,32	-1,01
Selic	0,38	0,38	2,53	5,76	12,57	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/11/2010 a 31/01/2020 (diária)



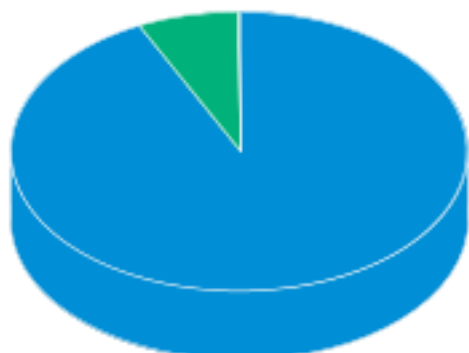
Retorno Acumulado - 05/11/2010 a 31/01/2020 (diária)



Histórico*	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
FIDC (R\$)	21,03	21,14	21,26	21,36	21,47	21,73	21,84	21,95	19,62	19,74	19,85	19,96
Série (R\$)	21,03	21,14	21,26	21,36	21,47	21,73	21,84	21,95	19,62	19,74	19,85	19,96
Sênior (R\$)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Subordinada/Única (R\$)	21,03	21,14	21,26	21,36	21,47	21,73	21,84	21,95	19,62	19,74	19,85	19,96
% Subordinação	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
DC (R\$)	269,00	268,52	268,19	267,94	267,62	267,25	266,87	266,44	268,41	267,58	266,81	266,19
PDD (R\$)	269,00	268,52	268,19	267,94	267,62	267,25	266,87	266,44	268,41	267,58	266,81	266,19
CVNP (R\$)	240,25	236,68	233,13	229,57	225,77	221,97	210,26	214,26	212,61	208,52	204,41	200,41
PDD/DC (%)	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%
DC/PL (%)	1.279,35%	1.270,42%	1.261,58%	1.254,17%	1.246,43%	1.229,90%	1.221,73%	1.213,77%	1.367,96%	1.355,70%	1.344,26%	1.333,43%
CVNP/DC (%)	89,32%	88,14%	86,93%	85,68%	84,36%	83,05%	78,79%	80,42%	79,21%	77,93%	76,61%	75,29%

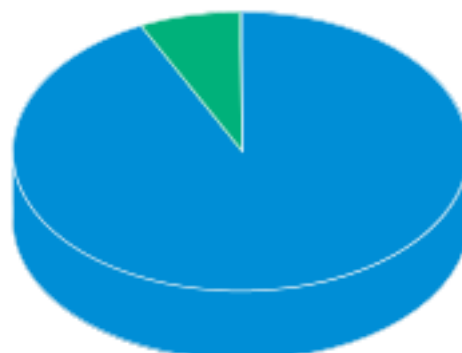
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.

Tipo do Ativo



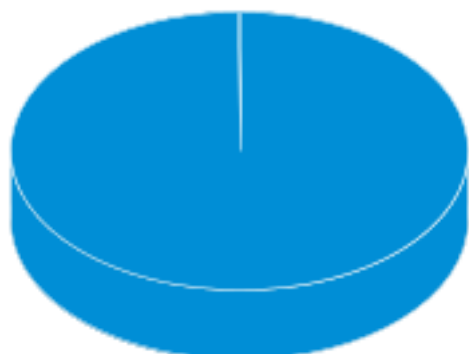
■ Direito Creditório	92,75 %
■ Valores a pagar/receber	7,25 %
■ Fundos de Investimento	0,00 %

Setor do Ativo



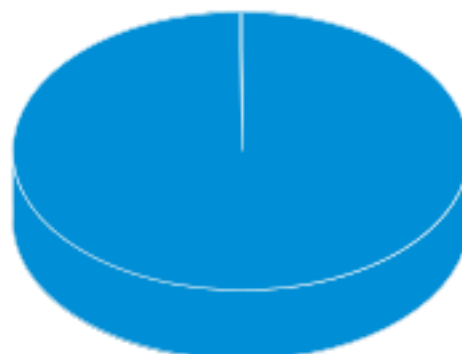
■ Outros	92,75 %
■ Não Classificado	7,25 %

Risco do Ativo



■ Outros	100,00 %
--	----------

Classe do Ativo



■ Outros	100,00 %
--	----------

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Direitos Creditórios - Multiclasse	268.997,00000	1.279,3466 %
Outros Ativos - Longo Prazo (após 12 meses)	21.341,00000	101,4975 %
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	24,00000	0,1141 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	5,00000	0,0238 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-344,00000	-1,6361 %
Patrimônio Líquido (R\$ mil)		21.026,12

CARACTERÍSTICAS

Gestão: Graphen Investimentos
 Administrador: Elite Corretora
 Custodiante: Banco Bradesco
 Auditor: PriceWaterhouseCoopers
 Taxa de Administração: 1,35%
 Taxa de administração máxima: Não possui
 Taxa de Performance: 20,00%
 Índice de Performance: 100% do IPCA + 6% a.a.

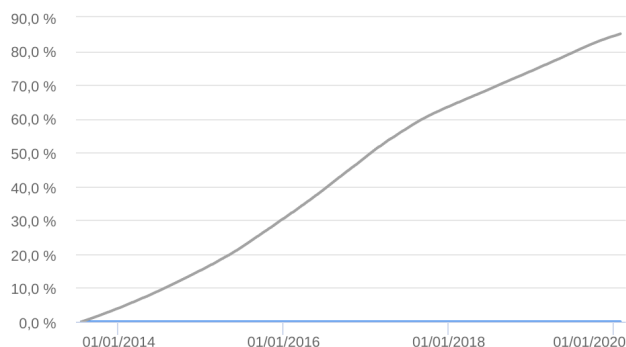
PERFIL DO FUNDO

Classificação Quantum: Investimento Imobiliário
 Classificação Anbima: FII Híbrido Gestão Ativa
 Público Alvo: Exclusivo
 Objetivo: Aquisição e posterior gestão patrimonial de empreendimentos imobiliários hoteleiros preponderantemente ligados ao administrador hoteleiro Brazil Hospitality Group, objetivando ganhos acima da variação do IGP-M por meio da exploração comercial dos imóveis.
 Política de investimento: Investimentos de longo prazo em ativos imobiliários, podendo ainda investir em ativos de renda fixa. Os ativos imobiliários poderão integrar um pool hoteleiro. Não é objetivo primordial auferir ganhos de capital decorrentes da compra e venda de imóveis.

RETORNO (%)

	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
% do CDI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CDI	85,12	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Dólar	90,91	5,92	16,35	34,85	34,73	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75	-0,12	1,25	4,23	2,37
Euro	60,98	4,44	12,33	20,10	39,17	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80	-0,59	1,00	2,78	1,55
Ibovespa	140,00	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IGP-M	46,72	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

GRÁFICOS
Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 22/07/2013 a 31/01/2020 (diária)

Retorno Acumulado - 22/07/2013 a 31/01/2020 (diária)


■ Fundo

HISTÓRICO

PL Médio 12 meses: R\$ 158.511.673,11
 Início do Fundo: 22/08/2012
 Máximo Retorno Mensal: 0,00% (ago/2013)
 Mínimo Retorno Mensal: 0,00% (ago/2013)
 Nº de Meses com Retorno Positivo: 0
 Nº de Meses com Retorno Negativo: 0
 Retorno Acumulado Desde o Início: 0,00%
 Volatilidade Desde o Início: 0,00%

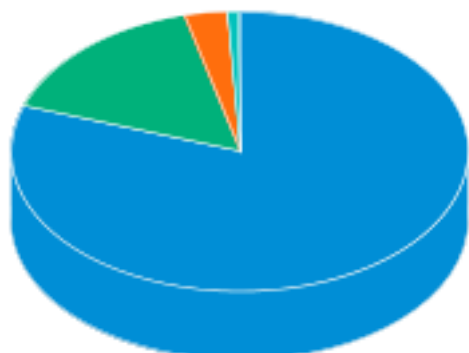
■ Fundo

■ CDI

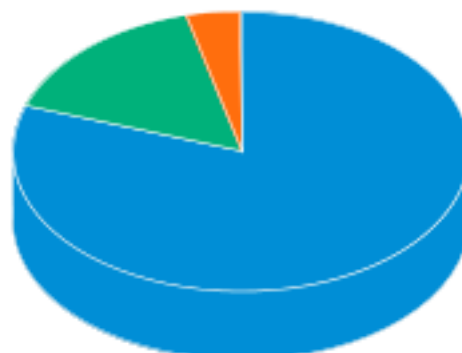
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00
 Movimentação mínima: Não há
 Saldo mínimo: Não há
 Contato: contato@grapheninvestimentos.com.br
 Disponibilidade dos recursos aplicados: Não se aplica
 Conversão de cota para aplicação: Não se aplica
 Conversão de cota para resgate: Não se aplica
 Disponibilidade dos recursos resgatados: Não se aplica

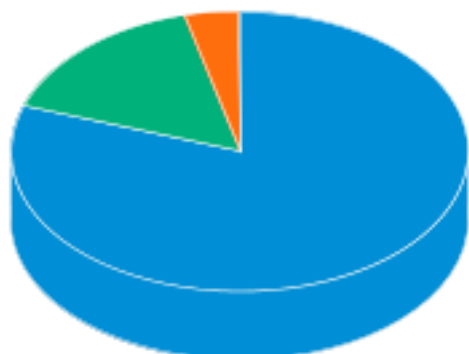
Tipo do Ativo



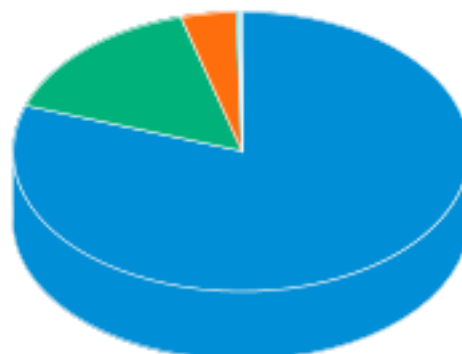
Sector do Ativo



Risco do Ativo



Classe do Ativo



Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Imóveis para Renda - Em Construção - 3 Centros de Conveções - Hotel Golden Tulip Rua Rio de Janeiro, 18 - Centro - Belo Horizonte - MG.	40.273,00000	26,2884 %
Imóveis para Renda - Em Construção - 2 Bangalôs e 14 Villas - Hotel Resort Txai Terravista - Estrada de Arraial d' Ajuda, km 18 - Trancoso - Porto Seguro - BA. Área total: 71.794 m². Área Construída: 13.376,42 m².	26.635,00000	17,3861 %
LFT	25.395,00000	16,5767 %
Imóveis para Renda - Em Construção - 51 Unidades Master - Hotel Golden Tulip Rua Rio de Janeiro, 18 - Centro - Belo Horizonte - MG.	23.154,00000	15,1139 %
Imóveis para Renda - Em Construção - 64 Unidades Standard - Hotel Golden Tulip Rua Rio de Janeiro, 18 - Centro - Belo Horizonte - MG.	22.540,00000	14,7131 %
Imóveis para Renda - Em Construção - 34 Salas Comerciais - The One Office Tower Taubaté Avenida Itália - Taubaté - SP.	18.925,00000	12,3534 %
Valores a receber / Impostos a Compensar	1.109,00000	0,7239 %
NTN	463,00000	0,3022 %
Disponibilidades	23,00000	0,0150 %

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL).

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-8,00000	-0,0052 %
Outros Valores a pagar	-84,00000	-0,0548 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	-143,00000	-0,0933 %
Obrigações por Aquisição de Imóveis	-5.085,00000	-3,3193 %

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL).

Fonte: Quantum

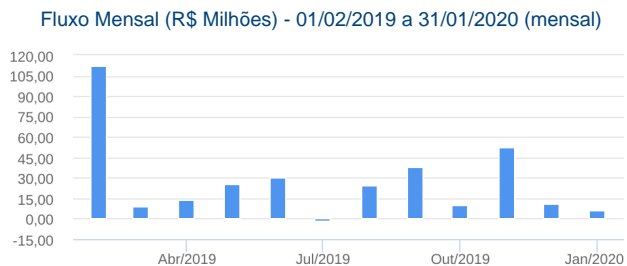
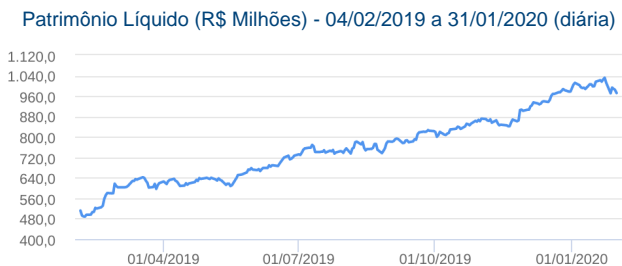
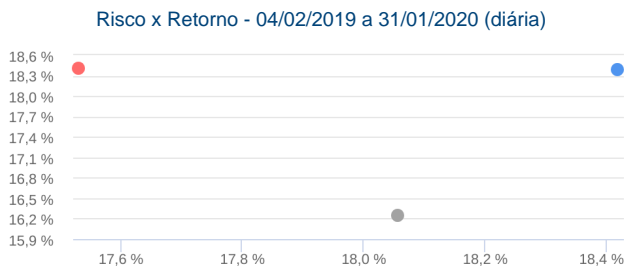
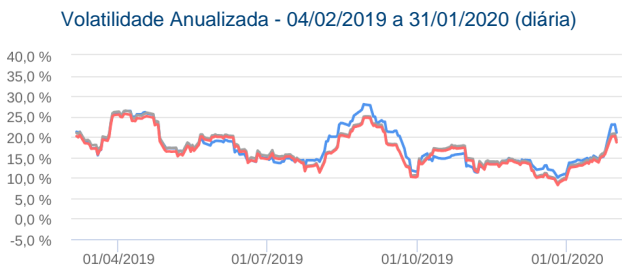
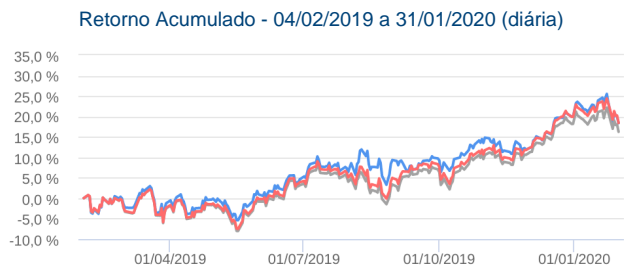
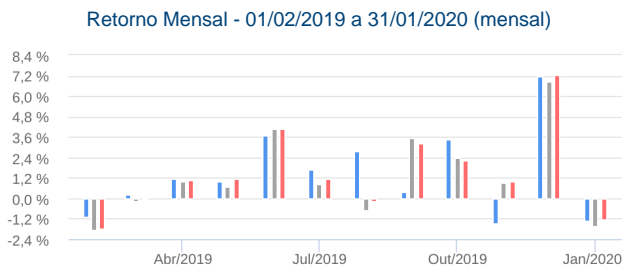
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 03.660.879/0001-96	Aplicação Mínima: R\$ 20.000,00
Gestão: Bradesco Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00
Administrador: BEM DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 20.000,00
Taxa de Administração: 1,50%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 1,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Ações Índice Ativo	Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
Código de Referência: 95664	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du
Início do Fundo: 09/03/2000	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	1.854,17	-1,29	18,39	42,35	92,29	-1,29	7,19	-1,45	3,47	0,35	2,76	1,72	3,69	1,02	1,15	0,24	-1,06
Excesso do Ibovespa	955,13	0,34	2,14	7,69	19,50	0,34	0,35	-2,39	1,10	-3,22	3,42	0,89	-0,37	0,32	0,17	0,41	0,80
CDI	745,55	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	899,04	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	1.597,22	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	257,43	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	1.017,9743868	971.708,91	759.352,82	18,42%	-8,11%	8,75%	0,94	5,45%	7,19%	-1,45%	8
Ibovespa	-	-	-	18,06%	-10,00%	8,57%	1,00	0,00%	6,85%	-1,63%	0

Gráficos

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

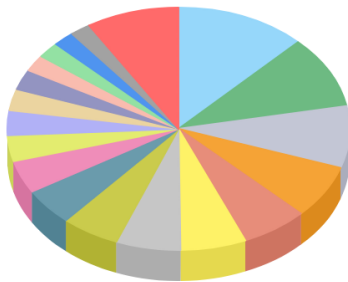

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
 Fonte: Quantum Axis.

:: BRADESCO SELECTION FI AÇÕES

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Ações	93,39%	95,57%	94,98%	96,51%	98,70%	96,94%	98,28%	95,85%
Operações Compromissadas	3,82%	0,97%	1,63%	1,14%	1,16%	4,39%	1,82%	2,75%
Outras Aplicações	1,94%	-	-	-	-	-	-	-
Valores a receber	1,65%	1,15%	0,85%	0,32%	0,27%	0,22%	0,35%	1,52%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,79%	-0,13%	-0,40%	-0,19%	-0,13%	-1,55%	-0,46%	-0,11%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	-	2,44%	2,94%	2,22%	-	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	971.708,91	977.683,78	901.862,74	861.409,56	822.585,42	782.118,80	737.608,39	726.541,21
Data da Divulgação	07/02/2020	08/01/2020	08/12/2019	06/11/2019	06/10/2019	05/09/2019	05/08/2019	02/07/2019
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)								jan/2020



■ PETROBRAS PN - PETR4	12,39 %
■ MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	9,76 %
■ VALE ON N1 - VALE3	8,32 %
■ BRADESCO PN N1 - BBDC4	7,15 %
■ INTERMEDICA ON NM - GNDI3	6,34 %
■ IRBBRASIL RE ON NM - IRBR3	6,24 %
■ LOJAS RENNER ON NM - LREN3	6,14 %
■ HAPVIDA ON NM - HAPV3	5,54 %
■ LOCALIZA ON NM - RENT3	4,97 %
■ ALIANSCSONAEON NM - ALSO3	4,40 %
■ CYRELA REALT ON NM - CYRE3	3,48 %
■ LOCAMERICA ON NM - LCAM3	3,34 %
■ LOJAS MARISA ON NM - AMAR3	2,88 %
■ SUZANO PAPELON NM - SUZB3	2,72 %
■ EVEN ON NM - EVEN3	2,20 %
■ CYRE COM-CCP ON NM - CCPR3	2,12 %
■ JBS ON NM - JBSS3	2,05 %
■ BTGP BANCO UNT - BPAC11	1,94 %
■ Lançamentos positivos menores que 1,94%	8,81 %

CARACTERÍSTICAS

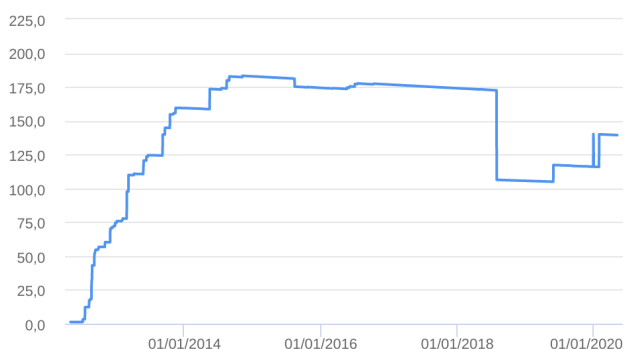
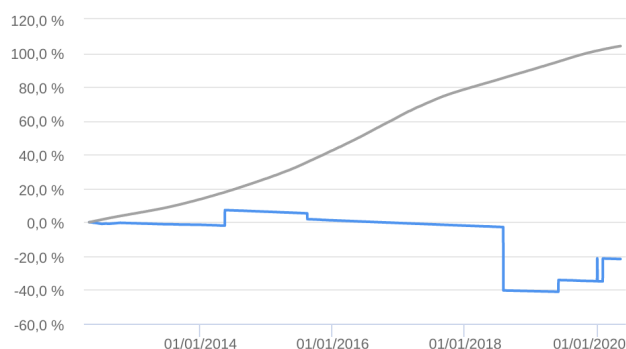
Gestão: Queluz Gestão de Recursos
 Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros
 Custodiante: Banco Bradesco
 Auditor: EY
 Taxa de Administração: 1,50%
 Taxa de administração máxima: Não possui
 Taxa de Performance: Não possui
 Índice de Performance: Não possui

PERFIL DO FUNDO

Classificação Quantum: Participações
 Classificação Anbima: Fundos de Participações
 Público Alvo: Investidores qualificados
 Objetivo: Proporcionar valorização de capital no longo prazo.
 Política de investimento: Investe em ações ou Títulos e Valores Mobiliários, conversíveis ou permutáveis em ações da Tree Florestal Empreendimentos e Participações S.A., inscrito no CNPJ sob o nº 15.305.977/0001-94.

RETORNO (%)

	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19
Fundo	-21,77	-0,54	32,75	-19,75	-20,99	-0,13	-0,14	-0,11	-0,14	20,59	-0,10	-0,15	-0,25	-0,14	-0,15	-0,12	11,63
% do CDI	-20,91	-39,90	639,77	-166,75	-100,26	-44,98	-40,09	-38,29	-37,34	5.494,89	-25,81	-30,75	-53,49	-27,63	-25,71	-25,54	2.141,40
CDI	104,12	1,35	5,12	11,84	20,94	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54
Dólar	209,60	44,80	48,35	65,30	83,98	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75	-0,12
Euro	152,74	39,34	43,18	49,64	82,39	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80	-0,59
Ibovespa	26,63	-32,45	-18,28	-6,01	17,08	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70
IGP-M	62,24	2,56	6,64	15,76	18,24	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45

GRÁFICOS
Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 30/04/2012 a 07/05/2020 (diária)

Retorno Acumulado - 30/04/2012 a 07/05/2020 (diária)


■ Fundo

■ Fundo

■ CDI

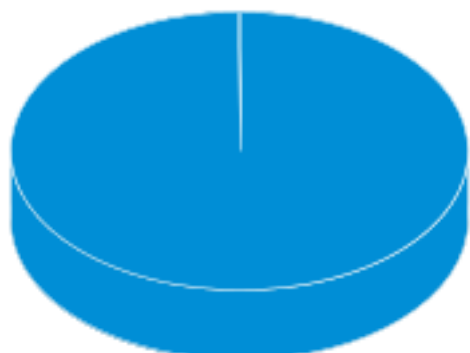
HISTÓRICO

PL Médio 12 meses: R\$ 121.873.711,37
 Início do Fundo: 30/08/2010
 Máximo Retorno Mensal: - (-)
 Mínimo Retorno Mensal: - (-)
 Nº de Meses com Retorno Positivo: -
 Nº de Meses com Retorno Negativo: -
 Retorno Acumulado Desde o Início: -21,77%
 Volatilidade Desde o Início: 19,02%

INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

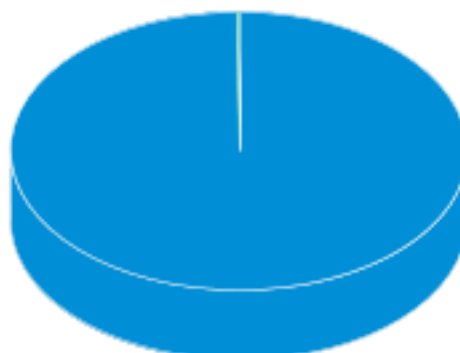
Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00
 Movimentação mínima: Não há
 Saldo mínimo: Não há
 Contato: queluz@queluz.com.br
 Disponibilidade dos recursos aplicados: Não se aplica
 Conversão de cota para aplicação: Não se aplica
 Conversão de cota para resgate: Não se aplica
 Disponibilidade dos recursos resgatados: Não se aplica

Tipo do Ativo



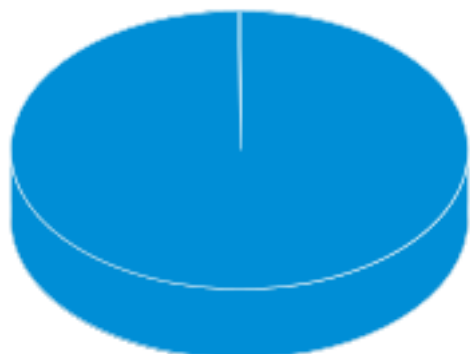
■ Ações 100,00 %

Setor do Ativo



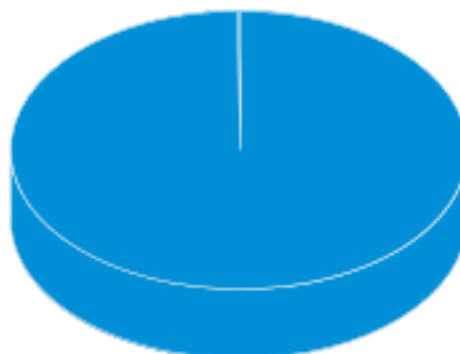
■ Não Classificado 99,84 %
■ Outros 0,16 %

Risco do Ativo



■ Outros 100,00 %

Classe do Ativo



■ Ações 100,00 %

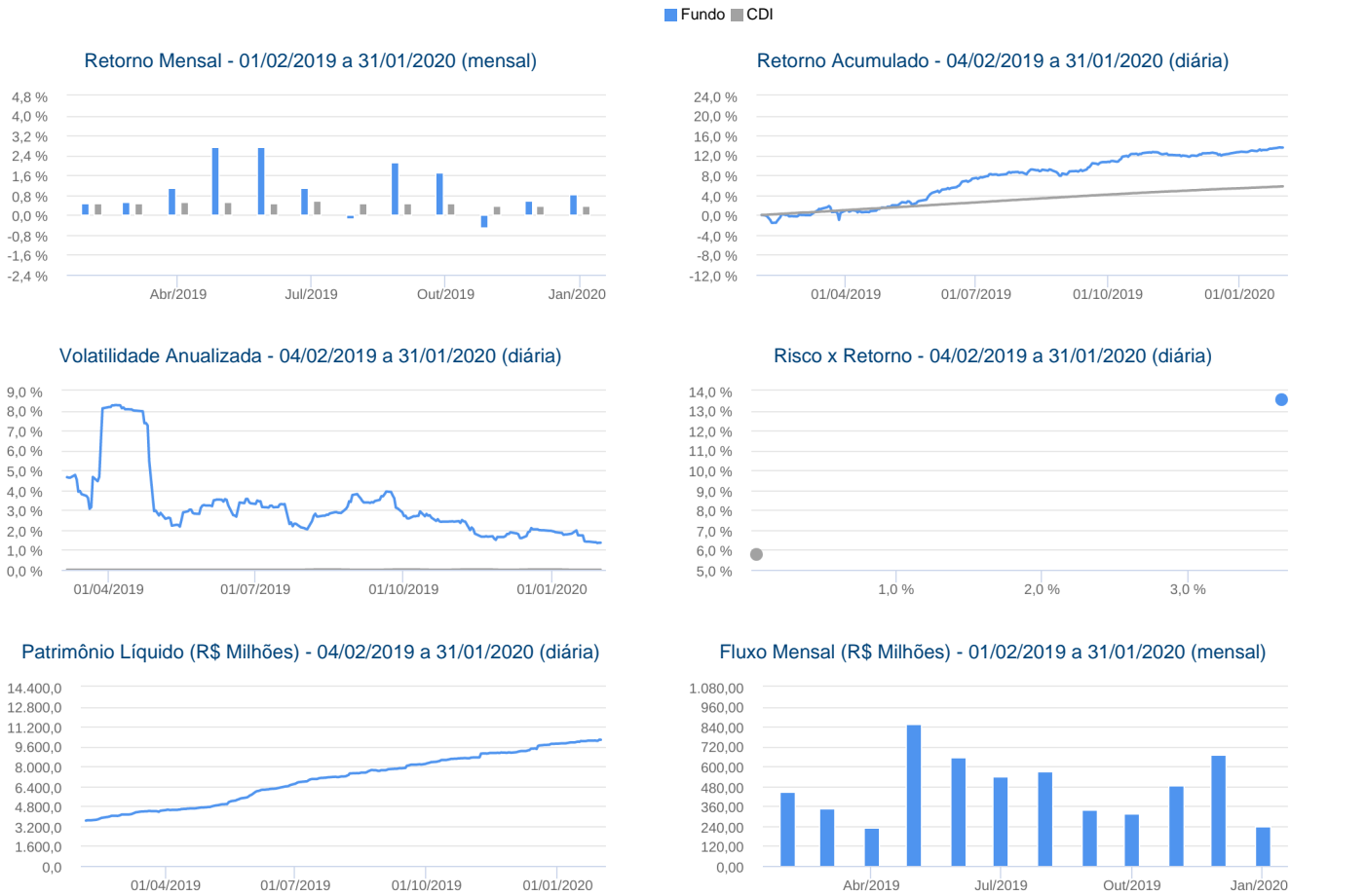
Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Ação de Companhia Fechada - TREE FLORESTAL EMPREENDIMENTOS E PARTICIPAÇÕES S.A. ON (15.305.977/0001-94)	120.796,37035	104,1369 %
Outros Valores a receber	186,59506	0,1609 %
Outras Disponibilidades	22,19642	0,0191 %
Outros Valores a pagar	-5.007,51132	-4,3169 %
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	115.997,65	

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 23.215.097/0001-55	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: Caixa Econômica Federal	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,40%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 427683	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 04/11/2016	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	43,14	0,82	13,55	25,34	39,05	0,82	0,59	-0,51	1,71	2,12	-0,13	1,11	2,73	2,72	1,11	0,54	0,50
% do CDI	160,20	217,54	235,28	201,70	167,44	217,54	158,37	-132,79	356,87	456,77	-25,81	194,91	583,33	500,38	214,07	116,16	101,57
CDI	26,93	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	84,68	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	89,14	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	15,95	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	1,431379	10.136.705,21	7.021.585,04	3,65%	-2,73%	1,73%	3,02	3,65%	2,73%	-0,51%	9
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos



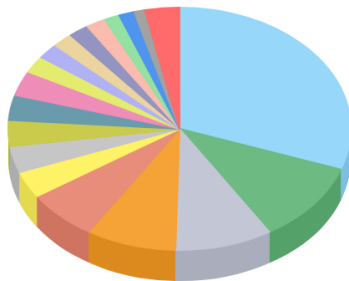
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

:: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	99,91%	99,89%	99,87%	99,85%	99,96%	99,95%	99,95%	99,95%
Operações Compromissadas	0,09%	0,11%	0,14%	0,16%	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%
Valores a receber	0,00%	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%
Títulos Públicos	-	-	-	0,00%	-	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	10.136.705,21	9.818.666,12	9.094.359,00	8.654.594,98	8.195.197,00	7.692.574,59	7.131.247,27	6.521.414,05
Data da Divulgação	07/02/2020	08/01/2020	04/12/2019	06/11/2019	07/10/2019	03/09/2019	05/08/2019	05/07/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								jan/2020



Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2020	30,46 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	10,75 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	9,20 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2021	8,49 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	6,76 %
LTN - Venc.: 01/07/2023	3,54 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	3,53 %
LTN - Venc.: 01/04/2020	3,46 %
LTN - Venc.: 01/10/2020	3,33 %
LFT - Venc.: 01/03/2021	3,32 %
LTN - Venc.: 01/04/2021	2,25 %
LFT - Venc.: 01/03/2026	2,03 %
LFT - Venc.: 01/03/2020	1,96 %
LFT - Venc.: 01/09/2022	1,92 %
LFT - Venc.: 01/03/2023	1,87 %
LTN - Venc.: 01/07/2020	1,45 %
LFT - Venc.: 01/03/2024	1,44 %
LTN - Venc.: 01/07/2021	1,04 %
Lançamentos positivos menores que 1,04%	3,23 %

INSTITUIÇÕES

Gestão: LAD Capital

Diretor: Julius Haupt Buchenrode

Gestor: André Luís de Souza Fernandez

Administrador: LAD Capital

Custodiante: Dispensada

Auditor: UHY Bendoraytes

PERFIL DO FUNDO

Política de Investimento: Investe em Títulos e Valores Mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações das companhias BRASIL FOODSERVICE GROUP S.A., BRASIL FOODSERVICE MANAGER S.A. e BRASIL PRIVATE EQUITY GROUP S.A., participando do seu processo decisório.

Companhias Alvo: BRASIL FOODSERVICE GROUP S.A., BRASIL FOODSERVICE MANAGER S.A., BRASIL PRIVATE EQUITY GROUP S.A., e quaisquer outras companhias integrantes dos referidos grupos econômicos.

Objetivo: Obter rendimentos, no longo prazo, por meio da aquisição de Valores Mobiliários.

Limite de Concentração por Companhia: 100%

CARACTERÍSTICAS

Tipo Investidor Anbima: Não classificado

Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00

Quantidade de Classes: 1.0

Benchmark: Não informado

Negociação em Mercado Secundário: CETIP / mercado de balcão não organizado

Data de Registro: 04/12/2014

Situação Atual: Em funcionamento normal

Classificação Anbima: Fundo de Participações

Classificação Quantum: Participações

Classificação Legal: FIP

DADOS PATRIMONIAIS

Patrimônio Autorizado Última Emissão: R\$ 5.000.000.000,00

Patrimônio Inicial Mínimo: R\$ 1.000.000,00

Patrimônio Inicial Máximo: R\$ 5.000.000.000,00

Preço Inicial por Cota: R\$ 100.000,00

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

31/12/2019: R\$ 1.470.657.753,02

30/09/2019: R\$ 1.470.963.301,33

28/06/2019: R\$ 1.471.213.519,59

29/03/2019: R\$ 1.471.413.640,46

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

Tipo de Cobrança: Flexível

Taxa de Administração: 1,00%

Taxa de Administração Financeira: R\$ 10.000,00

TAXA DE PERFORMANCE

Taxa de Performance: 20,00%

Critério de Apuração: Retorno positivo e excesso de retorno

Índice de Referência: 100% do IPCA + 9% a.a.

PRAZOS DE INVESTIMENTOS

Prazo de Duração do Fundo: 10 anos

Período de Investimento: 4 anos

Período de Investimento Extensão: 2 anos

Período de Desinvestimento: 11 anos

Período de Desinvestimento Extensão: 2 anos

CONTATO

Site: www.ladcapital.com.br

Email: contato@ladcapital.com.br

Telefone: (11) 3815-5944

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

Ativo	JUNHO/2019	
	Valor Investido (R\$ mil)	Participação
Ação de Companhia Fechada - BRAZCARNES PARTICIPAÇÕES S.A. ON (16.915.082/0001-34)	561.602,48	38,17%
Ações / CSDN3 / CNPJ do emissor: 10.826.798/0001-89 / Denominação Social do emissor: BRAZAL - BRASIL ALIMENTOS S.A	454.368,25	30,88%
Ações / CSDN4 / CNPJ do emissor: 10.826.798/0001-89 / Denominação Social do emissor: BRAZAL - BRASIL ALIMENTOS S.A	454.313,28	30,88%
Outros Valores a receber	424.593,76	28,86%
Outros Valores a pagar	-423.664,29	-28,80%
Outras Disponibilidades	0,04	0,00%

CARACTERÍSTICAS

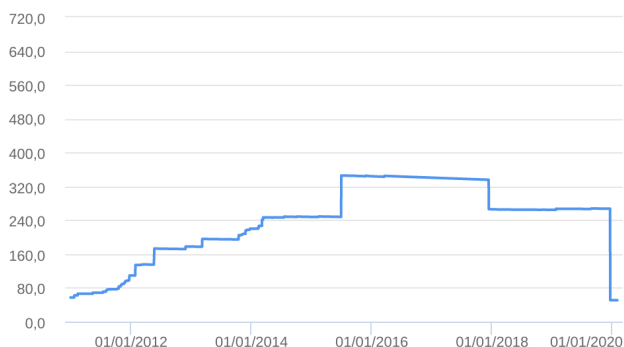
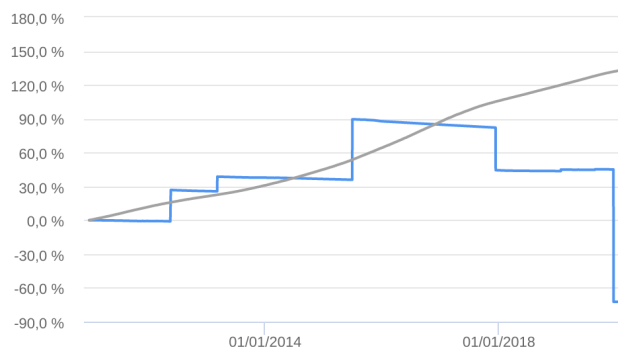
Gestão: Brasil Plural
 Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros
 Custodiante: Banco Bradesco
 Auditor: EY
 Taxa de Administração: 0,30%
 Taxa de administração máxima: Não possui
 Taxa de Performance: 20,00%
 Índice de Performance: 100% do IPCA + 10,5% a.a.

PERFIL DO FUNDO

Classificação Quantum: Participações
 Classificação Anbima: Fundos de Participações
 Público Alvo: Investidores profissionais
 Objetivo: Proporcionar a valorização das cotas equivalente ao índice IPCA acrescido de 10,5% ao ano.
 Política de investimento: Investe em ações, Títulos e Valores Mobiliários, conversíveis ou permutáveis em ações, de modo participar do processo decisório da empresa no setor de Geração de Energia.

RETORNO (%)

	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	-72,45	-0,11	-80,99	-80,88	-85,07	-0,11	-80,99	-0,03	-0,04	-0,03	0,36	-0,03	-0,02	0,01	-0,03	-0,02	-0,06
% do CDI	-54,49	-28,95	-1.406,39	-643,83	-364,72	-28,95	-21.613,53	-6,99	-7,51	-5,84	71,16	-5,56	-5,20	1,57	-5,83	-5,23	-12,78
CDI	132,95	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Dólar	153,14	5,92	16,35	34,85	34,73	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75	-0,12	1,25	4,23	2,37
Euro	113,99	4,44	12,33	20,10	39,17	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80	-0,59	1,00	2,78	1,55
Ibovespa	67,20	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IGP-M	69,60	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

GRÁFICOS
Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/12/2010 a 31/01/2020 (diária)

Retorno Acumulado - 29/12/2010 a 31/01/2020 (diária)


■ Fundo

■ Fundo

■ CDI

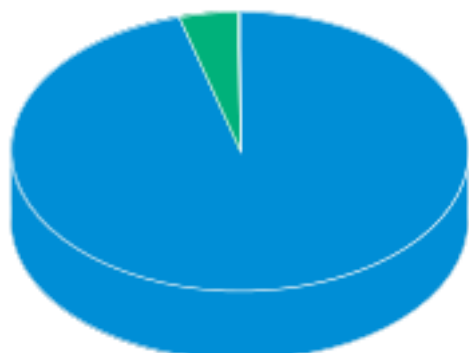
HISTÓRICO

PL Médio 12 meses: R\$ 241.266.518,93
 Início do Fundo: 01/03/2010
 Máximo Retorno Mensal: 39,38% (jun/2015)
 Mínimo Retorno Mensal: -80,99% (dez/2019)
 Nº de Meses com Retorno Positivo: 10
 Nº de Meses com Retorno Negativo: 99
 Retorno Acumulado Desde o Início: -72,45%
 Volatilidade Desde o Início: 32,28%

INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

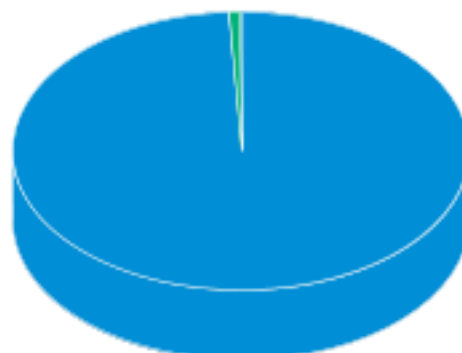
Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00
 Movimentação mínima: Não há
 Saldo mínimo: Não há
 Contato: asset@brasilplural.com
 Disponibilidade dos recursos aplicados: Não se aplica
 Conversão de cota para aplicação: Não se aplica
 Conversão de cota para resgate: Não se aplica
 Disponibilidade dos recursos resgatados: Não se aplica

Tipo do Ativo



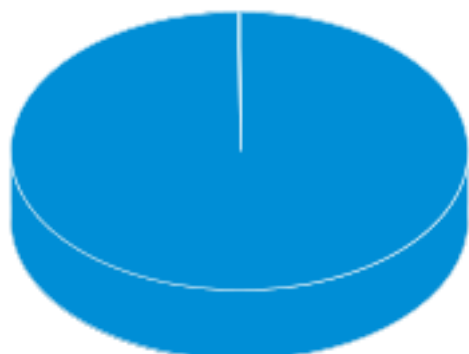
■ Outros	95,75 %
■ Valores a pagar/receber	4,25 %
■ Fundos de Investimento	0,00 %

Setor do Ativo



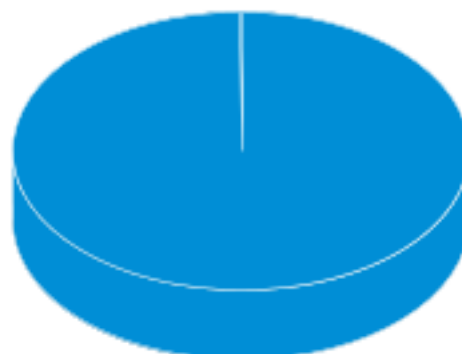
■ Não Classificado	99,18 %
■ Outros	0,82 %

Risco do Ativo



■ Outros	100,00 %
■ Cotas de fundos	0,00 %

Classe do Ativo



■ Outros	100,00 %
----------	----------

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Opções - Posições lançadas / GEBO / CNPJ do emissor: 12.524.216/0001-35 / Denominação Social do emissor: GERACAO BOLT ENERGIA S/A	-215.652,00007	131,4513 %
Outros Valores a pagar	-9.838,90047	5,9973 %
Outras Disponibilidades	1,03664	-0,0006 %
Cotas de BNY MELLON ARX CASH FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	9,30545	-0,0057 %
Outros Valores a receber	2.344,91096	-1,4293 %
Ações / STIG3 / CNPJ do emissor: 26.775.178/0001-06 / Denominação Social do emissor: STIG ENERGIA E PROJETOS S.A.	59.081,00004	-36,0130 %

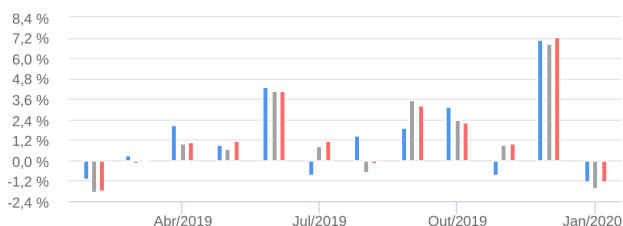
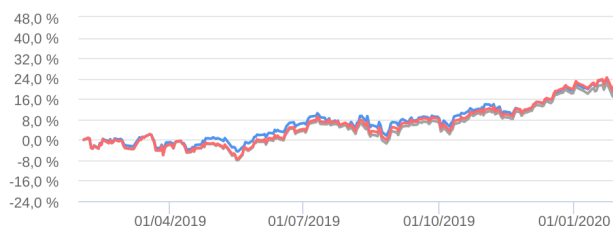
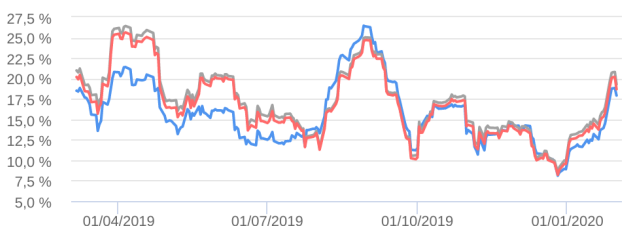
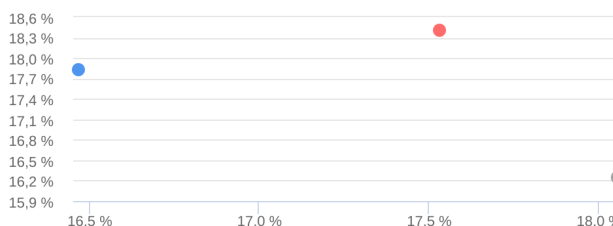
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 01.675.497/0001-00	Aplicação Mínima: R\$ 0,00
Gestão: Genial Investimentos	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BEM DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 3,00%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 3,00%	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Ações Índice Ativo	Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
Código de Referência: 46124	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du
Início do Fundo: 18/06/1997	

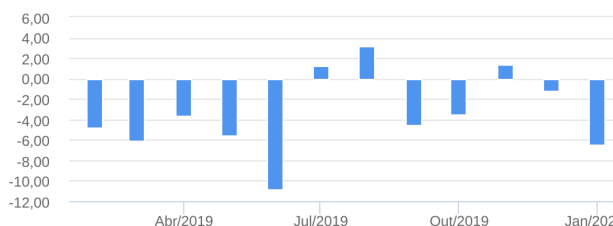
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	2.182,54	-1,25	17,83	35,73	39,89	-1,25	7,13	-0,87	3,13	1,93	1,46	-0,84	4,32	0,90	2,05	0,30	-1,07
Excesso do Ibovespa	1.350,46	0,38	1,58	1,07	-32,89	0,38	0,28	-1,82	0,77	-1,64	2,13	-1,67	0,26	0,20	1,07	0,48	0,79
CDI	1.970,94	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	832,08	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	1.872,31	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	438,42	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	228,2543615	348.579,71	330.771,38	16,47%	-7,96%	7,82%	0,86	5,77%	7,13%	-1,25%	8
Ibovespa	-	-	-	18,06%	-10,00%	8,57%	1,00	0,00%	6,85%	-1,63%	0

Gráficos

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

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

jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

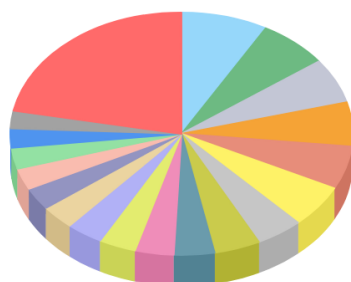
:: GERAÇÃO FI AÇÕES

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Ações	79,57%	77,87%	78,54%	75,76%	78,84%	80,83%	79,96%	82,69%
Cotas de Fundos	12,88%	13,25%	13,21%	13,18%	13,11%	12,92%	13,16%	13,14%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	5,66%	7,13%	6,67%	9,77%	7,54%	5,16%	5,29%	2,46%
Operações Compromissadas	1,61%	1,44%	1,77%	3,32%	1,24%	1,88%	1,97%	0,78%
Valores a receber	0,91%	0,52%	0,15%	0,09%	0,43%	0,28%	0,24%	1,50%
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	0,13%	0,12%	-	-	-	-	-	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,76%	-0,33%	-0,34%	-2,12%	-1,16%	-1,07%	-0,62%	-0,58%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	348.579,71	359.516,30	336.712,06	338.234,43	331.340,58	329.577,73	321.686,35	323.096,51
Data da Divulgação	06/02/2020	10/01/2020	09/12/2019	11/11/2019	10/10/2019	06/09/2019	09/08/2019	08/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



VALE ON N1 - VALE3	8,25 %
BRASIL ON NM - BBAS3	6,69 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	6,05 %
BRADESCO PN N1 - BBDC4	5,94 %
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	5,78 %
PETROBRAS ON - PETR3	5,70 %
VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	4,51 %
B3 ON NM - B3SA3	4,39 %
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	3,86 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - SULA11	3,69 %
INTERMEDICA ON NM - GNDI3	3,53 %
AREZZO CO ON NM - ARZZ3	3,47 %
BANCO BMG PN N1 - BMGB4	3,25 %
LOCALIZA ON NM - RENT3	2,98 %
CYRELA REALT ON NM - CYRE3	2,89 %
BRF SA ON NM - BRFS3	2,82 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - ENGI11	2,58 %
PETROBRAS PN - PETR4	2,38 %
Lançamentos positivos menores que 2,38%	22,11 %

CARACTERÍSTICAS

Gestão: RJI Corretora de Valores
 Administrador: RJI Corretora de Valores
 Custodiante: RJI Corretora de Valores
 Auditor: KPMG
 Taxa de Administração: nd
 Taxa de administração máxima: Não possui
 Taxa de Performance: Não possui
 Índice de Performance: Não possui

PERFIL DO FUNDO

Classificação Quantum: Participações
 Classificação Anbima: Fundos de Participações
 Público Alvo: Investidores qualificados
 Objetivo: Proporcionar a valorização das cotas, por meio de investimentos na aquisição direta de ações ou títulos e Valores Mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações.
 Política de investimento: Investe em valores mobiliários de emissão de companhias.

RETORNO (%)

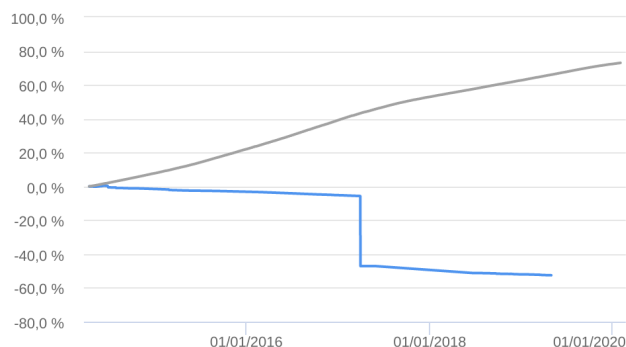
	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,37	-0,34	-0,32
% do CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-70,91	-72,63	-64,61
CDI	73,04	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Dólar	91,83	5,92	16,35	34,85	34,73	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75	-0,12	1,25	4,23	2,37
Euro	53,97	4,44	12,33	20,10	39,17	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80	-0,59	1,00	2,78	1,55
Ibovespa	125,47	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IGP-M	37,61	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

GRÁFICOS

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 16/04/2014 a 31/01/2020 (diária)



Retorno Acumulado - 16/04/2014 a 31/01/2020 (diária)



■ Fundo

■ Fundo

■ CDI

HISTÓRICO

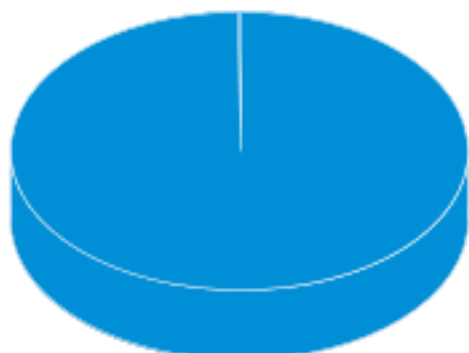
PL Médio 12 meses: -
 Início do Fundo: 19/06/2013
 Máximo Retorno Mensal: - (-)
 Mínimo Retorno Mensal: - (-)
 Nº de Meses com Retorno Positivo: -
 Nº de Meses com Retorno Negativo: -
 Retorno Acumulado Desde o Início: -
 Volatilidade Desde o Início: -

INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00
 Movimentação mínima: Não há
 Saldo mínimo: Não há
 Contato: atendimento@rjicv.com.br
 Disponibilidade dos recursos aplicados: Não se aplica
 Conversão de cota para aplicação: Não se aplica
 Conversão de cota para resgate: Não se aplica
 Disponibilidade dos recursos resgatados: Não se aplica

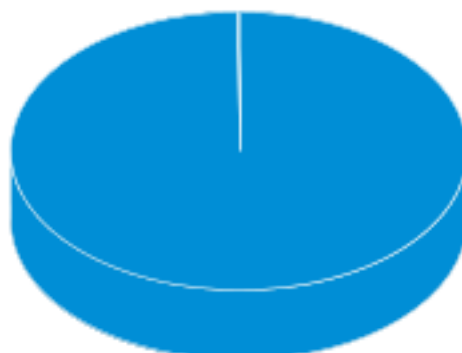
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
 Fonte: Quantum Axis.

Tipo do Ativo



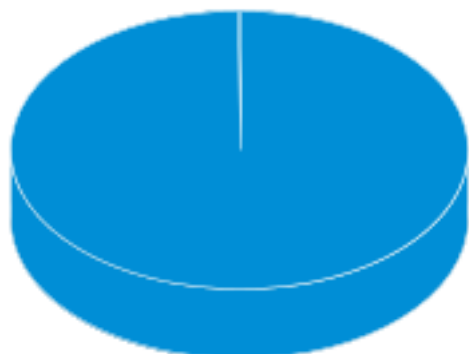
■ Outros 100,00 %

Setor do Ativo



■ Não Classificado 100,00 %
■ Outros 0,00 %

Risco do Ativo



■ Outros 100,00 %

Classe do Ativo



■ Outros 100,00 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Ações / SEED AGE PART SA / CNPJ do emissor: 17.879.798/0001-96 / Denominação Social do emissor: SEED AGE PART SA	4.382,33950	99,1905 %
Operações Compromissadas / Cod. SELIC: 210100 / Venc.: 01/09/2023	51,55649	1,1669 %
Outras Disponibilidades	8,51981	0,1928 %
Outros Valores a receber	0,13935	0,0032 %
Ações / SONG PARTICIPAÇÕES / CNPJ do emissor: 17.882.607/0001-45 / Denominação Social do emissor: SONG PARTICIPAÇÕES	0,00077	0,0000 %
Outros Valores a pagar	-24,44994	-0,5534 %
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	4.418,11	

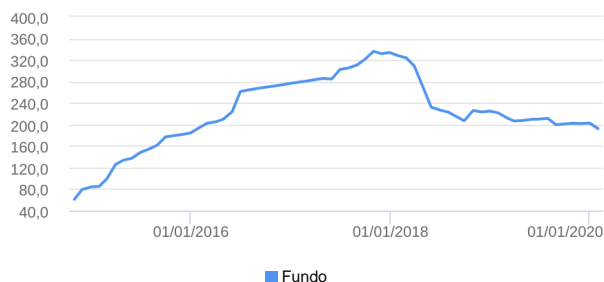
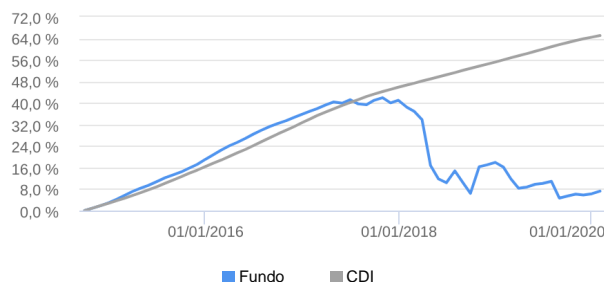
Características do FIDC

Gestão: Aurora Capital	Condomínio: Aberto
Administrador: CM Capital Markets	Prazo do Fundo: Indeterminado
Custodiante: CM Capital Markets	Classificação Legal: FIDC
Auditoria: BDO Brasil	Data de Registro: 19/12/2012
Classificação Anbima: FIDC Outros	Direito Creditório: Crédito Imobiliário
Foco de Atuação: FIDC Multicarteira Outros	Razão de Garantia Mínima: Não informado
Cedente: Multicedente	Política de Investimento: Aplica em direitos creditórios oriundos do segmento imobiliário, representados por CCI, CRI, CCB ou debêntures.

Características da Série

Classe: Sênior	Situação Atual: Em liquidação ordinária
Série: 1	Prazo da Série: Indeterminado
Rating Agência: Austin Rating	Rating Última Atualização: 14/08/2019
Rating Atual: B-	Rating Monitoramento: Manutenção
Rentabilidade Alvo: IPCA +7%	% Mínimo de Cotas Subordinadas: O fundo emitirá somente uma classe de cotas.
Amortização Tipo Regra: Não há	Próxima data de Amortização: Não Há
Início da Série: 30/09/2014	Amortização Principal a Pagar: Como o fundo é aberto; não haverão amortizações.

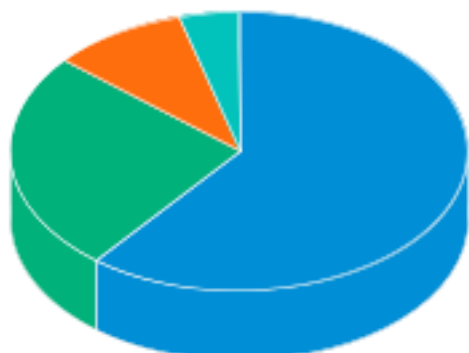
Retorno (%)	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Série	0,90	0,90	2,46	-4,08	-22,53	0,90	0,47	-0,33	0,69	0,72	-5,63	0,72	0,29	0,94	0,43	-3,12	-3,74
CDI	0,38	0,38	2,09	5,26	12,53	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
% CDI	238,53	238,53	117,68	-77,49	-179,77	238,53	125,10	-87,31	143,83	154,86	-1.121,68	127,13	61,11	172,81	82,05	-665,29	-758,05
+ CDI	0,52	0,52	0,37	-9,34	-35,06	0,52	0,09	-0,71	0,21	0,25	-6,13	0,15	-0,18	0,40	-0,09	-3,59	-4,23
IPCA	0,21	0,21	1,94	3,75	8,13	0,21	1,15	0,51	0,10	-0,04	0,11	0,19	0,01	0,13	0,57	0,75	0,43
+ IPCA	0,69	0,69	0,52	-7,83	-30,66	0,69	-0,68	-0,84	0,59	0,76	-5,74	0,53	0,28	0,81	-0,14	-3,87	-4,17
Selic	0,38	0,38	2,09	5,26	12,54	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 01/10/2014 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 01/10/2014 a 31/01/2020 (mensal)


Histórico*	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
FIDC (R\$)	192,31	202,66	201,71	202,38	201,00	199,57	211,47	209,95	209,35	207,40	206,53	213,18
Série (R\$)	192,31	202,66	201,71	202,38	201,00	199,57	211,47	209,95	209,35	207,40	206,53	213,18
Sênior (R\$)	192,31	202,66	201,71	202,38	201,00	199,57	211,47	209,95	209,35	207,40	206,53	213,18
Subordinada/Única (R\$)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
% Subordinação	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%
DC (R\$)	83,29	57,01	87,41	266,11	265,80	265,45	265,38	267,24	268,46	268,09	267,90	268,37
PDD (R\$)	115,06	114,47	113,78	112,68	112,19	111,68	110,74	110,35	108,95	108,95	107,81	99,63
CVNP (R\$)	116,75	115,66	101,19	100,93	100,68	100,64	100,65	100,61	100,56	100,65	98,87	97,76
PDD/DC (%)	138,15%	200,80%	130,17%	42,34%	42,21%	42,07%	41,73%	41,29%	40,58%	40,64%	40,24%	37,12%
DC/PL (%)	43,31%	28,13%	43,33%	131,49%	132,24%	133,01%	125,50%	127,29%	128,24%	129,26%	129,72%	125,89%
CVNP/DC (%)	140,18%	202,89%	115,76%	37,93%	37,88%	37,91%	37,93%	37,65%	37,46%	37,54%	36,91%	36,43%

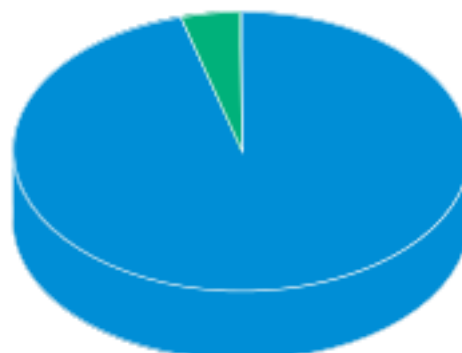
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Mensais.
Fonte: Quantum Axis.

Tipo do Ativo



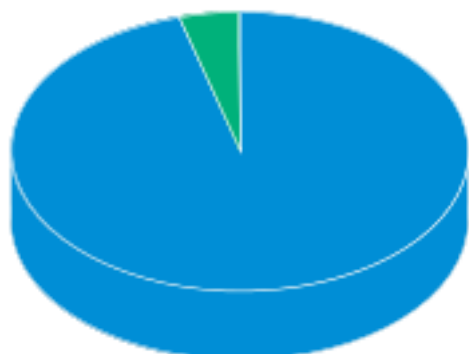
■ Direito Creditório	60,84 %
■ Valores a pagar/receber	25,32 %
■ Fundos de Investimento	9,61 %
■ Títulos Federais	4,23 %

Setor do Ativo



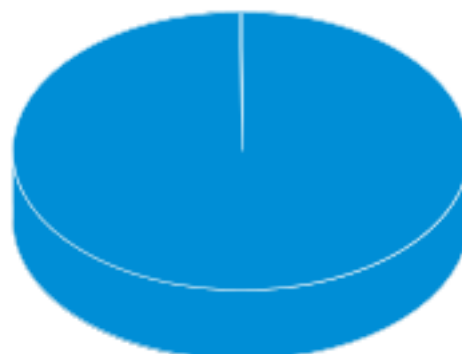
■ Não Classificado	95,77 %
■ Governo Federal	4,23 %

Risco do Ativo



■ Outros	95,77 %
■ Rating AAA	4,23 %

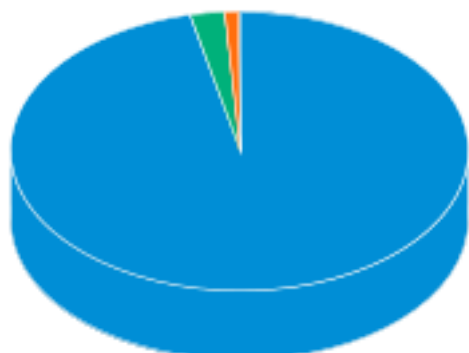
Classe do Ativo



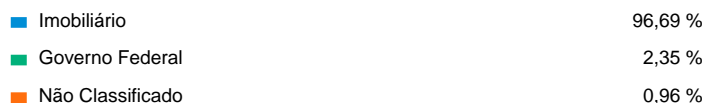
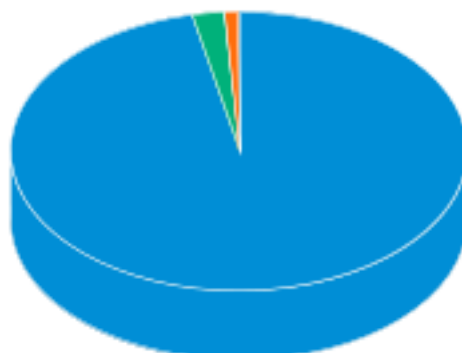
■ Outros	100,00 %
--	----------

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Direitos Creditórios - Crédito Imobiliário	83.286,00000	68,5854 %
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	26.934,00000	22,1799 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	13.153,00000	10,8314 %
Títulos Públicos Federais	5.791,00000	4,7688 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-7.730,00000	-6,3656 %

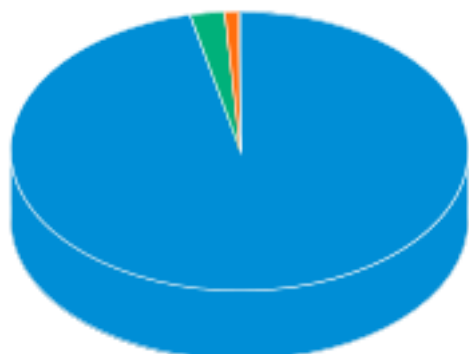
Tipo do Ativo



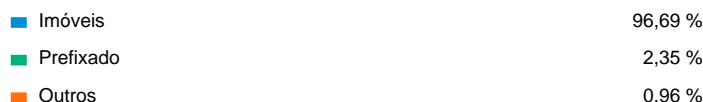
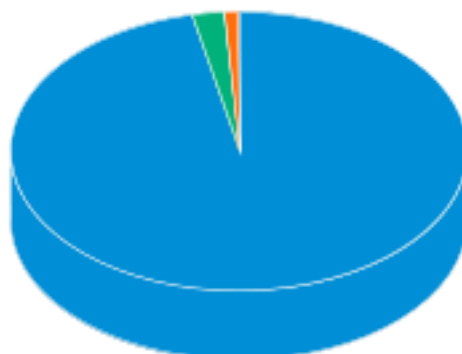
Setor do Ativo



Risco do Ativo



Classe do Ativo



Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Imóveis para Renda - Galpão industrial Alameda do Ipê, 64 - Nova Cavalheiros - Macaé - RJ. Matrícula nº 39.308 do 2º Cartório de Registro de Imóveis. Área construída: 2.193,49m². Área total: 7.031,08m².	18.000,00000	29,8616 %
Imóveis para Renda - Galpão Rua Eduardo Borsari, 2.571 - Indaiatuba - SP. Matrícula nº 51.244 do Cartório de Registro de Imóveis. Área construída: 6.799,31m². Área do terreno: 12.054,33m².	15.200,00000	25,2165 %
Imóveis para Renda - Galpão industrial Rodovia Washington Luiz, KM-108 - Duque de Caxias - RJ. Matrícula nº 18.720 do 1º Cartório de Registro de Imóveis. Área construída: 4.316,55m². Área total: 8.566,89m².	14.038,00000	23,2887 %
Imóveis para Renda - Anhanguera Parque Empresarial Rua Serra Negra, 898 - Cajamar - Jundiaí - SP. Matrícula nº 85.779 do 2º Cartório de Registro de Imóveis. Área: 4.118,96m².	12.600,00000	20,9031 %
Imóveis para Renda - 2º Andar Avenida Rio Branco, 115 - Centro - Rio de Janeiro - RJ. Matrícula nº 44.797 do 7º Cartório de Registro de Imóveis do Rio de Janeiro. Área construída: 490,00m². Área do terreno: 541,00m².	7.900,00000	13,1059 %
Imóveis para Renda - Laje corporativa Rua Rodrigo Silva, 26 - Centro - Rio de Janeiro - RJ Matrícula nº 14.070 do 7º Cartório de Registro de Imóveis. Área construída: 600,00m². Área total: 640,86m².	6.200,00000	10,2857 %
Imóveis para Renda - 10A - Itaboraí - RJ. Matrícula nº 41016 do 1º Cartório de Registro de Imóveis. Área construída: 2.233,46m². Área total: 2.400,00m².	4.312,00000	7,1535 %
LTN	2.082,00000	3,4540 %
Imóveis para Renda - Loja Rua Libero Badaró, 292 - São Paulo - SP Matrícula nº 158.042 do 4º Cartório de Registro de Imóveis. Área construída: 177,50m². Área total: 270,45m².	2.050,00000	3,4009 %
Imóveis para Renda - Edifício Finabank Rua Libero Badaró, 300 - São Paulo - SP Matrícula nº 158.043 do 4º Cartório de	1.710,00000	2,8369 %

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL).

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Registro de Imóveis. Área construída: 143,95m². Área total: 219,33m².		
Imóveis para Renda - Sala 326 e 3 vagas Avenida Armando Lombardi, 800 - Rio de Janeiro- RJ. Matrícula nº 51.088 do 9º Cartório de Registro de Imóveis. Área: 104m².	1.520,00000	2,5216 %
Imóveis para Renda - Itaboraí Rua Prefeito João de Andrade, 25 - Centro - Itaboraí - RJ Matrícula nº 5.809 do 1º Cartório de Registro de Imóveis. Área construída: 261,50m². Área do terreno: 206,65m².	1.040,00000	1,7253 %
Imóveis para Renda - Apartamento 201 e 2º andar Rua Murilo Portugal, 1195 - Niterói - RJ. Matrícula nº 22.949 do 2º Cartório de Registro de Imóveis. Área total: 51,96m².	1.029,00000	1,7071 %
Cotas de ÁTICO IMOBILIÁRIOS FIDC	938,00000	1,5561 %
Disponibilidades	5,00000	0,0083 %
Valores a pagar	-91,00000	-0,1510 %
Patrimônio Líquido (R\$ mil)		60.278,08

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL).

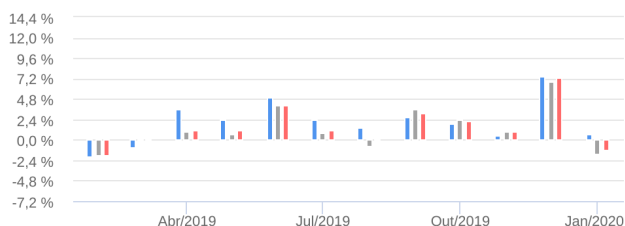
Fonte: Quantum

Características		Informações Operacionais															
CNPJ: 08.279.304/0001-41		Aplicação Mínima: R\$ 20.000,00															
Gestão: Icatu Vanguarda		Aplicação Adicional: R\$ 5.000,00															
Administrador: BEM DTVM		Saldo Mínimo: R\$ 20.000,00															
Taxa de Administração: 2,00%		Resgate Mínimo: R\$ 5.000,00															
Taxa de Administração (Máxima): 2,00%		Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du															
Classificação Anbima: Ações Dividendos		Conversão da Cota para Resgate: D+1 du															
Código de Referência: 173126		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du															
Início do Fundo: 24/10/2006																	
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	501,22	0,62	27,14	61,47	105,48	0,62	7,51	0,46	1,86	2,64	1,47	2,32	5,06	2,33	3,61	-0,81	-1,97
Excesso do Ibovespa	313,21	2,25	10,90	26,81	32,70	2,25	0,66	-0,49	-0,50	-0,93	2,13	1,48	1,00	1,63	2,62	-0,63	-0,11
CDI	260,58	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	188,02	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	276,48	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	121,95	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88
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	6,0122428	2.139.496,71	1.230.382,74	14,70%	-6,99%	6,98%	0,83	7,64%	7,51%	-0,81%	7						
Ibovespa	-	-	-	18,06%	-10,00%	8,57%	1,00	0,00%	6,85%	-1,63%	0						

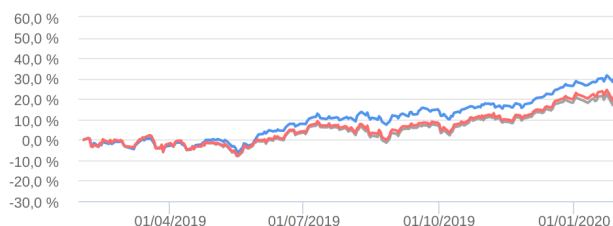
Gráficos

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

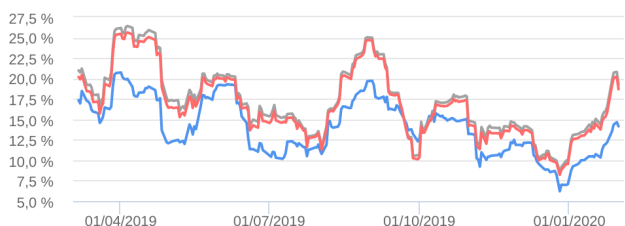
Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)



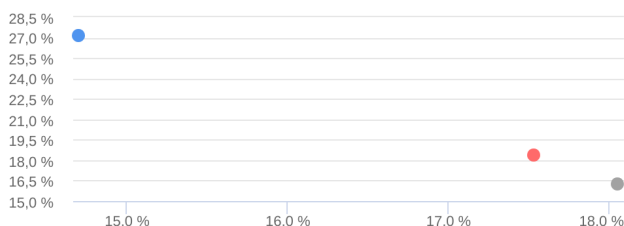
Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)



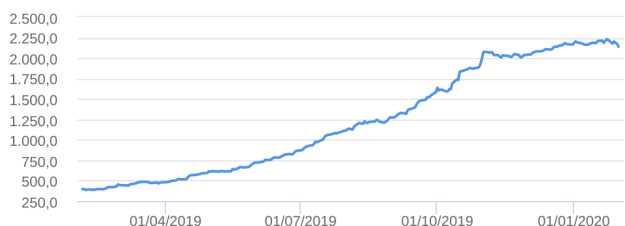
Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)



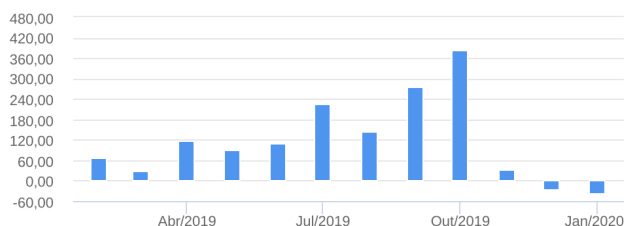
Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)



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

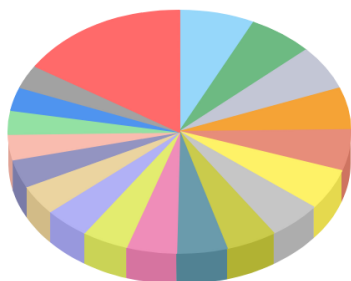
jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.

:: ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Ações	75,33%	71,73%	71,84%	73,23%	71,23%	72,43%	72,09%	63,92%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	18,70%	19,04%	18,48%	17,83%	17,47%	18,27%	19,07%	18,51%
Operações Compromissadas	5,84%	9,40%	8,29%	16,36%	21,08%	9,95%	10,07%	20,84%
Valores a receber	0,85%	0,20%	1,62%	0,21%	0,30%	0,59%	0,60%	0,41%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,72%	-0,37%	-0,23%	-7,63%	-10,08%	-1,24%	-1,84%	-3,68%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.139.496,71	2.163.582,48	2.037.041,66	1.993.815,00	1.581.305,32	1.271.943,15	1.109.653,33	864.248,34
Data da Divulgação	05/02/2020	10/01/2020	14/01/2020	11/11/2019	11/10/2019	26/09/2019	09/08/2019	08/07/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								jan/2020



ITAUSA PN N1 - ITSA4	7,18 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - TAEE11	6,15 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - SAPR11	5,97 %
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	5,61 %
IRBBRASIL RE ON NM - IRBR3	5,53 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2023	5,50 %
BRADESCO ON N1 - BBDC3	5,08 %
LIGHT S/A ON NM - LIGT3	4,81 %
LQJAS RENNER ON NM - LREN3	4,80 %
BR MALLS PAR ON NM - BRML3	4,76 %
TELEF BRASIL PN - VIVT4	4,38 %
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	4,27 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - ALUP11	3,97 %
OMEGA GER ON NM - OMGE3	3,78 %
B3 ON NM - B3SA3	3,41 %
AMBEV S/A ON - ABEV3	3,19 %
COPASA ON NM - CSMG3	3,15 %
VALE ON N1 - VALE3	3,13 %
Lançamentos positivos menores que 3,13%	16,01 %

Características do FIDC

Gestão: Queluz Gestão de Recursos
 Administrador: Planner Corretora
 Custodiante: Planner Corretora
 Auditoria: Baker Tilly Brasil
 Classificação Anbima: FIDC Outros
 Foco de Atuação: FIDC Multicarteira Outros
 Cedente: Multicedente

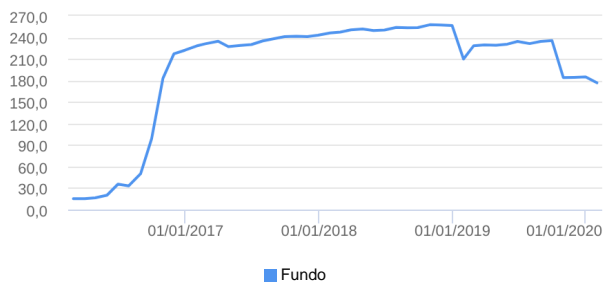
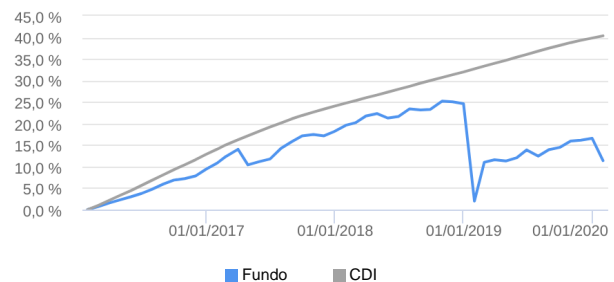
Condomínio: Aberto
 Prazo do Fundo: Indeterminado
 Classificação Legal: FIDC
 Data de Registro: 19/08/2015
 Direito Creditório: Não informado
 Razão de Garantia Mínima: Não se aplica
 Política de Investimento: Aplica em direitos creditórios oriundos de Cédulas de Crédito Imobiliário, de Certificados de Recebíveis Imobiliários, Cédulas de Crédito Bancário e Debêntures.

Características da Série

Classe: Única
 Série: 1
 Rating Agência: LF Rating
 Rating Atual: C
 Rentabilidade Alvo: IPCA +8,5%
 Amortização Tipo Regra: Não há
 Início da Série: 29/01/2016

Situação Atual: Em funcionamento normal
 Prazo da Série: Indeterminado
 Rating Última Atualização: 11/04/2019
 Rating Monitoramento: Rebaixamento
 % Mínimo de Cotas Subordinadas: O fundo emitirá somente uma classe de cotas.
 Próxima data de Amortização: Não se aplica
 Amortização Principal a Pagar: Não se aplica

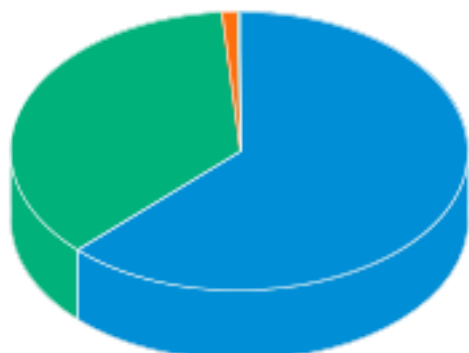
Retorno (%)	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Série	-4,46	-4,46	-2,22	0,34	-6,87	-4,46	0,38	0,19	1,27	0,48	1,32	-1,26	1,61	0,68	-0,27	0,53	8,87
CDI	0,38	0,38	2,09	5,26	12,53	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
% CDI	-1.183,04	-1.183,04	-106,15	6,42	-54,78	-1.183,04	101,52	50,37	265,60	102,92	262,98	-221,41	344,39	125,02	-51,50	112,54	1.796,97
+ CDI	-4,83	-4,83	-4,31	-4,93	-19,40	-4,83	0,01	-0,19	0,79	0,01	0,82	-1,82	1,15	0,14	-0,79	0,06	8,38
IPCA	0,21	0,21	1,94	3,75	8,13	0,21	1,15	0,51	0,10	-0,04	0,11	0,19	0,01	0,13	0,57	0,75	0,43
+ IPCA	-4,67	-4,67	-4,16	-3,41	-14,99	-4,67	-0,77	-0,32	1,17	0,52	1,21	-1,45	1,60	0,55	-0,84	-0,22	8,44
Selic	0,38	0,38	2,09	5,26	12,54	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 01/02/2016 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 01/02/2016 a 31/01/2020 (mensal)


Histórico*	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
FIDC (R\$)	176,73	179,18	183,63	183,92	235,49	234,37	231,32	234,27	230,55	228,99	250,24	228,40
Série (R\$)	176,73	184,97	184,27	183,92	235,49	234,37	231,32	234,27	230,55	228,99	229,60	228,40
Sênior (R\$)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Subordinada/Única (R\$)	176,73	184,97	184,27	183,92	235,49	234,37	231,32	234,27	230,55	228,99	229,60	228,40
% Subordinação	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	-	100,00%	100,00%	-	-	-	-
DC (R\$)	0,25	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	183,10	179,45	0,00	47,60	0,00
PDD (R\$)	0,25	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10,41	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 (%)	100,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	21,88%	0,00%
DC/PL (%)	0,14%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	78,16%	77,84%	0,00%	19,02%	0,00%
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%

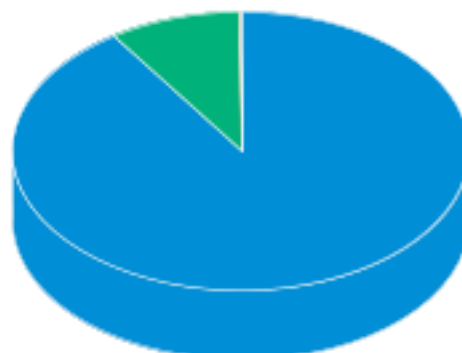
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Mensais.
 Fonte: Quantum Axis.

Tipo do Ativo



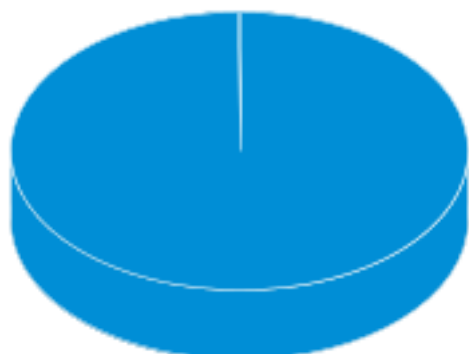
Valores a pagar/receber	62,61 %
Títulos Privados	36,09 %
Fundos de Investimento	1,22 %
Direito Creditório	0,08 %

Setor do Ativo



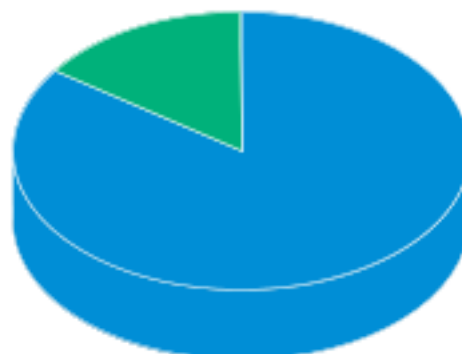
Não Classificado	90,56 %
Bancos	9,36 %
Outros	0,08 %

Risco do Ativo



Outros	100,00 %
--------	----------

Classe do Ativo



Outros	84,78 %
CDI	15,22 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Valores a pagar - Longo Prazo (após 12 meses)	-195.179,00000	232,6052 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-13.085,00000	15,5941 %
Direitos Creditórios	253,00000	-0,3015 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	4.050,00000	-4,8266 %
Letras Financeiras	19.464,00000	-23,1963 %
CDB	31.147,00000	-37,1195 %
Certificado de Recebível Imobiliário	69.440,00000	-82,7553 %

CARACTERÍSTICAS

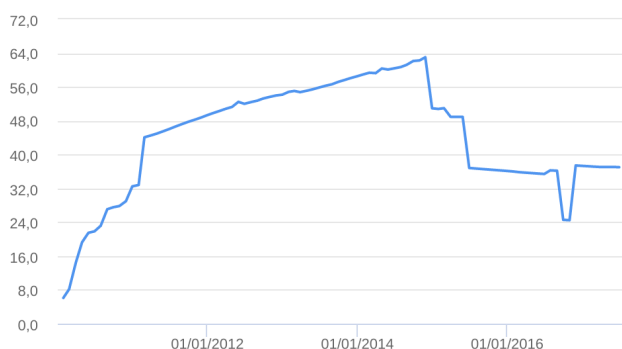
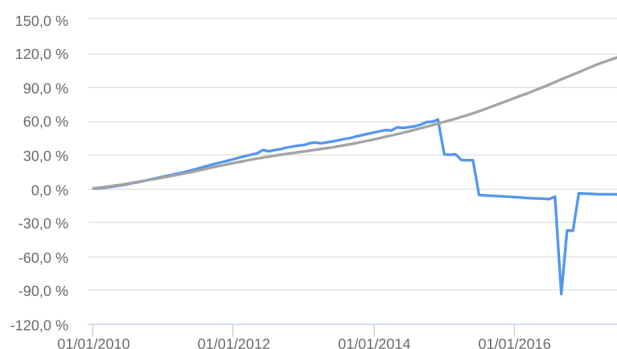
Gestão: RJI Gestão & Investimentos
 Administrador: RJI Corretora de Valores
 Custodiante: RJI Corretora de Valores
 Auditor: KPMG
 Taxa de Administração: 0,18%
 Taxa de administração máxima: Não possui
 Taxa de Performance: 25,00%
 Índice de Performance: 120% do CDI

PERFIL DO FUNDO

Classificação Quantum: Direito Creditório
 Classificação Anbima: FIDC Outros
 Público Alvo: Investidores qualificados
 Objetivo: Investir preponderantemente em direitos creditórios e o excedente em
 Política de investimento: Aplica em direitos creditórios performados, oriundos dos segmentos industrial, comercial, agropecuário, financeiro, imobiliário e de prestação de serviços.

RETORNO (%)

	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
% do CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	157,71	1,30	4,62	11,87	20,93	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54
Dólar	211,68	34,64	37,72	55,90	69,68	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75	-0,12
Euro	136,64	30,96	35,03	41,16	70,25	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80	-0,59
Ibovespa	17,38	-30,39	-17,03	-6,51	23,09	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70
IGP-M	92,42	2,50	6,21	15,93	18,12	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45

GRÁFICOS
Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/01/2010 a 30/06/2017 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/01/2010 a 30/06/2017 (mensal)


■ Fundo

■ Fundo

■ CDI

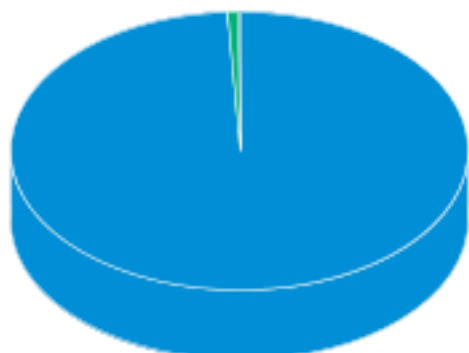
HISTÓRICO

PL Médio 12 meses: -
 Início do Fundo: 31/12/2009
 Máximo Retorno Mensal: - (-)
 Mínimo Retorno Mensal: - (-)
 Nº de Meses com Retorno Positivo: -
 Nº de Meses com Retorno Negativo: -
 Retorno Acumulado Desde o Início: -
 Volatilidade Desde o Início: -

INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

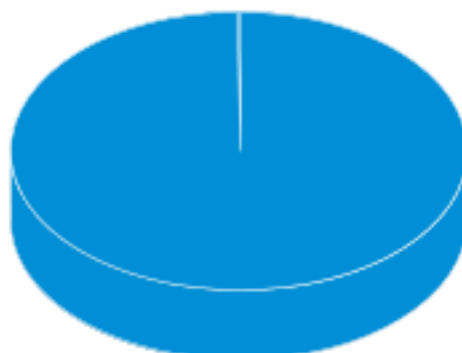
Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00
 Movimentação mínima: Não há
 Saldo mínimo: Não há
 Contato: atendimento@rjgestora.com.br
 Disponibilidade dos recursos aplicados: Não se aplica
 Conversão de cota para aplicação: Não se aplica
 Conversão de cota para resgate: Não se aplica
 Disponibilidade dos recursos resgatados: Não se aplica

Tipo do Ativo



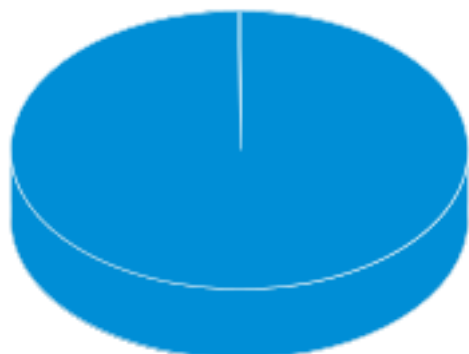
■ Direito Creditório 99,16 %
■ Outros 0,84 %

Sector do Ativo



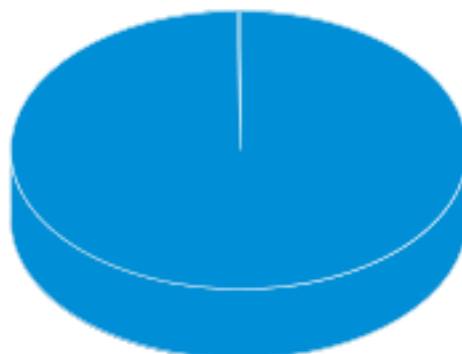
■ Outros 100,00 %

Risco do Ativo



■ Outros 100,00 %

Classe do Ativo



■ Outros 100,00 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Direitos Creditórios - Multiclasse	37.788,00000	25.330,6787 %
Outros Valores Mobiliários	321,00000	215,1780 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-1.049,00000	-703,1831 %
Patrimônio Líquido (R\$ mil)		149,18

Características do FIDC

Gestão: RJI Corretora de Valores
 Administrador: Gradual Investimentos
 Custodiante: RJI Corretora de Valores
 Auditoria: KPMG
 Classificação Anbima: FIDC Outros
 Foco de Atuação: FIDC Multicarteira Outros
 Cedente: Multicedente

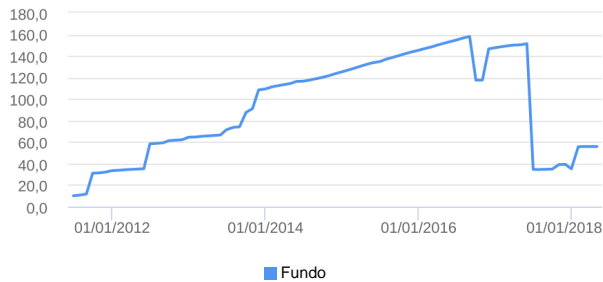
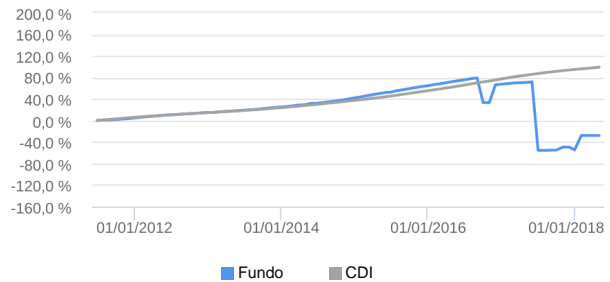
Condomínio: Aberto
 Prazo do Fundo: Indeterminado
 Classificação Legal: FIDC
 Data de Registro: 28/04/2011
 Direito Creditório: Multiclasse
 Razão de Garantia Mínima: Não se aplica
 Política de Investimento: Aplica em direitos creditórios performados e a vencer, oriundos dos segmentos industrial, comercial, financeiro, agropecuário, imobiliário e de serviços.

Características da Série

Classe: Única
 Série: 1
 Rating Agencia: SR Rating
 Rating Atual: brB
 Rentabilidade Alvo: 120% do CDI
 Amortização Tipo Regra: Não há
 Início da Série: 03/06/2011

Situação Atual: Em funcionamento normal
 Prazo da Série: 5 anos
 Rating Última Atualização: 19/08/2016
 Rating Monitoramento: Rebaixamento
 % Mínimo de Cotas Subordinadas: O fundo emitirá somente uma classe de cotas.
 Próxima data de Amortização: Não se aplica
 Amortização Principal a Pagar: Não se aplica

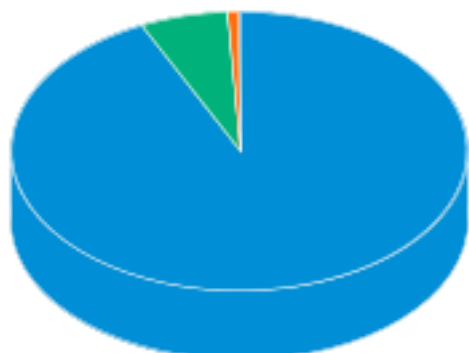
Retorno (%)	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19
Série	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	0,28	1,30	2,07	4,62	11,87	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54
% CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
+ CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA	-0,31	0,22	1,89	2,27	7,46	-0,31	0,07	0,25	0,21	1,15	0,51	0,10	-0,04	0,11	0,19	0,01	0,13
+ IPCA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Selic	0,28	1,30	2,07	4,62	11,87	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 06/06/2011 a 30/04/2018 (mensal)

Retorno Acumulado - 06/06/2011 a 30/04/2018 (mensal)


Histórico*	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19
FIDC (R\$)	56,74	56,80	56,88	56,94	56,97	56,99	57,10	57,17	56,76	56,76	56,72	56,77
Série (R\$)	56,74	56,80	56,88	56,94	56,97	56,99	57,10	57,17	56,74	56,76	56,72	56,77
Sênior (R\$)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Subordinada/Única (R\$)	56,74	56,80	56,88	56,94	56,97	56,99	57,10	57,17	56,74	56,76	56,72	56,77
% Subordinação	-	-	-	-	-	-	100,00%	100,00%	0,00%	100,00%	100,00%	100,00%
DC (R\$)	153,66	153,66	153,66	153,66	153,66	153,66	154,25	154,25	153,79	153,79	153,79	153,79
PDD (R\$)	108,45	108,45	108,45	108,45	107,75	107,75	107,75	107,75	107,75	107,75	107,75	107,75
CVNP (R\$)	153,66	153,66	153,66	153,66	153,66	153,66	154,25	154,25	153,79	153,79	0,00	0,00
PDD/DC (%)	70,58%	70,58%	70,58%	70,58%	70,12%	70,12%	69,85%	69,85%	70,06%	70,06%	70,06%	70,06%
DC/PL (%)	270,82%	270,54%	270,15%	269,88%	269,70%	269,60%	270,15%	269,80%	270,95%	270,95%	271,13%	270,89%
CVNP/DC (%)	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	0,00%	0,00%

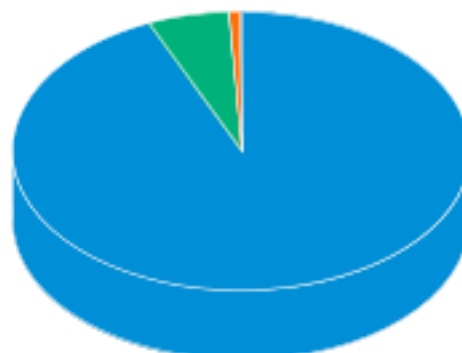
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Mensais.
 Fonte: Quantum Axis.

Tipo do Ativo



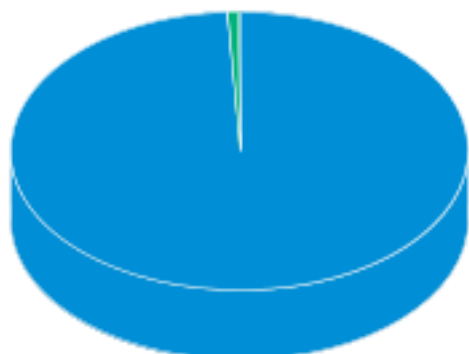
■ Direito Creditório	92,91 %
■ Fundos de Investimento	6,33 %
■ Títulos Federais	0,75 %

Setor do Ativo



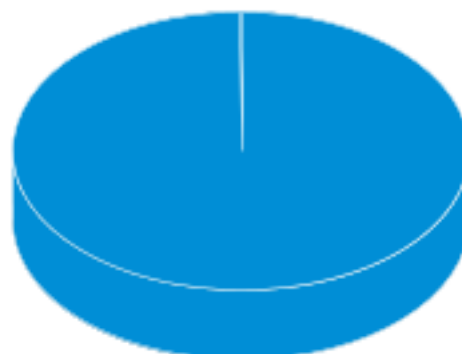
■ Outros	93,31 %
■ Não Classificado	5,93 %
■ Governo Federal	0,76 %

Risco do Ativo



■ Outros	99,24 %
■ Rating AAA	0,76 %

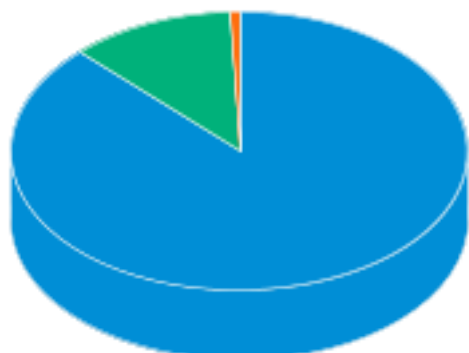
Classe do Ativo



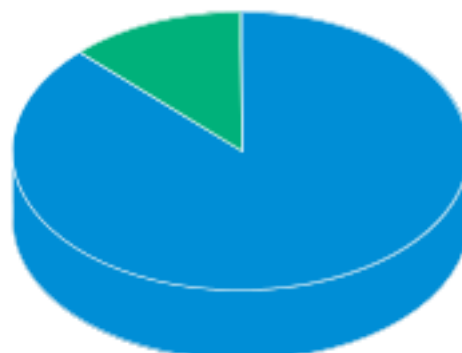
■ Outros	100,00 %
----------	----------

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Direitos Creditórios - Multiclasse	153.660,00000	269,8797 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	10.474,00000	18,3959 %
Títulos Públicos Federais	1.245,00000	2,1866 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-703,00000	-1,2347 %
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	56.936,48	

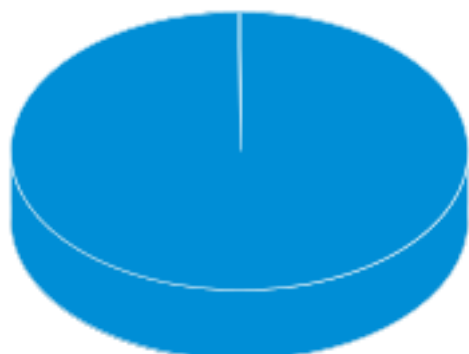
Tipo do Ativo



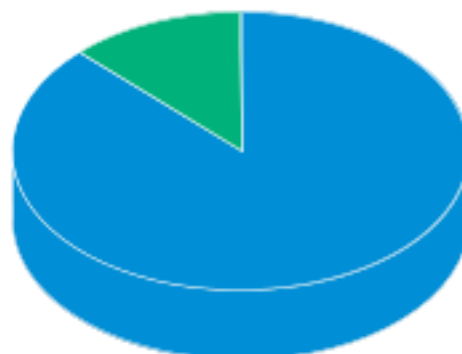
Setor do Ativo



Risco do Ativo



Classe do Ativo



Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Ação de Companhia Fechada - RIO JACUTINGA PARTICIPAÇÕES S.A. ON (18.651.594/0001-66)	92.171,00000	87,6548 %
Cotas de FI RENDA FIXA	12.315,00000	11,7116 %
Outros Valores a receber	731,00000	0,6952 %
Disponibilidades	30,00000	0,0285 %
Ação de Companhia Fechada - PORTO REAL S.A. ON	10,00000	0,0095 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	-105,00000	-0,0999 %
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	105.152,28	

INSTITUIÇÕES

Gestão: Infra Asset Management
 Diretor: Ricardo Kassardjian
 Gestor: Ricardo Kassardjian

Administrador: RJI Corretora de Valores
 Custodiante: RJI Corretora de Valores
 Auditor: BDO Brasil

PERFIL DO FUNDO

Política de Investimento: Investe em ações, debêntures, bônus de subscrição e outros Títulos e Valores Mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações de emissão de empresas dos setores de saneamento ambiental, energia e atividades correlatas.

Companhias Alvo: No setor de saneamento ambiental e energia.

Objetivo: Obter retornos superiores ao IPCA + 10% a.a., no longo prazo, por meio de investimentos em carteira diversificada de valores mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações.

Limite de Concentração por Companhia: 100%

CARACTERÍSTICAS

Tipo Investidor Anbima: Não há restrição
 Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
 Quantidade de Classes: 1.0
 Benchmark: IPCA + 10%
 Negociação em Mercado Secundário: Não informado

Data de Registro: 19/12/2011
 Situação Atual: Em funcionamento normal
 Classificação Anbima: Fundos de Participações
 Classificação Quantum: Participações
 Classificação Legal: FIP

DADOS PATRIMONIAIS

Patrimônio Autorizado Última Emissão: R\$ 500.000.000,00
 Patrimônio Inicial Mínimo: R\$ 200.000.000,00
 Patrimônio Inicial Máximo: R\$ 500.000.000,00
 Preço Inicial por Cota: R\$ 1.000,00

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

31/12/2019: R\$ 412.483.940,57
 30/09/2019: R\$ 414.103.658,14
 28/06/2019: R\$ 414.713.537,57
 29/03/2019: R\$ 415.786.938,31

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

Tipo de Cobrança: Taxa (%)
 Taxa de Administração: 2,00%
 Taxa de Administração Financeira: Não se aplica

TAXA DE PERFORMANCE

Taxa de Performance: 20,00%
 Critério de Apuração: Excesso de retorno
 Índice de Referência: 100% do IPCA + 10% a.a.

PRAZOS DE INVESTIMENTOS

Prazo de Duração do Fundo: 10 anos
 Período de Investimento: 5 anos
 Período de Investimento Extensão: Não informado
 Período de Desinvestimento: 5 anos
 Período de Desinvestimento Extensão: Não informado

CONTATO

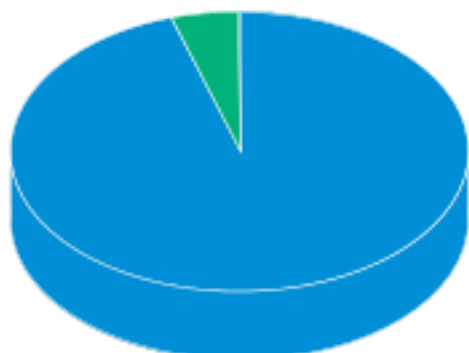
Site: www.infraasset.com
 Email: contato@infraasset.com
 Telefone: (11) 3165-8100

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

SETEMBRO/2019

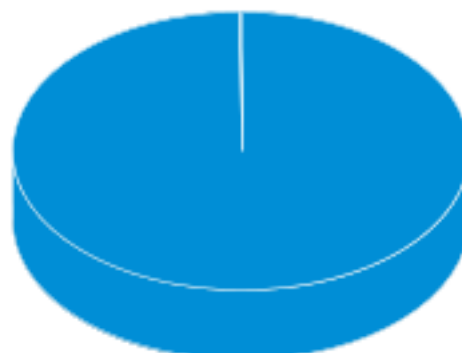
Ativo	Valor Investido (R\$ mil)	Participação
Ações / CONASA / CNPJ do emissor: 08.837.556/0001-49 / Denominação Social do emissor: CONASA	435.815,11	105,24%
Outros Valores a pagar	-21.751,91	-5,25%
Cotas de fundos de investimento - Instrução Nº 409 / RENDAFIXA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA SIMPLES	37,21	0,01%
Outras Disponibilidades	2,23	0,00%
Outros Valores a receber	1,02	0,00%

Tipo do Ativo



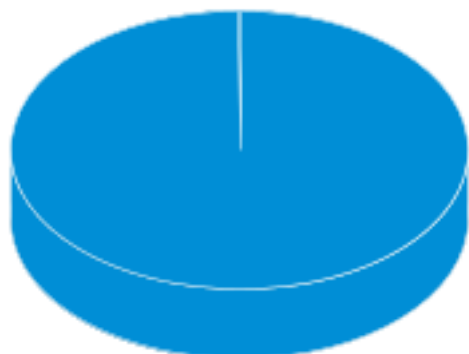
■ Outros	95,25 %
■ Valores a pagar/receber	4,75 %

Sector do Ativo



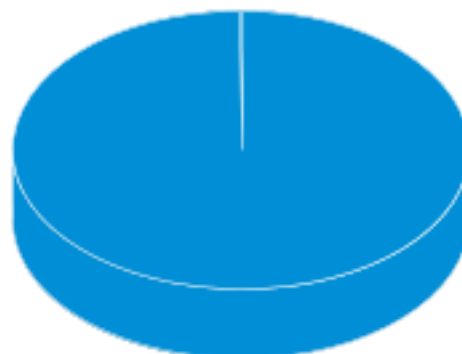
■ Não Classificado	100,00 %
■ Outros	0,00 %

Risco do Ativo



■ Outros	100,00 %
----------	----------

Classe do Ativo



■ Outros	100,00 %
----------	----------

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Ações / CONASA / CNPJ do emissor: 08.837.556/0001-49 / Denominação Social do emissor: CONASA	435.815,11050	105,2430 %
Cotas de fundos de investimento - Instrução Nº 409 / RENDAFIXA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA SIMPLES	37,21005	0,0090 %
Outras Disponibilidades	2,23187	0,0005 %
Outros Valores a receber	1,02034	0,0002 %
Outros Valores a pagar	-21.751,91462	-5,2528 %

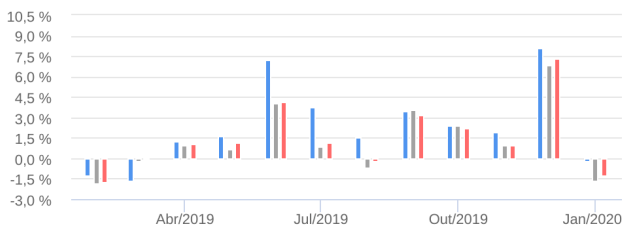
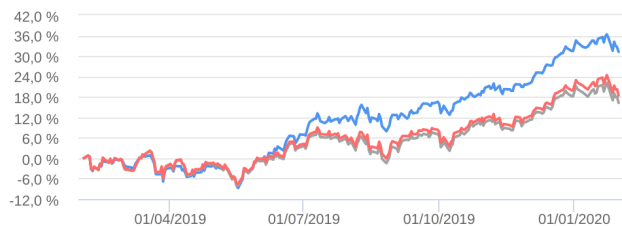
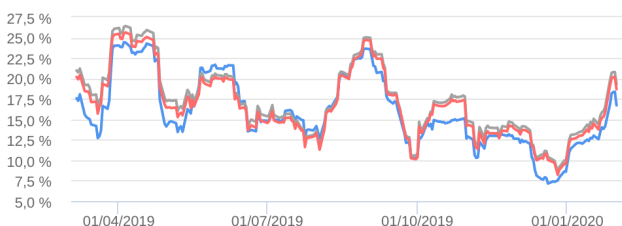
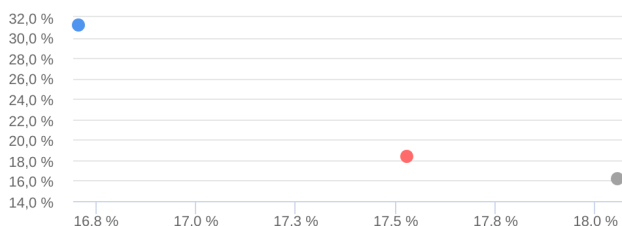
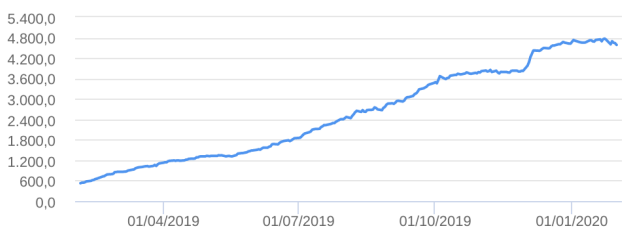
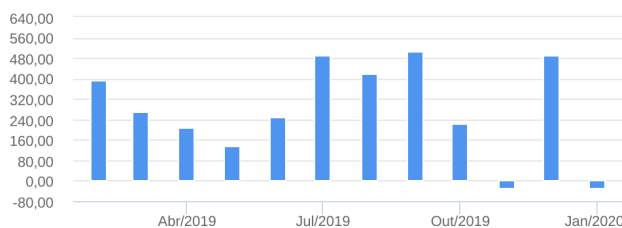
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 24.571.992/0001-75	Aplicação Mínima: R\$ 100,00
Gestão: Itaú Unibanco	Aplicação Adicional: R\$ 100,00
Administrador: Itaú Unibanco	Saldo Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração: 1,90%	Resgate Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração (Máxima): 2,00%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Ações Livre	Conversão da Cota para Resgate: D+21 du
Código de Referência: 423701	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+23 du
Início do Fundo: 12/09/2016	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	137,03	-0,19	31,22	60,56	107,13	-0,19	8,13	1,90	2,38	3,42	1,57	3,75	7,22	1,62	1,28	-1,68	-1,26
Excesso do Ibovespa	42,85	1,44	14,97	25,91	34,34	1,44	1,28	0,95	0,02	-0,15	2,23	2,91	3,17	0,92	0,30	-1,51	0,60
CDI	29,40	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	94,18	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	97,58	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	16,29	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	23,702885	4.585.787,42	2.578.920,34	16,71%	-9,59%	7,93%	0,86	5,80%	8,13%	-1,68%	9
Ibovespa	-	-	-	18,06%	-10,00%	8,57%	1,00	0,00%	6,85%	-1,63%	0

Gráficos

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

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

jan/2020

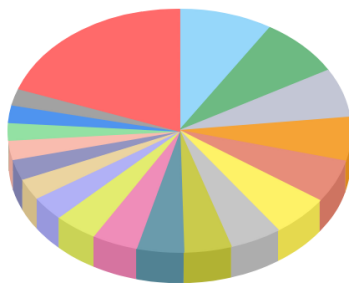
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

:: ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	100,13%	101,35%	101,18%	100,96%	100,78%	101,13%	100,79%	100,84%
Valores a receber	0,07%	0,08%	0,13%	0,09%	0,28%	0,09%	0,10%	0,29%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,21%	-1,43%	-1,31%	-1,05%	-1,06%	-1,22%	-0,89%	-1,13%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	4.585.787,42	4.621.308,30	3.818.759,95	3.774.193,69	3.465.972,95	2.860.793,40	2.402.234,10	1.843.550,06
Data da Divulgação	07/02/2020	08/01/2020	06/12/2019	07/11/2019	05/10/2019	06/09/2019	07/08/2019	05/07/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								jan/2020



Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - ENGI11	9,42 %
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	8,34 %
IRBBRASIL RE ON NM - IRBR3	6,94 %
Outros Valores a pagar	6,19 %
EZTEC ON NM - EZTC3	6,07 %
AMBEV S/A ON - ABEV3	5,81 %
LFT - Venc.: 01/09/2025	5,22 %
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	4,75 %
TOTVS ON NM - TOTS3	4,72 %
SUZANO PAPELON NM - SUZB3	4,58 %
PETROBRAS DISTRIB ON - BRDT3	4,33 %
CEA MODAS ON NM - CEAB3	3,45 %
Investimento no Exterior - MERCADOLIBRE INC	2,98 %
CYRE COM-CCP ON NM - CCPR3	2,92 %
FLEURY ON NM - FLRY3	2,72 %
P.ACUCAR-CBD PN N1 - PCAR4	2,48 %
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	2,45 %
GERDAU PN N1 - GGBR4	2,37 %
Lançamentos positivos menores que 2,37%	20,54 %

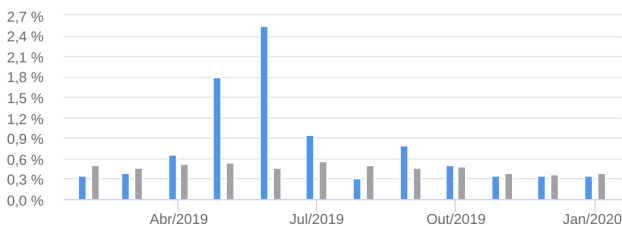
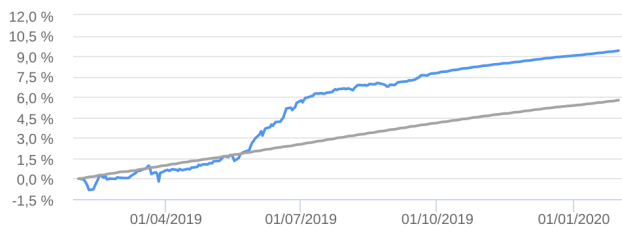
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 21.838.150/0001-49	Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00
Gestão: Itaú Unibanco	Aplicação Adicional: R\$ 1,00
Administrador: Itaú Unibanco	Saldo Mínimo: R\$ 1,00
Taxa de Administração: 0,40%	Resgate Mínimo: R\$ 1,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,40%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 399892	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du
Início do Fundo: 01/06/2015	

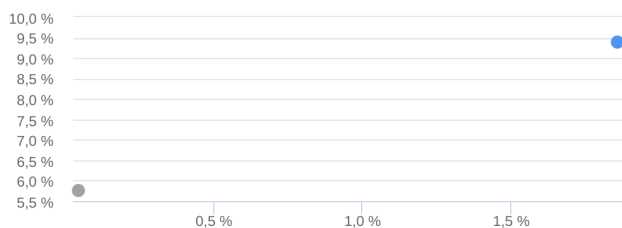
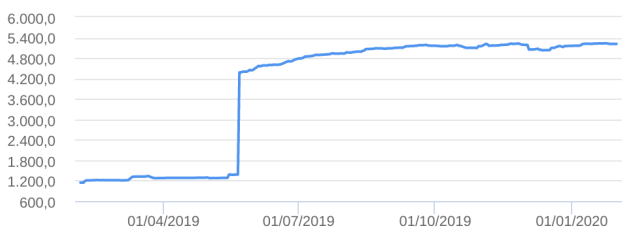
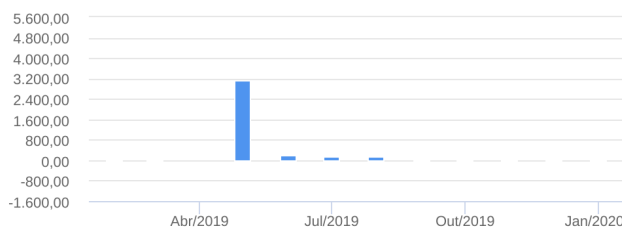
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	75,84	0,34	9,39	19,79	34,25	0,34	0,34	0,35	0,50	0,78	0,32	0,95	2,55	1,80	0,66	0,39	0,34
% do CDI	142,62	90,48	163,12	157,50	146,85	90,48	91,74	91,67	103,57	168,78	63,16	166,84	543,38	330,94	127,71	82,80	69,05
CDI	53,18	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	114,52	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	118,68	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	31,85	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	17,584296	5.214.674,76	3.928.614,15	1,86%	-1,15%	0,88%	2,80	1,86%	2,55%	0,32%	6
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

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

jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

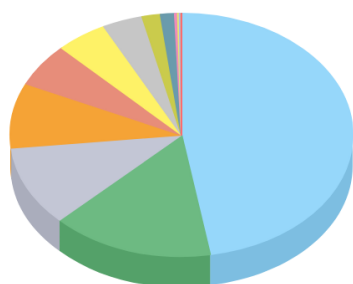
:: ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	100,00%	100,03%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	99,99%	99,99%
Valores a receber	0,15%	0,00%	0,26%	0,04%	0,21%	0,04%	0,04%	0,04%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,15%	-0,03%	-0,26%	-0,05%	-0,21%	-0,03%	-0,04%	-0,03%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	5.214.674,76	5.156.074,28	5.189.532,77	5.147.659,27	5.159.078,11	5.084.742,95	4.931.118,97	4.747.724,01
Data da Divulgação	07/02/2020	07/01/2020	06/12/2019	06/11/2019	05/10/2019	06/09/2019	07/08/2019	05/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2022	47,48 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2024	15,32 %
LFT - Venc.: 01/09/2021	10,70 %
LFT - Venc.: 01/09/2025	8,68 %
LFT - Venc.: 01/09/2023	5,77 %
LFT - Venc.: 01/03/2023	4,86 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2022	3,78 %
LFT - Venc.: 01/03/2024	1,74 %
LFT - Venc.: 01/09/2022	1,33 %
Outros Valores a pagar	0,30 %
Outros Valores a receber	0,15 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2021	0,13 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2021	0,03 %
LFT - Venc.: 01/03/2026	0,01 %
LFT - Venc.: 01/09/2024	0,01 %
LFT - Venc.: 01/03/2025	0,01 %
LFT - Venc.: 01/03/2021	0,00 %
LFT - Venc.: 01/03/2022	0,00 %
Lançamentos positivos menores que 0,00%	0,00 %

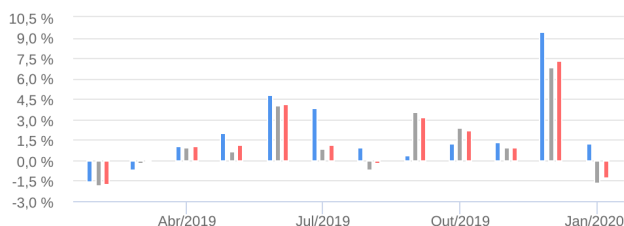
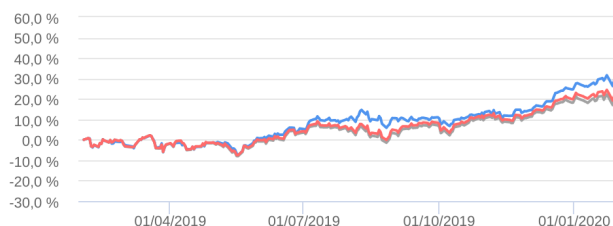
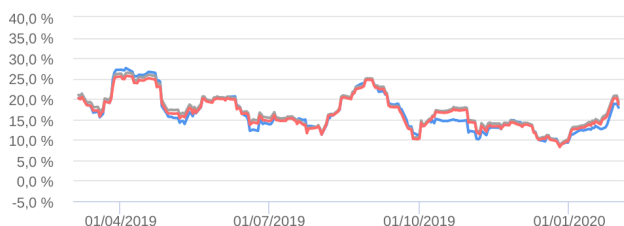
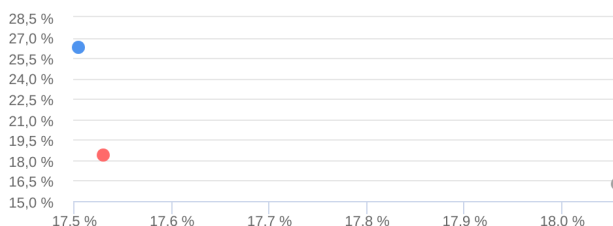
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 16.718.302/0001-30	Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00
Gestão: Itaú Unibanco	Aplicação Adicional: R\$ 1,00
Administrador: Itaú Unibanco	Saldo Mínimo: R\$ 250,00
Taxa de Administração: 2,50%	Resgate Mínimo: R\$ 1,00
Taxa de Administração (Máxima): 2,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Ações Livre	Conversão da Cota para Resgate: D+21 du
Código de Referência: 318231	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+23 du
Início do Fundo: 31/10/2012	

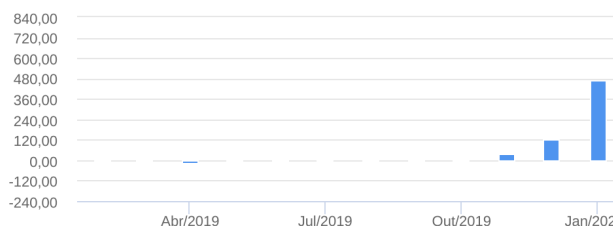
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	181,71	1,27	26,24	58,59	103,34	1,27	9,45	1,37	1,20	0,34	0,99	3,84	4,76	2,05	1,08	-0,70	-1,51
Excesso do Ibovespa	82,36	2,90	10,00	23,93	30,56	2,90	2,60	0,43	-1,16	-3,23	1,65	3,00	0,71	1,35	0,09	-0,52	0,35
CDI	94,42	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	99,34	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	131,74	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	50,52	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	28,170688	1.376.050,19	707.388,61	17,50%	-9,45%	8,31%	0,91	5,63%	9,45%	-0,70%	8
Ibovespa	-	-	-	18,06%	-10,00%	8,57%	1,00	0,00%	6,85%	-1,63%	0

Gráficos

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

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

jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

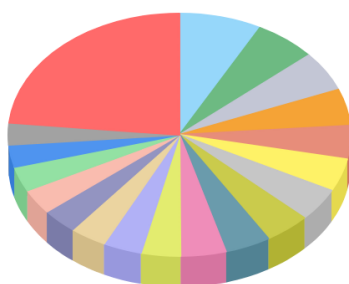
:: ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	100,73%	100,69%	100,23%	100,24%	100,49%	101,25%	100,89%	100,09%
Valores a receber	0,11%	0,36%	0,22%	0,18%	0,16%	0,18%	0,24%	0,27%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,84%	-1,05%	-0,45%	-0,41%	-0,65%	-1,43%	-1,13%	-0,35%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.376.050,19	895.445,37	707.425,05	657.114,26	658.258,25	664.746,99	666.178,49	652.832,55
Data da Divulgação	07/02/2020	07/01/2020	06/12/2019	06/11/2019	05/10/2019	06/09/2019	07/08/2019	05/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2020	8,26 %
Outros Valores a pagar	6,19 %
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	5,65 %
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	5,16 %
LOCALIZA ON NM - RENT3	4,72 %
SUL AMERICA UNT N2 - SULA11	4,67 %
B3 ON NM - B3SA3	4,65 %
INTERMEDICA ON NM - GNDI3	4,59 %
ALIANSCSONAEON NM - ALSO3	4,57 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	4,54 %
PETROBRAS DISTRIB ON - BRDT3	3,95 %
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	3,86 %
PETROBRAS PN - PETR4	3,68 %
BTGP BANCO UNT - BPAC11	3,57 %
LOCAMERICA ON NM - LCAM3	3,53 %
GRUPO NATURAON NM - NTCO3	3,51 %
VALE ON N1 - VALE3	3,13 %
CESP PNB N1 - CESP6	3,09 %
Lançamentos positivos menores que 3,09%	24,87 %

Características do FIDC

Gestão: Graphen Investimentos
 Administrador: Morall Capital
 Custodiante: Morall Capital
 Auditoria: Next Auditores Independentes
 Classificação Anbima: FIDC Financeiro
 Foco de Atuação: FIDC Multicarteira Financeiro
 Cedente: Multicedente

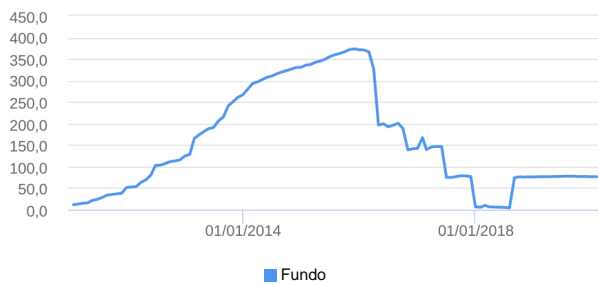
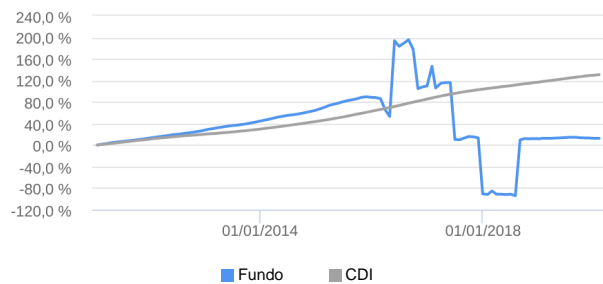
Condomínio: Aberto
 Prazo do Fundo: Indeterminado
 Classificação Legal: FIDC
 Data de Registro: 04/10/2010
 Direito Creditório: Recebíveis Comerciais
 Razão de Garantia Mínima: 105,26%
 Política de Investimento: Aplica em direitos de crédito oriundos de operações realizadas nos segmentos financeiro, comercial, industrial, agropecuário, imobiliário, hipotecário, de arrendamento mercantil e de prestação de serviços.

Características da Série

Classe: Sênior
 Série: 1
 Rating Agência: SR Rating
 Rating Atual: brCC
 Rentabilidade Alvo: IPCA +7%
 Amortização Tipo Regra: Não há
 Início da Série: 10/01/2011

Situação Atual: Em funcionamento normal
 Prazo da Série: Indeterminado
 Rating Última Atualização: 29/01/2020
 Rating Monitoramento: Manutenção
 % Mínimo de Cotas Subordinadas: 5% 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	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Série	-0,11	-0,11	-1,86	-0,18	1.261,32	-0,11	-0,43	-0,18	-0,23	-0,92	0,03	0,40	0,54	0,26	0,45	0,01	0,03
CDI	0,38	0,38	2,09	5,26	12,53	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
% CDI	-28,51	-28,51	-88,70	-3,40	10.064,67	-28,51	-114,44	-47,18	-47,74	-199,00	5,74	70,84	115,48	48,56	86,29	2,96	6,33
+ CDI	-0,48	-0,48	-3,95	-5,44	1.248,79	-0,48	-0,80	-0,56	-0,71	-1,39	-0,47	-0,17	0,07	-0,28	-0,07	-0,45	-0,46
IPCA	0,21	0,21	1,94	3,75	8,13	0,21	1,15	0,51	0,10	-0,04	0,11	0,19	0,01	0,13	0,57	0,75	0,43
+ IPCA	-0,32	-0,32	-3,80	-3,92	1.253,19	-0,32	-1,58	-0,69	-0,33	-0,88	-0,08	0,21	0,53	0,13	-0,12	-0,74	-0,40
Selic	0,38	0,38	2,09	5,26	12,54	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 11/01/2011 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 11/01/2011 a 31/01/2020 (mensal)


Histórico*	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
FIDC (R\$)	76,20	76,28	76,61	76,75	76,92	77,64	77,62	77,31	76,89	76,69	76,35	76,34
Série (R\$)	76,20	76,28	76,61	76,75	76,92	77,64	77,62	77,31	76,89	76,69	76,35	76,34
Sênior (R\$)	76,20	76,28	76,61	76,75	76,92	77,64	77,62	77,31	76,89	76,69	76,35	76,34
Subordinada/Única (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
% Subordinação	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 (R\$)	452,68	452,56	74,91	452,61	467,16	475,63	475,29	584,81	584,56	584,18	583,72	583,49
PDD (R\$)	377,75	377,70	84,38	377,72	392,13	400,81	400,76	510,52	510,52	510,52	510,52	510,52
CVNP (R\$)	452,68	452,56	318,58	452,61	467,16	475,63	475,29	584,81	584,56	584,18	583,72	583,49
PDD/DC (%)	83,45%	83,46%	112,64%	83,45%	83,94%	84,27%	84,32%	87,30%	87,33%	87,39%	87,46%	87,49%
DC/PL (%)	594,08%	593,28%	97,79%	589,75%	607,32%	612,61%	612,36%	756,49%	760,26%	761,77%	764,58%	764,38%
CVNP/DC (%)	100,00%	100,00%	425,27%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, 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 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Mensais.
 Fonte: Quantum Axis.

Tipo do Ativo



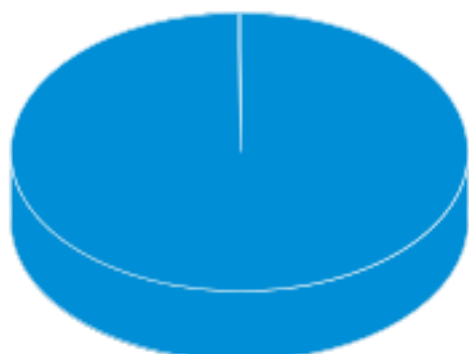
■ Direito Creditório	49,93 %
■ Nota Promissória	38,17 %
■ Outros	11,75 %
■ Fundos de Investimento	0,11 %
■ Valores a pagar/receber	0,02 %
■ Operação compromissada	0,01 %

Setor do Ativo



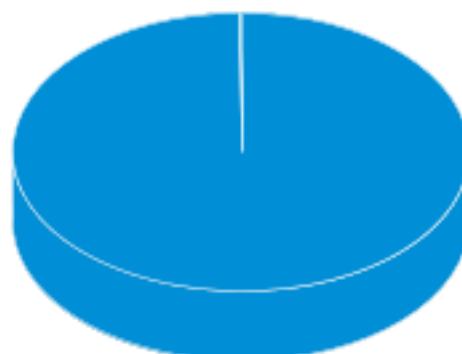
■ Não Classificado	50,07 %
■ Outros	49,93 %

Risco do Ativo



■ Outros	100,00 %
----------	----------

Classe do Ativo



■ Outros	99,99 %
■ Prefixado	0,01 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Direitos Creditórios - Recebíveis Comerciais	452.677,00000	49,9488 %
Notas Promissórias Comerciais	346.113,00000	38,1904 %
Outros Valores Mobiliários	106.565,00000	11,7585 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	1.038,00000	0,1145 %
Operações Compromissadas	74,00000	0,0082 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-185,00000	-0,0204 %

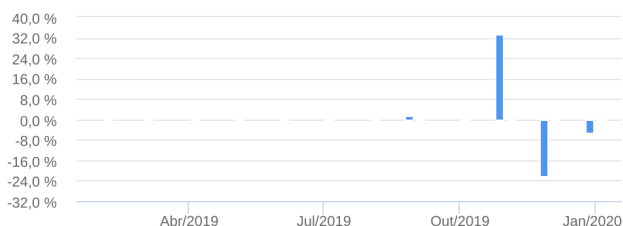
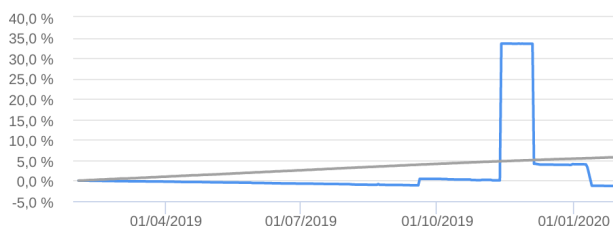
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 09.613.226/0001-32	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: Brasil Plural	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: Intrader DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 1,40%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 2,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	Conversão da Cota para Resgate: D+0 ou D+1080 (isento de taxa de resgate)
Código de Referência: 219924	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 ou D+1081 (isento de taxa de resgate)
Início do Fundo: 19/11/2008	

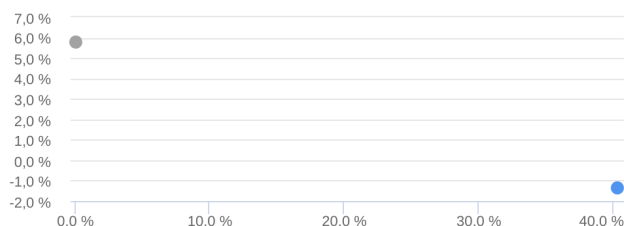
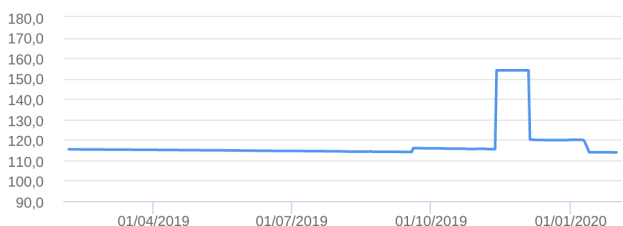
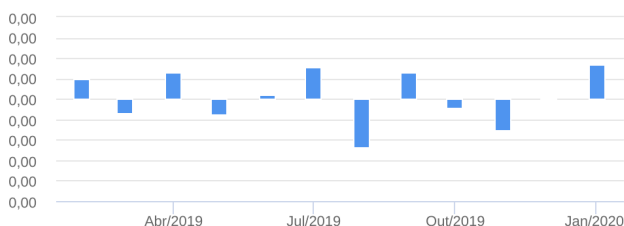
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	-30,92	-5,15	-1,34	-27,43	-47,79	-5,15	-22,08	33,24	-0,23	1,49	-0,20	-0,14	-0,15	-0,18	-0,16	-0,11	-0,15
% do CDI	-16,74	-1.367,26	-23,20	-218,36	-204,90	-1.367,26	-5.891,87	8.739,50	-48,70	322,10	-40,00	-23,89	-32,94	-32,66	-30,25	-22,54	-30,06
CDI	184,67	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	240,56	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	335,18	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	85,41	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	0,690812	113.799,30	117.638,79	40,38%	-26,11%	19,17%	-46,77	40,38%	33,24%	-22,08%	2
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

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

jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

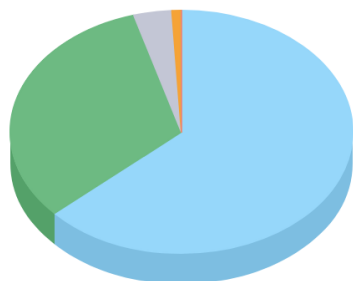
:: PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Valores a receber	178,07%	168,91%	131,62%	184,08%	183,65%	202,65%	202,25%	201,97%
Outras Aplicações	10,13%	13,90%	30,07%	10,31%	10,53%	7,76%	7,95%	8,04%
Títulos de Crédito Privado	2,48%	2,82%	2,56%	3,92%	3,89%	-	-	-
Disponibilidades	0,00%	0,01%	0,00%	0,01%	0,00%	0,01%	0,01%	0,01%
Valores a pagar	-90,69%	-85,64%	-64,26%	-98,33%	-98,08%	-110,43%	-110,21%	-110,03%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	113.799,30	119.977,36	153.968,44	115.554,17	115.824,51	114.119,81	114.349,37	114.504,65
Data da Divulgação	11/02/2020	07/01/2020	09/12/2019	02/12/2019	02/12/2019	03/09/2019	09/08/2019	02/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



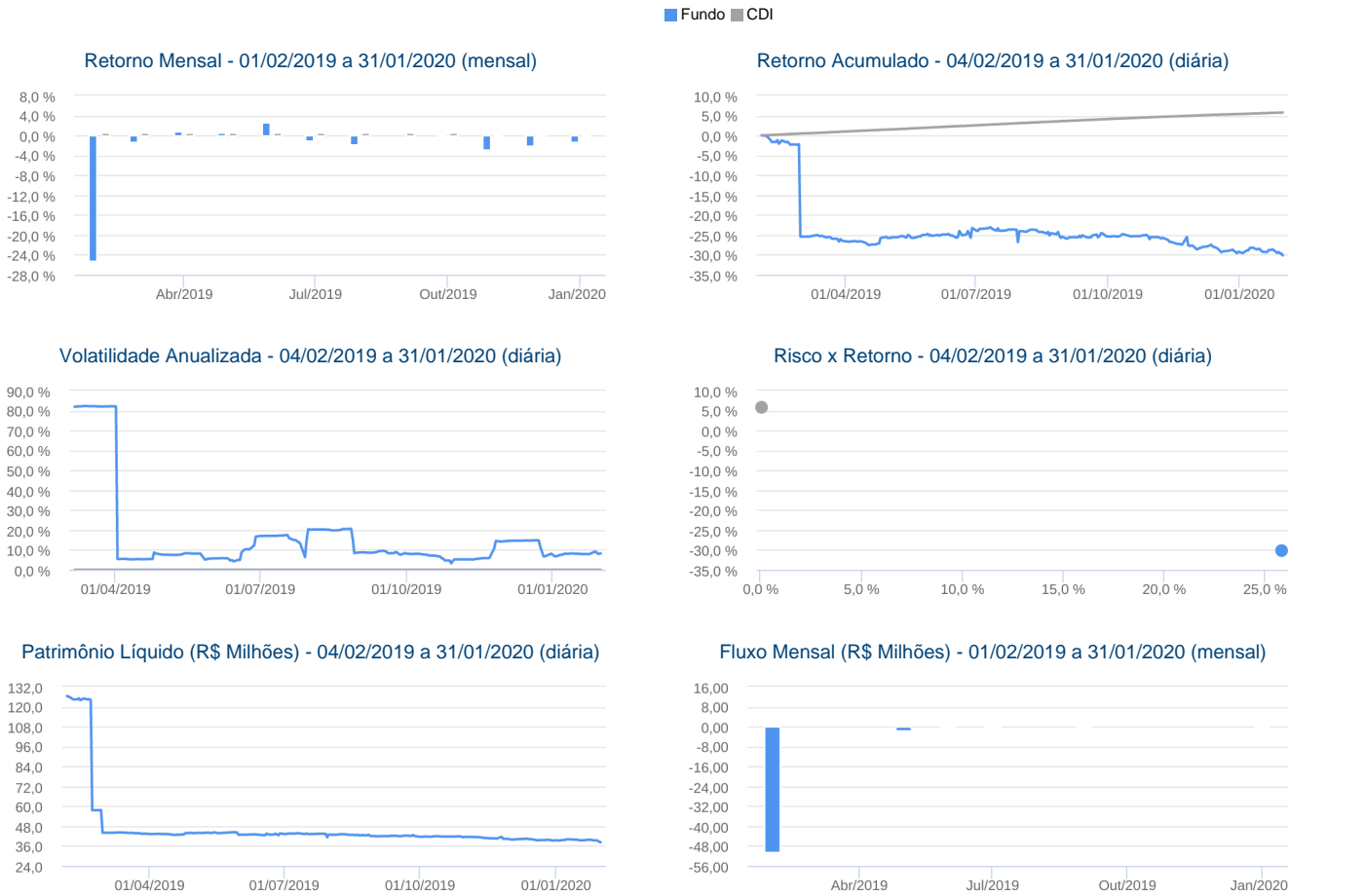
Outros Valores a receber	93,39 %
Outros Valores a pagar	47,56 %
LFT	5,31 %
CCB - REFREX EVAPORADORES DO BRASIL S.A. (05.883.919/0001-94)	1,30 %
- V...	
Outras Disponibilidades	0,00 %

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 23.896.287/0001-85	Aplicação Mínima: R\$ 0,00
Gestão: Brasil Plural	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: Planner Corretora	Saldo Mínimo: R\$ 300.000,00
Taxa de Administração: 1,70%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	Conversão da Cota para Resgate: D+30 ou D+1440 (isento de taxa de resgate)
Código de Referência: 428434	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+31 ou D+1441 (isento de taxa de resgate)
Início do Fundo: 26/10/2016	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	-6,11	-1,30	-30,16	-21,76	-10,76	-1,30	-2,13	-2,91	-0,16	0,06	-1,79	-1,08	2,66	0,67	0,92	-1,36	-25,07
% do CDI	-22,36	-344,31	-523,74	-173,21	-46,12	-344,31	-569,66	-764,37	-33,10	12,67	-355,86	-189,96	567,79	122,55	178,39	-289,76	-5.079,23
CDI	27,32	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	78,24	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	82,44	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	15,98	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	0,93890554	38.243,48	46.710,50	25,88%	-30,16%	12,29%	-15,07	25,88%	2,66%	-2,91%	3
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos



Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

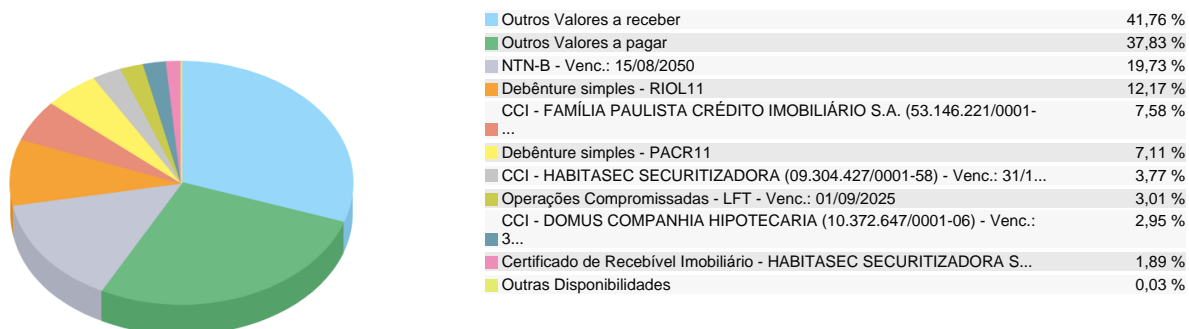
:: PYXIS INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Valores a receber	67,17%	65,44%	61,35%	58,76%	55,76%	52,38%	50,16%	47,10%
Títulos Públicos	31,74%	30,97%	29,27%	29,93%	28,38%	27,50%	27,30%	26,32%
Debêntures	31,01%	30,55%	30,01%	29,54%	29,55%	29,01%	28,64%	28,07%
Títulos de Crédito Privado	23,02%	23,75%	25,16%	25,31%	26,59%	28,12%	28,52%	29,26%
Operações Compromissadas	4,84%	5,06%	5,22%	5,15%	5,34%	5,00%	4,97%	5,57%
Outros valores mobiliários ofertados privadamente	3,04%	3,35%	3,66%	3,92%	-	-	-	-
Disponibilidades	0,04%	0,22%	0,08%	0,05%	0,06%	0,03%	0,05%	0,07%
Valores a pagar	-60,86%	-59,34%	-55,37%	-52,67%	-49,97%	-46,64%	-44,50%	-41,53%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	38.243,48	39.438,81	40.299,00	41.505,79	41.571,74	42.053,27	42.817,72	43.562,45
Data da Divulgação	10/02/2020	12/02/2020	09/12/2019	27/11/2019	04/10/2019	06/09/2019	05/08/2019	03/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



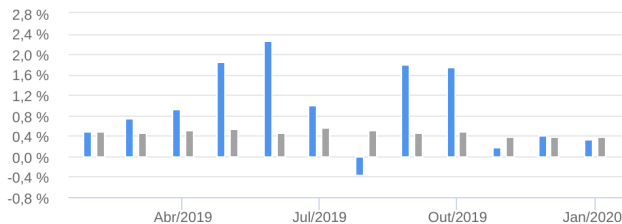
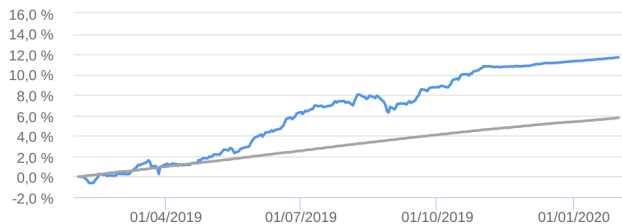
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 26.507.132/0001-06	Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00
Gestão: Santander Brasil Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00
Administrador: Banco Santander	Saldo Mínimo: R\$ 10.000,00
Taxa de Administração: 0,40%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 440264	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du
Início do Fundo: 09/05/2017	

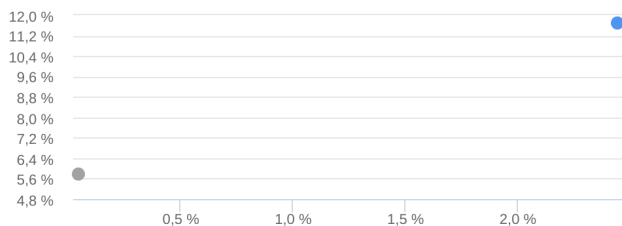
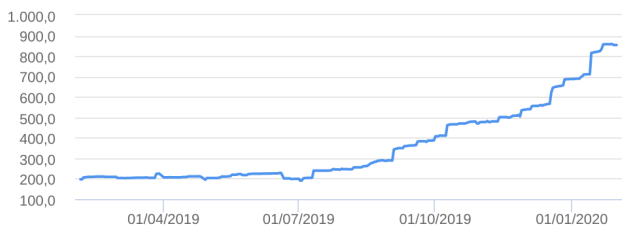
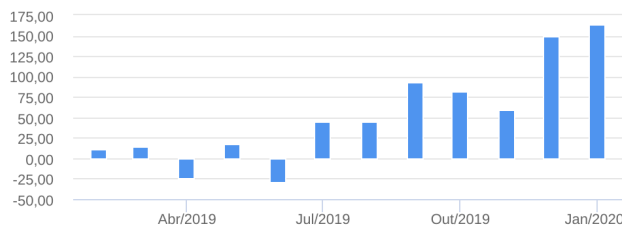
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	25,22	0,34	11,67	17,82	-	0,34	0,40	0,19	1,75	1,79	-0,37	0,99	2,25	1,85	0,92	0,74	0,49
% do CDI	129,15	90,75	202,70	141,88	-	90,75	107,64	48,88	364,64	385,21	-74,56	174,41	480,92	340,64	178,15	157,55	99,68
CDI	19,52	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	71,64	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	74,86	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	16,09	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	12,5215136	853.720,75	357.620,79	2,45%	-1,64%	1,16%	2,68	2,44%	2,25%	-0,37%	8
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

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

jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

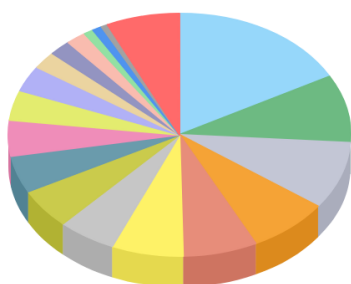
:: SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	100,03%	100,03%	100,06%	100,03%	100,03%	100,03%	100,84%	100,03%
Valores a receber	0,00%	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	-0,03%	-0,03%	-0,06%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,85%	-0,04%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	853.720,75	687.082,65	536.156,16	476.037,70	386.771,79	289.288,61	245.932,47	199.131,77
Data da Divulgação	07/02/2020	08/01/2020	06/12/2019	08/11/2019	05/10/2019	07/09/2019	07/08/2019	05/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



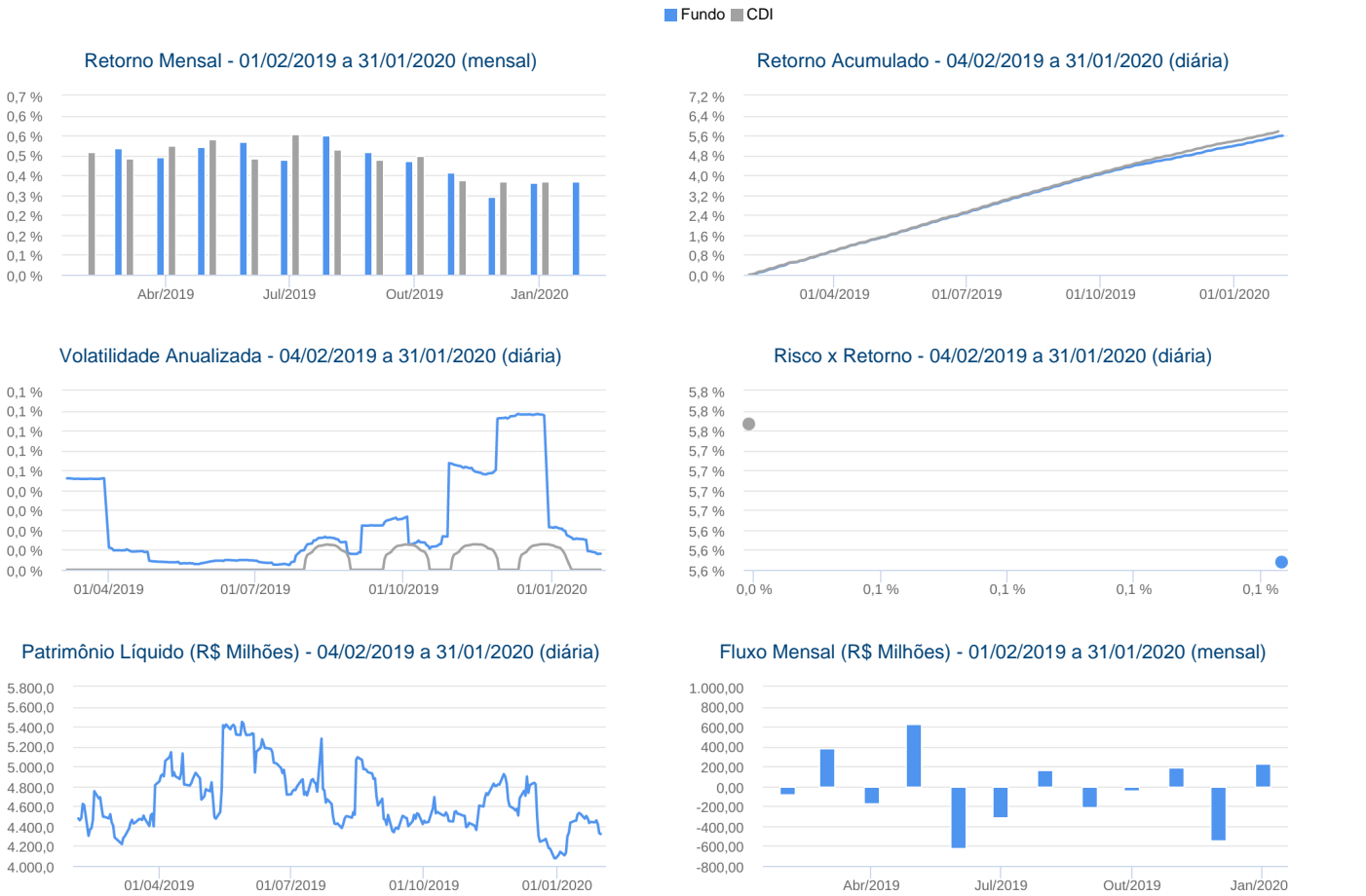
LFT - Venc.: 01/09/2022	17,02 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2040	9,05 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2025	8,97 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2030	7,65 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2028	7,00 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2020	6,75 %
LFT - Venc.: 01/09/2021	5,50 %
LFT - Venc.: 01/09/2024	5,32 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	4,95 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2020	4,77 %
LFT - Venc.: 01/03/2023	4,00 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	3,46 %
LFT - Venc.: 01/03/2021	2,31 %
LFT - Venc.: 01/03/2020	2,07 %
LFT - Venc.: 01/03/2025	1,90 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2021	0,91 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024	0,90 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	0,62 %
Lançamentos positivos menores que 0,62%	6,90 %

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 02.224.354/0001-45	Aplicação Mínima: R\$ 500.000,00
Gestão: Santander Brasil Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 100,00
Administrador: Banco Santander	Saldo Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,20%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 50563	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 27/11/1997	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	1.692,48	0,37	5,59	12,32	23,28	0,37	0,37	0,31	0,41	0,46	0,49	0,56	0,46	0,54	0,51	0,47	0,51
% do CDI	97,86	99,39	96,99	98,05	99,79	99,39	98,29	82,71	86,08	99,16	98,56	98,44	98,71	98,70	98,92	100,53	102,83
CDI	1.731,65	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	1.090,71	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	2.423,10	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	424,44	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	183,7385082	4.320.739,66	4.669.488,74	0,07%	0,00%	0,03%	1,10	0,04%	0,56%	0,31%	1
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos



Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
 Fonte: Quantum Axis.

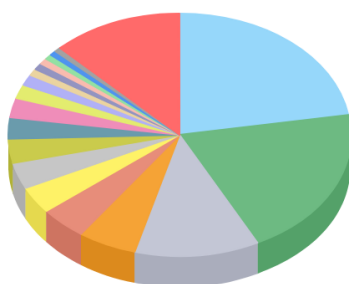
:: SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	100,02%	100,02%	100,12%	100,02%	100,02%	100,02%	100,02%	100,02%
Valores a receber	0,00%	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	-0,02%	-0,02%	-0,12%	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,02%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	4.320.739,66	4.076.826,63	4.601.854,40	4.397.786,27	4.419.941,55	4.607.155,34	4.425.062,22	4.715.980,75
Data da Divulgação	07/02/2020	08/01/2020	06/12/2019	08/11/2019	05/10/2019	07/09/2019	07/08/2019	05/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



LFT - Venc.: 01/09/2023	22,38 %
LFT - Venc.: 01/09/2022	20,12 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2020	11,75 %
Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.111/0001-03) - V...	5,54 %
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc.:...	4,43 %
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Ven...	3,61 %
CDB/ RDB - BANCO VOLKSWAGEN (59.109.165/0001-49) - Venc.: 13/02 /2...	3,48 %
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc.: ...	3,19 %
Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (90.400.888/0001...	2,85 %
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888/0001-4...	2,59 %
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc...	1,87 %
Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Ven...	1,44 %
Debênture simples - GGBRA5	0,90 %
Debênture simples - PETR35	0,89 %
Debênture simples - VIVT15	0,80 %
Letra Financeira - BANCO RCI BRASIL S.A. (62.307.848/0001-15) - V...	0,66 %
Debênture simples - GUAR11	0,65 %
Direitos Creditórios - Multiclasse	0,62 %
Lançamentos positivos menores que 0,62%	12,29 %

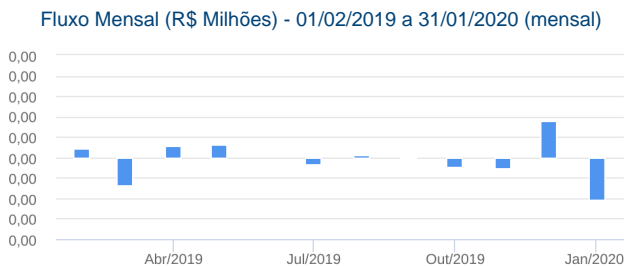
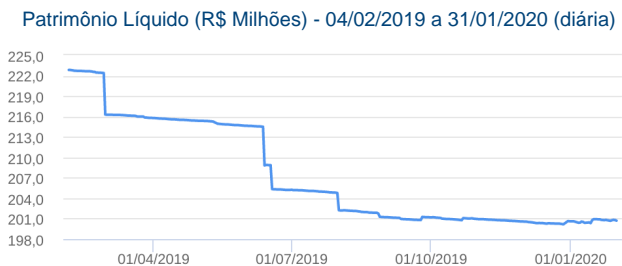
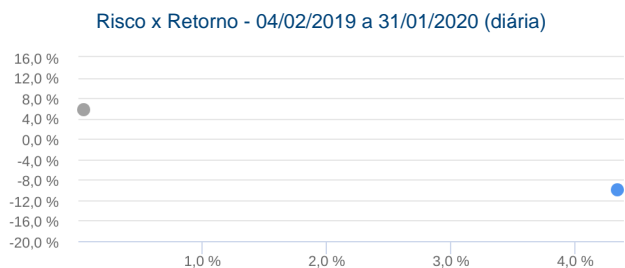
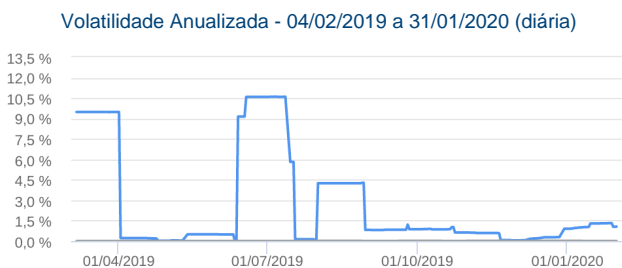
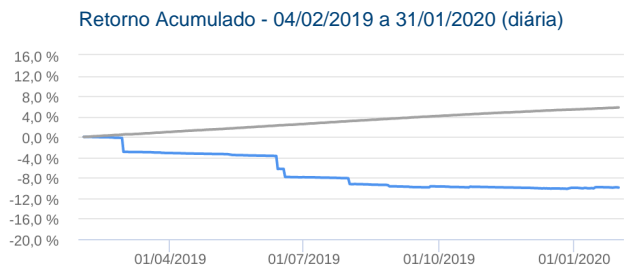
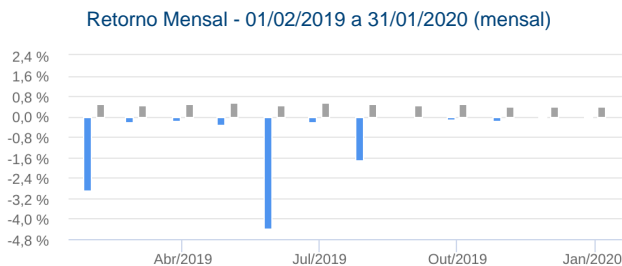
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 14.655.180/0001-54	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: Queluz Gestão de Recursos	Aplicação Adicional: Não informado
Administrador: RJI Corretora de Valores	Saldo Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração: 1,50%	Resgate Mínimo: Não informado
Taxa de Administração (Máxima): 3,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Multimercados Macro	Conversão da Cota para Resgate: D+90 ou D+1440 (isento de taxa de resgate)
Código de Referência: 386261	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+91 ou D+1441 (isento de taxa de resgate)
Início do Fundo: 03/08/2012	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	-	0,04	-9,92	-	-	0,04	0,02	-0,18	-0,12	-0,02	-1,73	-0,21	-4,40	-0,34	-0,20	-0,22	-2,90
% do CDI	-	11,50	-172,34	-	-	11,50	5,00	-48,27	-25,50	-3,25	-344,26	-37,62	-937,91	-62,58	-38,01	-47,38	-587,54
CDI	97,83	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	98,69	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	132,31	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	53,90	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	1.309,50592046	200.701,08	207.182,11	4,35%	-10,17%	2,06%	-7,30	4,35%	0,04%	-4,40%	0
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI


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

jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

:: SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO

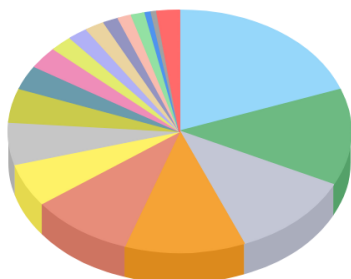
31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	40,77%	40,88%	40,95%	40,93%	40,98%	40,86%	41,76%	41,72%
Títulos de Crédito Privado	19,13%	19,13%	19,14%	26,01%	-	-	-	-
Debêntures	17,00%	17,14%	17,15%	17,13%	21,73%	17,16%	16,87%	16,84%
Valores a receber	11,45%	11,17%	11,17%	11,15%	11,13%	11,13%	10,94%	10,92%
Títulos ligados ao agronegócio	4,47%	4,51%	4,55%	4,58%	-	-	-	-
Outros valores mobiliários ofertados privadamente	1,83%	1,83%	1,83%	-	-	-	-	-
Títulos Públicos	1,54%	1,54%	1,53%	1,52%	1,51%	2,03%	1,94%	1,89%
Operações Compromissadas	0,56%	0,54%	0,41%	0,52%	0,46%	-	-	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-1,85%	-1,84%	-1,84%	-1,85%	-1,81%	-1,70%	-1,68%	-1,67%
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%	0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	200.701,08	200.614,22	200.576,65	200.945,60	201.191,48	201.221,86	204.758,42	205.196,73
Data da Divulgação	06/02/2020	08/01/2020	10/12/2019	12/11/2019	09/10/2019	10/09/2019	05/08/2019	03/07/2019

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



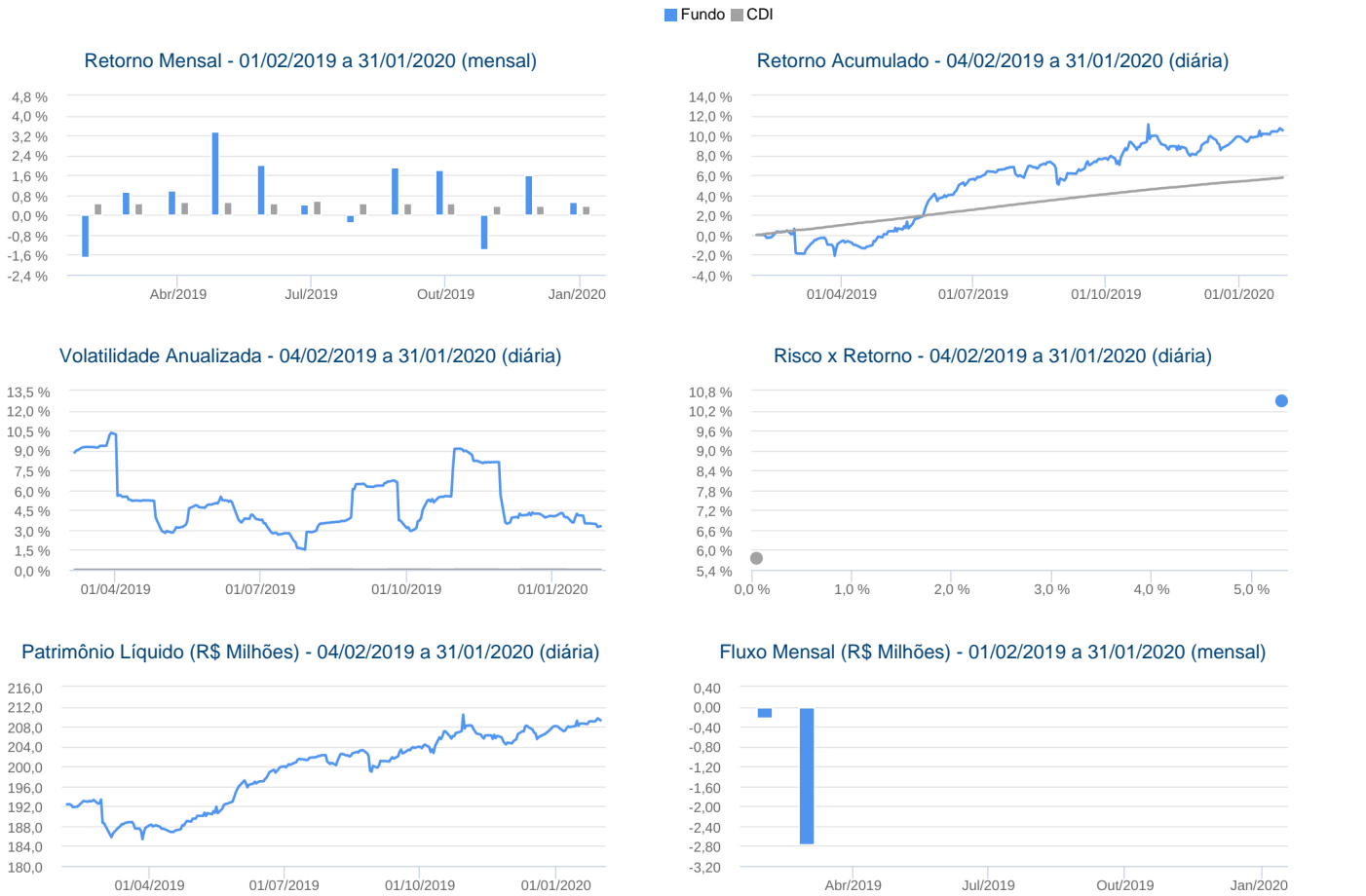
CCI - DOMUS COMPANHIA HIPOTECARIA (10.372.647/0001-06) - Venc.:	19,77 %
3...	
Cotas de CAM THRONE IMOBILIÁRIO MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira...	13,10 %
Outros Valores a receber	11,83 %
Cotas de CAM AGRO EFICIÊNCIA AMBIENTAL MULTIESTRATÉGIA FIP (sem c...	11,55 %
Debênture simples - ANOB11	9,84 %
Debênture simples - CSPE11	5,86 %
Cotas de CAM VANGUARDA IMOBILIÁRIO MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carte...	5,74 %
Certificado de Recebível do Agronegócio - REDENÇÃO FRIGORIFICO DO...	4,62 %
Cotas de WINAX MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira nesta data)	3,27 %
Cotas de SÃO DOMINGOS FII - FISD11 (sem carteira nesta data)	2,98 %
Cotas de CAM VERA CRUZ IMOBILIÁRIO FIP (sem carteira nesta data)	2,16 %
Outros Valores a pagar	1,92 %
Certificado de Recebível Imobiliário - BSI CAPITAL SECURITIZADORA...	1,89 %
Cotas de AQ3 RENDA FII - ARF11B (sem carteira nesta data)	1,46 %
Debênture simples - RIOL11	1,34 %
LFT - Venc.: 01/09/2025	1,32 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2026	0,58 %
Cotas de GESTÃO EMPRESARIAL MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira nes...	0,53 %
Lançamentos positivos menores que 0,53%	2,15 %

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 13.594.673/0001-69	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: Veritas Capital Management	Aplicação Adicional: R\$ 100.000,00
Administrador: RJI Corretora de Valores	Saldo Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração: 0,80%	Resgate Mínimo: R\$ 100.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 2,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	Conversão da Cota para Resgate: D+30 ou D+1460 du (isento de taxa de resgate)
Código de Referência: 291307	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+31 ou D+1461 du (isento de taxa de resgate)
Início do Fundo: 23/11/2011	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	59,88	0,55	10,50	5,06	19,66	0,55	1,62	-1,36	1,79	1,92	-0,31	0,45	2,01	3,38	0,99	0,92	-1,66
% do CDI	54,03	145,32	182,36	40,30	84,30	145,32	433,02	-357,20	373,84	414,31	-61,77	78,47	428,96	621,56	190,87	196,25	-336,40
CDI	110,83	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	106,94	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	156,36	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	61,24	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	1,59878936	209.242,14	199.320,37	5,31%	-2,84%	2,52%	-0,24	5,31%	3,38%	-1,36%	8
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos



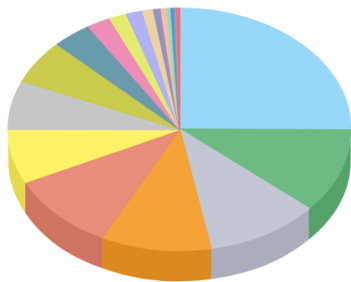
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

TMJ IMA-B FI RENDA FIXA

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	32,37%	32,80%	42,37%	43,04%	44,54%	44,76%	45,81%	46,22%
Títulos Públicos	25,80%	14,13%	13,88%	14,65%	14,49%	20,79%	20,36%	20,37%
Outros valores mobiliários ofertados privadamente	20,54%	19,90%	19,60%	-	-	-	-	-
Debêntures	10,88%	11,18%	11,60%	11,74%	12,77%	13,54%	13,72%	14,07%
Operações Compromissadas	7,11%	18,67%	9,18%	8,41%	6,39%	-	-	-
Valores a receber	6,01%	6,05%	6,15%	6,06%	6,17%	19,54%	19,48%	19,51%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-2,72%	-2,73%	-2,78%	-2,75%	-2,79%	-16,60%	-16,65%	-16,70%
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%	0,00%
Títulos de Crédito Privado	-	-	-	18,84%	-	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	209.242,14	208.103,17	204.780,55	207.601,30	203.947,23	200.102,52	200.724,54	199.834,13
Data da Divulgação	07/02/2020	10/01/2020	10/12/2019	12/11/2019	08/10/2019	10/09/2019	05/08/2019	02/07/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								jan/2020



NTN-B - Venc.: 15/05/2055	27,55 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	12,35 %
Outros Valores a receber	11,74 %
Valores a pagar - Longo Prazo (após 12 meses)	11,40 %
Certificado de Recebível Imobiliário - REIT SECURITIZADORA RECEBI...	11,38 %
Debênture simples - SGO11	7,91 %
Certificado de Recebível Imobiliário - HABITASEC SECURITIZADORA S...	7,16 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2020	6,43 %
Certificado de Recebível Imobiliário	4,06 %
Outros Valores a pagar	2,47 %
CDB	1,82 %
Debênture simples - VPRI21	1,69 %
Letras Financeiras	1,14 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	0,76 %
Debênture simples - LSHB14	0,61 %
LFT - Venc.: 01/09/2024	0,43 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2026	0,36 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	0,24 %
Lançamentos positivos menores que 0,24%	0,24 %

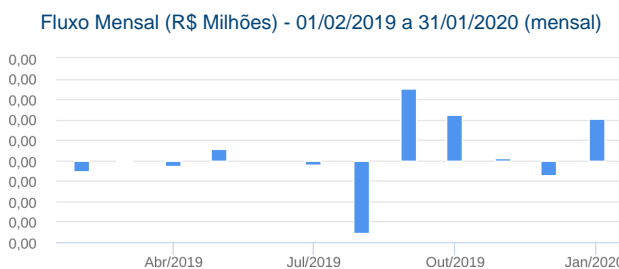
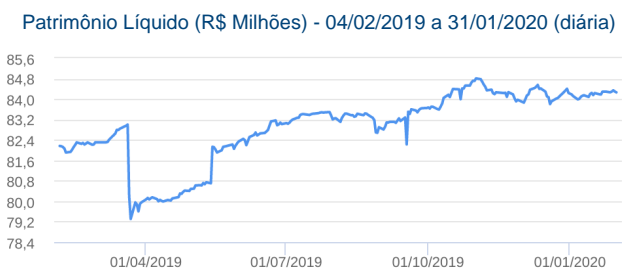
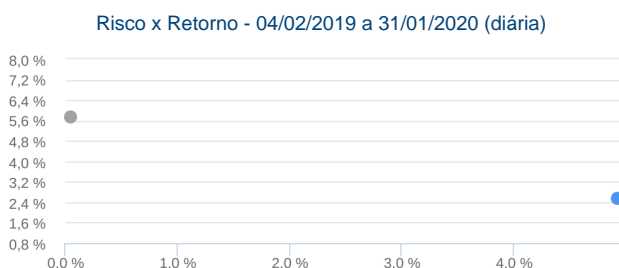
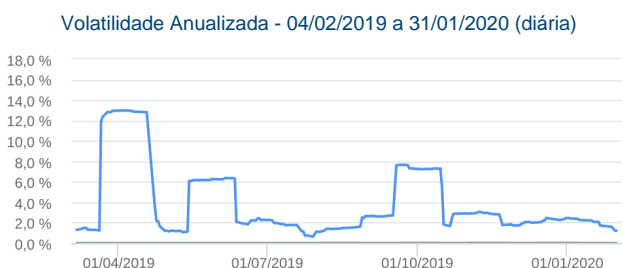
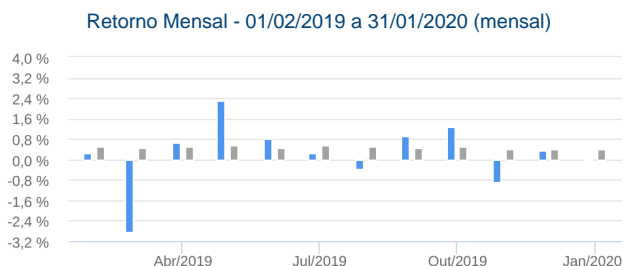
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 23.954.899/0001-87	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: RJI Corretora de Valores	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: RJI Corretora de Valores	Saldo Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração: 0,35%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,35%	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	Conversão da Cota para Resgate: D+1470
Código de Referência: 485578	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1471
Início do Fundo: 31/03/2016	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	4,61	0,03	2,53	-8,59	0,62	0,03	0,35	-0,91	1,27	0,91	-0,37	0,22	0,83	2,30	0,66	-2,85	0,22
% do CDI	12,34	7,44	43,88	-68,35	2,64	7,44	93,26	-238,05	265,10	195,50	-73,49	38,99	176,49	424,38	126,80	-607,37	45,27
CDI	37,37	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	127,27	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	132,67	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	20,09	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

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	1,3837928	84.258,70	82.933,05	4,93%	-4,45%	2,34%	-0,40	4,93%	2,30%	-2,85%	5
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI



Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

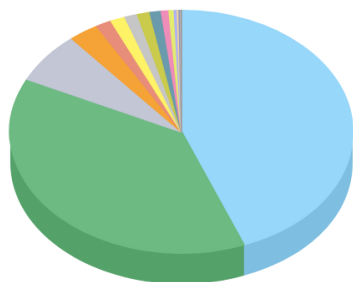
:: TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Valores a receber	163,81%	163,86%	164,43%	162,94%	165,01%	166,50%	165,89%	166,26%
Cotas de Fundos	68,77%	68,71%	68,60%	68,87%	68,48%	68,28%	68,39%	68,52%
Debêntures	8,05%	8,05%	8,08%	8,01%	8,11%	8,12%	8,05%	13,61%
Títulos Públicos	6,44%	6,42%	6,38%	6,47%	6,49%	6,46%	6,43%	6,38%
Operações Compromissadas	5,62%	5,69%	5,76%	5,59%	5,71%	5,83%	5,85%	0,17%
Disponibilidades	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,00%	0,01%	0,01%
Valores a pagar	-152,71%	-152,73%	-153,27%	-151,89%	-153,80%	-155,20%	-154,62%	-154,95%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	84.258,70	84.235,08	83.941,74	84.708,78	83.646,04	82.894,47	83.201,23	83.017,44
Data da Divulgação	04/02/2020	08/01/2020	09/12/2019	08/11/2019	10/10/2019	10/09/2019	08/08/2019	10/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



Outros Valores a receber	71,15 %
Outros Valores a pagar	61,49 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	11,02 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	4,55 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	2,43 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2022	2,23 %
CCI - COPEG - CRE (11.920.641/0001-80) - Venc.: 01/01/2027	1,95 %
Debênture simples - CMTR26	1,93 %
CCI - MTTG EMPREENDIMENTOS E PARTICIPAÇÕES LTDA. (09.613.866/0001...)	1,72 %
Debênture simples - LSHB14	1,17 %
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	0,79 %
LFT - Venc.: 01/03/2025	0,43 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2020	0,29 %
LFT - Venc.: 01/09/2024	0,26 %
LFT - Venc.: 01/03/2023	0,05 %
Operações Compromissadas	0,02 %
Outras Disponibilidades	0,01 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	0,00 %

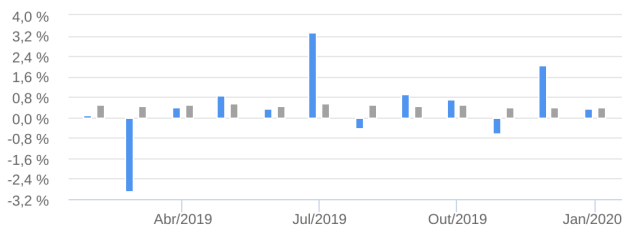
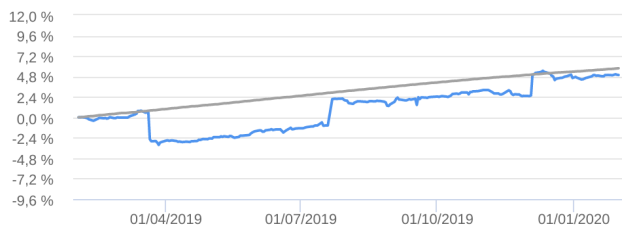
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 12.845.801/0001-37	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: Brasil Plural	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: RJI Corretora de Valores	Saldo Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração: 0,75%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	Conversão da Cota para Resgate: D+1470
Código de Referência: 292941	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1471
Início do Fundo: 30/11/2011	

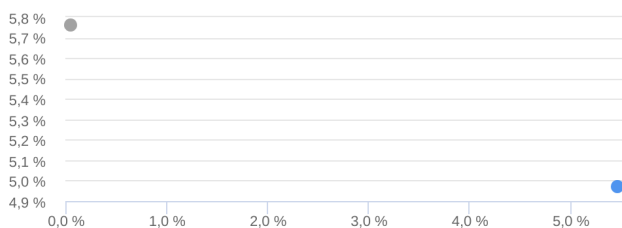
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	33,37	0,34	4,97	-15,04	-9,24	0,34	2,06	-0,64	0,73	0,90	-0,44	3,31	0,34	0,87	0,42	-2,87	0,08
% do CDI	30,24	89,32	86,29	-119,69	-39,62	89,32	549,56	-169,38	151,31	193,64	-88,09	583,77	72,21	159,65	81,94	-611,58	16,94
CDI	110,38	0,38	5,76	12,56	23,33	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49
Ibovespa	100,02	-1,63	16,25	34,66	72,78	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86
IBX	147,63	-1,25	18,41	38,02	77,81	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
IGP-M	61,04	0,48	7,78	15,14	14,76	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88

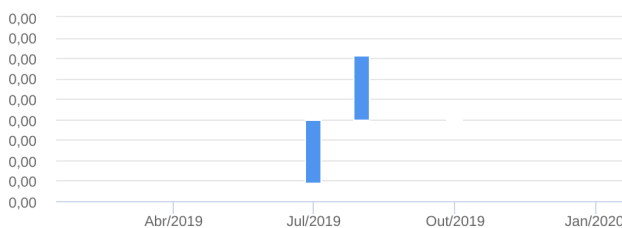
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,33374505	402.462,06	387.359,11	5,47%	-3,99%	2,60%	-0,42	5,47%	3,31%	-2,87%	5
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Risco x Retorno - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/02/2019 a 31/01/2020 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/02/2019 a 31/01/2020 (mensal)

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

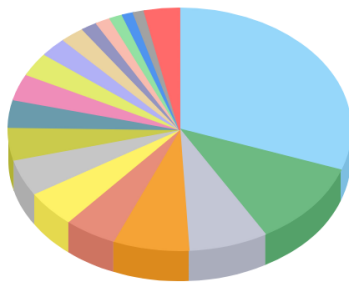
jan/2020

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, 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. Metodologia de cálculo de rentabilidade definido pelo usuário considerando o perfil de divulgação. Para fundos abertura "01 a 01"; fechamento "30 a 30". O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

:: TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA

31/01/2020

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Cotas de Fundos	67,64%	67,47%	66,59%	66,76%	67,23%	67,47%	67,54%	67,65%
Valores a receber	16,63%	16,68%	17,20%	17,09%	5,27%	5,30%	5,26%	5,44%
Debêntures	13,10%	13,15%	13,43%	13,34%	13,44%	13,49%	13,44%	15,03%
Outros valores mobiliários ofertados privadamente	4,93%	4,95%	5,05%	-	-	-	-	-
Operações Compromissadas	4,25%	4,31%	4,44%	4,45%	3,78%	3,37%	3,09%	1,15%
Títulos Públicos	0,21%	0,21%	0,21%	0,22%	12,16%	12,11%	12,04%	12,32%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-6,76%	-6,78%	-6,92%	-6,88%	-6,94%	-6,92%	-6,60%	-7,03%
Outras Aplicações	-	-	-	-	5,06%	5,17%	5,22%	5,44%
Títulos de Crédito Privado	-	-	-	5,02%	-	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	402.462,06	401.112,77	393.019,79	395.568,43	392.720,43	389.225,08	390.951,64	378.409,85
Data da Divulgação	04/02/2020	08/01/2020	09/12/2019	12/11/2019	10/10/2019	10/09/2019	08/08/2019	10/07/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								jan/2020



Outros Valores a receber	33,74 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	12,41 %
Outros Valores a pagar	8,26 %
Debênture simples - XMAS11	7,94 %
Debênture simples - EBIG11	5,47 %
Certificado de Recebível Imobiliário - ISEC SECURITIZADORA S.A. (...)	5,38 %
Debênture conversível - BITN11	5,37 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2022	4,81 %
Debênture simples - EBPH11	4,07 %
Valores a pagar - Longo Prazo (após 12 meses)	3,88 %
Debênture simples - LSHB14	3,49 %
CCI - COPEG - CRE (11.920.641/0001-80) - Venc.: 01/01/2027	2,84 %
CCI - MTTG EMPREENDIMENTOS E PARTICIPAÇÕES LTDA. (09.613.866 /0001...)	2,51 %
Cotas de AQ3 RENDA FII - ARF111B (sem carteira nesta data)	1,67 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	1,54 %
Certificado de Recebível Imobiliário	1,38 %
LFT - Venc.: 01/03/2025	1,17 %
Debênture simples - CMTR26	1,15 %
Lançamentos positivos menores que 1,15%	3,64 %

INSTITUIÇÕES

Gestão: A5 Capital Partners
 Diretor: Renato Marques Ramalho
 Gestor: Renato Marques Ramalho

Administrador: Planner Corretora
 Custodiante: Planner Corretora
 Auditor: EY

PERFIL DO FUNDO

Política de Investimento: Investe em ações, debêntures, bônus de subscrição e outros Títulos e Valores Mobiliários, de empresas de e-commerce, visando atender outras empresas ou o consumidor final ou qualquer demanda entre indivíduos ou ter como objeto atuação como holding.

Companhias Alvo: Setor de e-commerce.

Objetivo: Obter meta de rentabilidade de IPCA acrescido de 10,5% ao ano, por meio da aquisição de Valores Mobiliários.

Limite de Concentração por Companhia: 100%

CARACTERÍSTICAS

Tipo Investidor Anbima: Restrito
 Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
 Quantidade de Classes: 1.0
 Benchmark: IPCA + 10,5%
 Negociação em Mercado Secundário: CETIP / mercado de balcão não organizado

Data de Registro: 06/06/2012
 Situação Atual: Em funcionamento normal
 Classificação Anbima: Fundos de Participações
 Classificação Quantum: Participações
 Classificação Legal: FIP

DADOS PATRIMONIAIS

Patrimônio Autorizado Última Emissão: R\$ 250.000.000,00
 Patrimônio Inicial Mínimo: R\$ 5.000.000,00
 Patrimônio Inicial Máximo: R\$ 150.000.000,00
 Preço Inicial por Cota: R\$ 1,00

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

31/12/2019: R\$ 136.709.403,75
 30/09/2019: R\$ 137.398.820,76
 28/06/2019: R\$ 138.113.395,91
 29/03/2019: R\$ 138.788.272,03

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

Tipo de Cobrança: Flexível
 Taxa de Administração: 0,11%
 Taxa de Administração Financeira: R\$ 8.000,00

TAXA DE PERFORMANCE

Taxa de Performance: 20,00%
 Critério de Apuração: Excesso de retorno
 Índice de Referência: 100% do IPCA + 10,5% a.a.

PRAZOS DE INVESTIMENTOS

Prazo de Duração do Fundo: 8 anos
 Período de Investimento: 5 anos
 Período de Investimento Extensão: 1 ano
 Período de Desinvestimento: 3 anos
 Período de Desinvestimento Extensão: Não informado

CONTATO

Site: www.a5.com.br
 Email: contato@a5.com.br
 Telefone: (11) 2165-1005

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

AGOSTO/2019

Ativo	Valor Investido (R\$ mil)	Participação
Ação de Companhia Fechada - W7BZ HOLDING S.A. ON (16.596.059/0001-24)	140.207,55	
Outros Valores a pagar	-3.956,94	
Outros Valores a receber	1.375,00	
Outras Disponibilidades		0,16