

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	

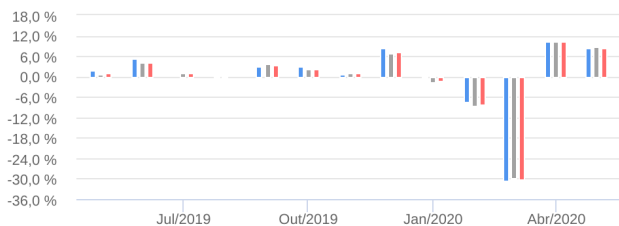
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	139,77	-23,61	-7,43	18,25	48,42	8,34	10,36	-30,69	-7,29	-0,58	8,34	0,76	3,07	3,06	-0,37	0,00	5,34
Excesso do Ibovespa	108,23	0,81	2,88	2,27	10,25	-0,23	0,11	-0,78	1,14	1,05	1,49	-0,19	0,71	-0,51	0,29	-0,84	1,29
CDI	145,98	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	31,55	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	77,31	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	82,30	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	2,3977354	926.402,79	1.007.015,21	42,70%	-46,77%	20,28%	0,99	4,98%	10,36%	-30,69%	7
Ibovespa	-	-	-	42,50%	-46,82%	20,18%	1,00	0,00%	10,25%	-29,90%	0

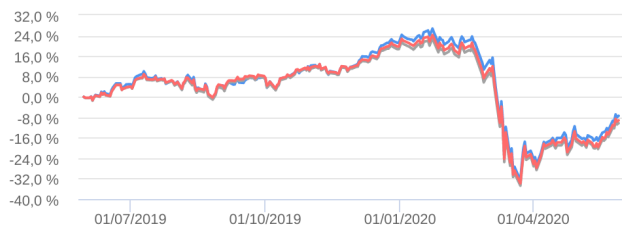
**Gráficos**

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

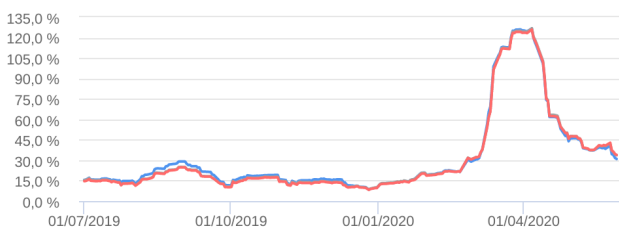
Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)



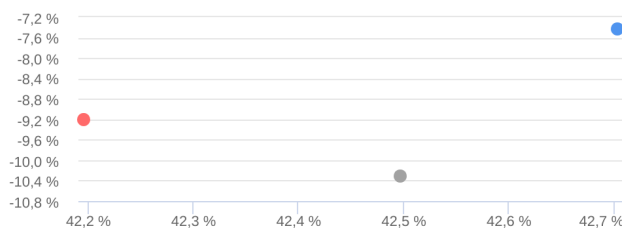
Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)



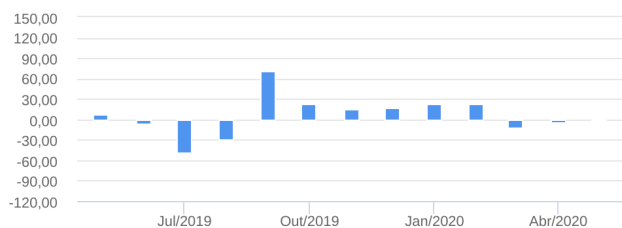
Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)



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

mai/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.

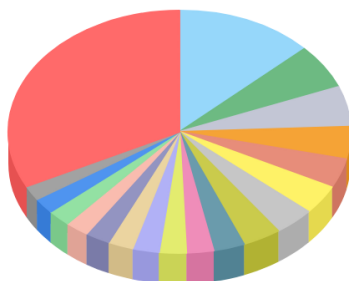
:: BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	100,27%	100,29%	100,33%	100,33%	100,27%	100,35%	100,23%	100,24%
Valores a receber	1,20%	0,02%	0,13%	0,05%	0,14%	0,43%	0,02%	0,08%
Operações Compromissadas	0,06%	0,06%	0,06%	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	-1,52%	-0,37%	-0,52%	-0,41%	-0,44%	-0,81%	-0,28%	-0,35%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	926.402,79	853.061,17	777.057,19	1.139.056,06	1.203.119,29	1.187.934,67	1.079.962,16	1.056.896,88
Data da Divulgação	04/06/2020	07/05/2020	06/04/2020	04/03/2020	05/02/2020	07/01/2020	04/12/2019	05/11/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

mai/2020



VALE ON N1 - VALE3	13,32 %
BRASIL ON NM - BBAS3	6,08 %
B3 ON NM - B3SA3	5,51 %
B2W DIGITAL ON NM - BTOW3	4,42 %
BRADESCO PN N1 - BBDC4	4,01 %
PETROBRAS PN - PETR4	3,97 %
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	3,89 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2023	3,73 %
ELETROBRAS ON N1 - ELET3	3,02 %
VIAVAREJO ON N2 - VVAR3	2,62 %
Outros Valores a receber	2,60 %
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	2,57 %
Outros Valores a pagar	2,43 %
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	2,39 %
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	2,29 %
GERDAU PN N1 - GGBR4	2,25 %
BRF SA ON NM - BRFS3	2,13 %
LOJAS AMERIC PN - LAME4	1,98 %
Lançamentos positivos menores que 1,98%	33,23 %

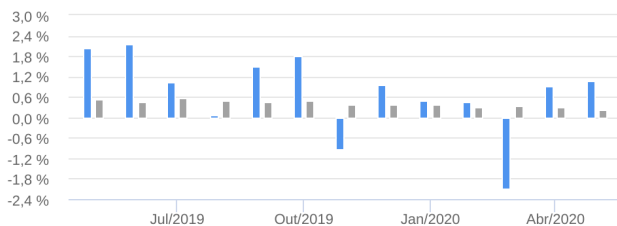
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 25.078.994/0001-90	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 300.000,00
Taxa de Administração: 0,30%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa 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	

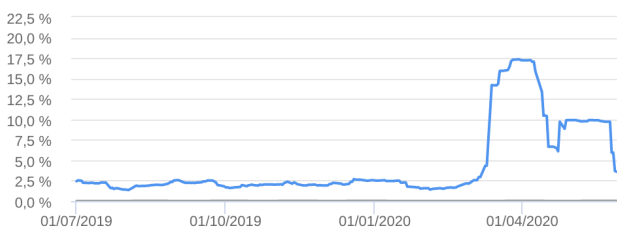
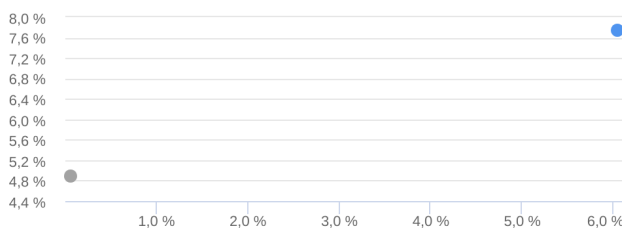
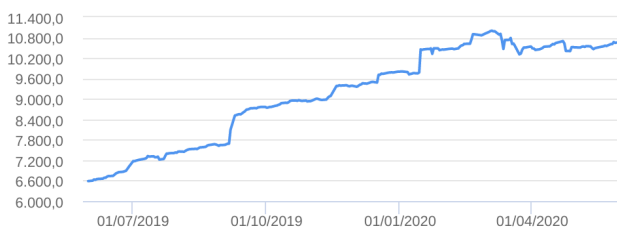
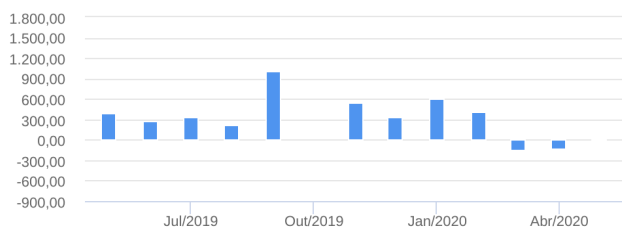
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	46,54	0,79	7,74	22,22	34,20	1,07	0,91	-2,10	0,46	0,49	0,96	-0,94	1,80	1,50	0,08	1,02	2,17
% do CDI	148,30	51,60	158,05	191,42	168,06	454,67	320,29	-620,99	155,24	129,00	255,89	-246,60	375,35	323,21	16,89	179,14	462,90
CDI	31,38	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	50,95	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	53,57	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	19,02	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	1,465396778	10.653.642,52	9.158.885,97	6,05%	-5,49%	2,87%	2,93	6,05%	2,17%	-2,10%	9
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/2020

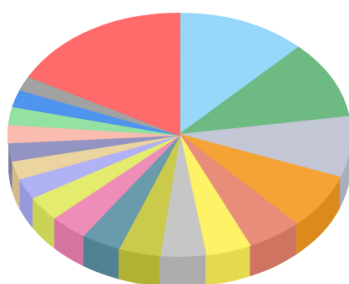
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	100,00%	99,95%	99,99%	99,93%	99,99%	100,00%	100,00%	100,00%
Valores a receber	0,00%	0,05%	0,01%	0,07%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	10.653.642,52	10.512.346,44	10.536.452,77	10.908.803,62	10.446.730,36	9.800.245,40	9.385.285,18	8.931.824,90
Data da Divulgação	03/06/2020	07/05/2020	08/04/2020	06/03/2020	05/02/2020	06/01/2020	05/12/2019	05/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								mai/2020



LTN - Venc.: 01/07/2020 (BRSTNCLTN7F8)	12,25 %
LTN - Venc.: 01/10/2020 (BRSTNCLTN004)	10,38 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2021	8,09 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2021 (BRSTNCNTF0N5)	7,38 %
LTN - Venc.: 01/04/2021 (BRSTNCLTN7P7)	5,18 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	4,29 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2023 (BRSTNCNTF147)	4,27 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022 (BRSTNCNTB3Y0)	3,93 %
LTN - Venc.: 01/07/2023 (BRSTNCLTN7Q5)	3,72 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	3,55 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	3,33 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	2,76 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	2,44 %
LTN - Venc.: 01/07/2021 (BRSTNCLTN7I2)	2,42 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB007)	2,41 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2027 (BRSTNCNTF1P8)	2,37 %
LTN - Venc.: 01/01/2022 (BRSTNCLTN7K8)	2,26 %
LTN - Venc.: 01/07/2022 (BRSTNCLTN7O0)	1,97 %
Lançamentos positivos menores que 1,97%	17,00 %

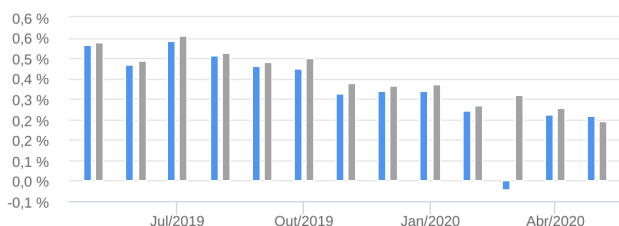
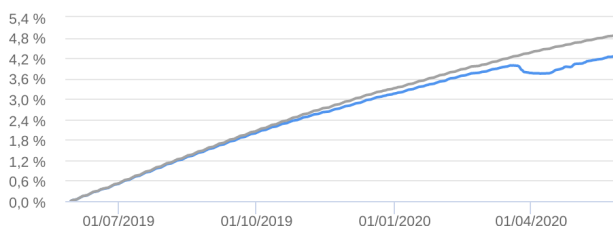
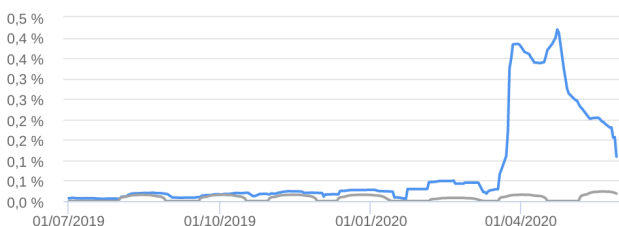
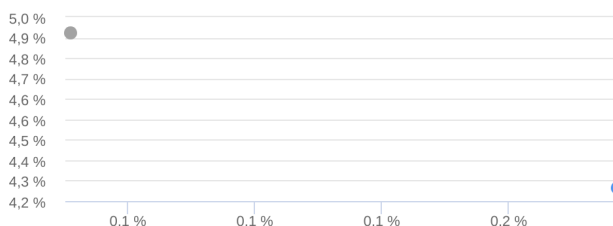
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 13.077.418/0001-49	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,30%	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: 272493	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 28/04/2011	

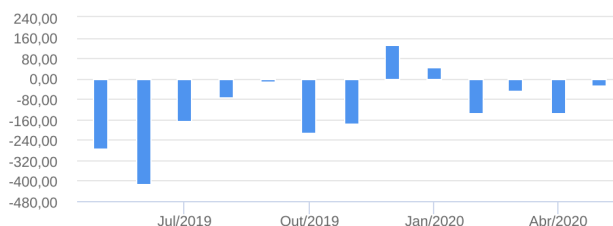
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	127,27	1,11	4,29	10,82	19,61	0,26	0,26	-0,03	0,27	0,35	0,35	0,34	0,44	0,45	0,49	0,55	0,46
% do CDI	99,83	72,02	87,66	93,21	96,36	108,46	90,62	-9,77	92,98	92,89	94,44	89,83	91,35	97,16	98,23	96,72	97,56
CDI	127,49	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	33,09	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	72,30	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	68,45	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	2.272744933	2.574.764,27	2.964.115,67	0,17%	-0,23%	0,08%	1,24	0,15%	0,55%	-0,03%	1
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/2020

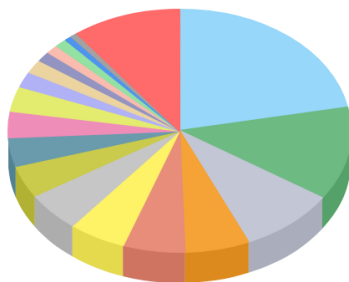
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%
Valores a pagar	0,00%	-0,00%	0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.574.764,27	2.594.654,17	2.725.355,81	2.774.667,82	2.903.514,20	2.851.366,97	2.711.296,28	2.878.753,76
Data da Divulgação	02/06/2020	05/05/2020	03/04/2020	04/03/2020	04/02/2020	03/01/2020	04/12/2019	04/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								mai/2020



Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	21,91 %
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Ven...	12,41 %
LFT - Venc.: 01/03/2022 (BRSTNCLF1R66)	9,10 %
LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	6,09 %
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	5,83 %
LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	5,41 %
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc...	5,26 %
LFT - Venc.: 01/03/2021 (BRSTNCLF1R41)	4,29 %
LFT - Venc.: 01/09/2021 (BRSTNCLF1R58)	3,81 %
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888/0001-4...	3,51 %
Letra Financeira - BANCO DO BRASIL S.A. (00.000.000/0001-91) - Ve...	3,33 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	2,08 %
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	1,80 %
Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (90.400.888/0001...	1,33 %
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	1,16 %
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc....	1,15 %
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	0,68 %
Debênture simples - GGBRA5	0,65 %
Lançamentos positivos menores que 0,65%	10,21 %

**CARACTERÍSTICAS**

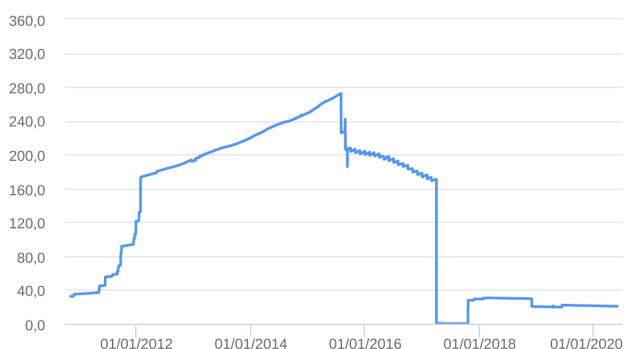
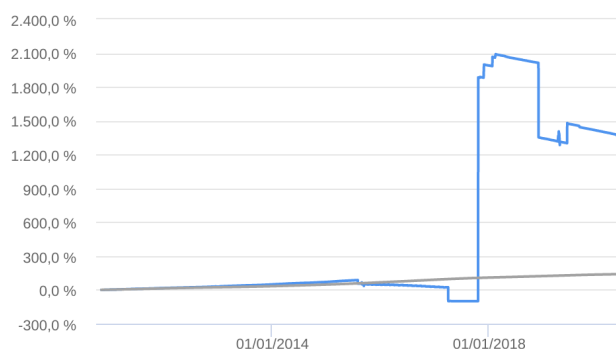
Gestão: Plural  
 Administrador: Santander Securities Services  
 Custodiante: Banco Santander  
 Auditor: Grant Thornton  
 Taxa de Administração: 0,23%  
 Taxa de administração máxima: Não possui  
 Taxa de Performance: Não possui  
 Índice de Performance: Não possui

**PERFIL DO FUNDO**

Classificação Quantum: Direito Creditório  
 Classificação Anbima: FIDC Outros  
 Público Alvo: Investidores qualificados  
 Objetivo: Proporcionar rendimento de longo prazo por meio de investimento dos recursos do fundo preponderantemente na aquisição de Direitos Creditórios, conforme política de investimento.  
 Política de investimento: Aplica em direitos creditórios oriundos dos segmentos industrial, comercial, agropecuário, financeiro, imobiliário e de prestação de serviços.

**RETORNO (%)**

	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	1.369,13	-2,82	4,66	-31,93	1.245,919,23	-0,63	-0,66	-0,51	-0,53	-0,52	-0,57	-0,50	-0,50	-1,19	-0,52	-0,49	11,87
% do CDI	983,76	-183,14	95,15	-275,106	1.21.856,78	-268,56	-230,05	-151,30	-179,86	-138,43	-153,35	-130,25	-103,61	-256,52	-104,05	-86,60	2.532,90
CDI	139,17	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Dólar	222,63	34,62	36,61	46,29	66,30	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75
Euro	152,19	33,07	36,23	39,73	65,33	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80
Ibovespa	19,74	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IGP-M	76,62	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

**GRÁFICOS**
**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/11/2010 a 29/05/2020 (diária)**

**Retorno Acumulado - 05/11/2010 a 29/05/2020 (diária)**


■ Fundo

■ Fundo

■ CDI

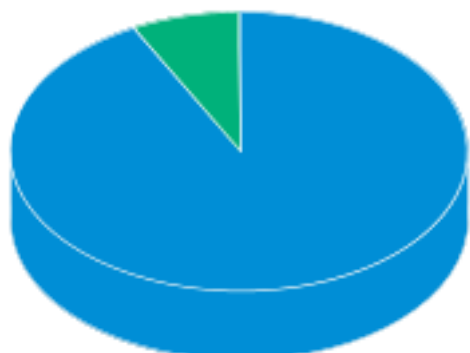
**HISTÓRICO**

PL Médio 12 meses: R\$ 21.224.715,28  
 Início do Fundo: 04/11/2010  
 Máximo Retorno Mensal: 19.881.193.499.900,00% (out/2017)  
 Mínimo Retorno Mensal: -100,00% (set/2017)  
 Nº de Meses com Retorno Positivo: 62  
 Nº de Meses com Retorno Negativo: 52  
 Retorno Acumulado Desde o Início: 1.369,13%  
 Volatilidade Desde o Início: 6.425.181.293.096,84%

**INFORMAÇÕES OPERACIONAIS**

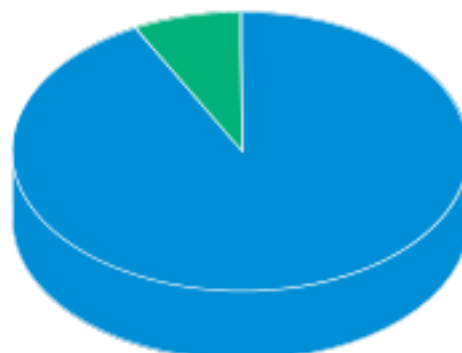
Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00  
 Movimentação mínima: Não informado  
 Saldo mínimo: Não informado  
 Contato: asset@brasilplural.com  
 Disponibilidade dos recursos aplicados: D+0  
 Conversão de cota para aplicação: D+588  
 Conversão de cota para resgate: D+0  
 Disponibilidade dos recursos resgatados: D+588

Tipo do Ativo



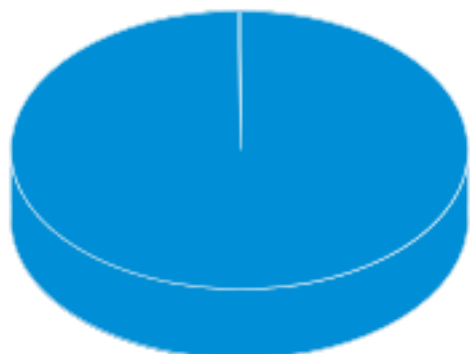
■ Direito Creditório 92,40 %  
■ Valores a pagar/receber 7,60 %

Setor do Ativo



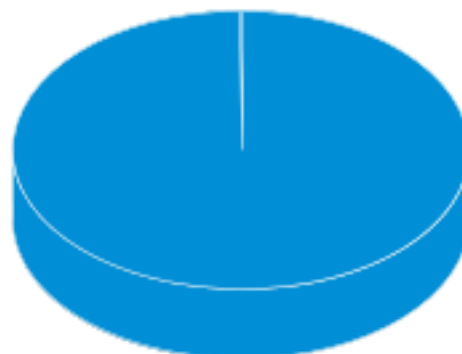
■ Outros 92,40 %  
■ Não Classificado 7,60 %

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	269.867,00000	92,9272 %
Outros Ativos - Longo Prazo (após 12 meses)	21.341,00000	7,3487 %
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	23,00000	0,0079 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-824,00000	-0,2837 %



**INFORMAÇÕES GERAIS**

Ticker: BRHT11B  
 Local de Negociação: Balcão B3  
 Data de Registro: 18/12/2012  
 Público Alvo: Exclusivo  
 Situação Atual: Em funcionamento normal

**TAXAS**

Taxa de Administração Tipo: Flexível  
 Taxa de Administração: 1,35%  
 Taxa de Administração Financeira: R\$ 21.500,00  
 Taxa de Performance: 20,00%  
 Índice Performance: 100% do IPCA + 6% a.a.

**INSTITUIÇÕES**

Administrador: Elite Corretora  
 Gestão: Graphen Investimentos  
 Gestor: Paulo Eduardo Pigosse  
 Consultoria Especializada: Dexter Engenharia  
 Distribuidor: Gradual Investimentos  
 Auditor: PriceWaterhouseCoopers

**INVESTIMENTO**

Classe de Ativos: Imóvel  
 Finalidade: Renda Regular de Aluguel  
 Rentabilidade Alvo: IGP-M 100%  
 Tipo Imóvel: Hospedagem  
 Localização do Imóvel: Belo Horizonte/MG + Porto Seguro/BA + Taubaté/SP

**PERFIL DO FUNDO**

**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.

**COTAÇÕES NA BMF&BOVESPA**

Preço de Fechamento: -  
 Volume Financeiro: -  
 Número de Negócios: -

**DADOS PATRIMONIAIS - JULHO/2020**

Cota Patrimonial: R\$ 85,25  
 Patrimônio Líquido: R\$ 157.011.882,34  
 Quantidade de Cotas: 1.841.677

Retorno (%)	2020				2019				2018			
	BRHT11B	Excesso do CDI	CDI	IFIX	BRHT11B	Excesso do CDI	CDI	IFIX	BRHT11B	Excesso do CDI	CDI	IFIX
Janeiro	0,00	-0,38	0,38	-3,76	0,00	-0,54	0,54	2,47	0,00	-0,58	0,58	2,64
Fevereiro	0,00	-0,29	0,29	-3,69	0,00	-0,49	0,49	1,03	0,00	-0,46	0,46	1,15
Março	0,00	-0,34	0,34	-15,85	0,00	-0,47	0,47	1,99	0,00	-0,53	0,53	2,00
Abril	0,00	-0,28	0,28	4,39	0,00	-0,52	0,52	1,03	0,00	-0,52	0,52	-0,86
Mai	0,00	-0,24	0,24	2,08	0,00	-0,54	0,54	1,76	0,00	-0,52	0,52	-5,27
Junho	0,00	-0,21	0,21	5,59	0,00	-0,47	0,47	2,88	0,00	-0,52	0,52	-4,01
Julho	0,00	-0,19	0,19	-2,61	0,00	-0,57	0,57	1,27	0,00	-0,54	0,54	1,37
Agosto	0,00	-0,16	0,16	1,79	0,00	-0,50	0,50	-0,11	0,00	-0,57	0,57	-0,70
Setembro	-	-	-	-	0,00	-0,46	0,46	1,04	0,00	-0,47	0,47	-0,21
Outubro	-	-	-	-	0,00	-0,48	0,48	4,01	0,00	-0,54	0,54	5,04
Novembro	-	-	-	-	0,00	-0,38	0,38	3,52	0,00	-0,49	0,49	2,59
Dezembro	-	-	-	-	0,00	-0,37	0,37	10,63	0,00	-0,49	0,49	2,22

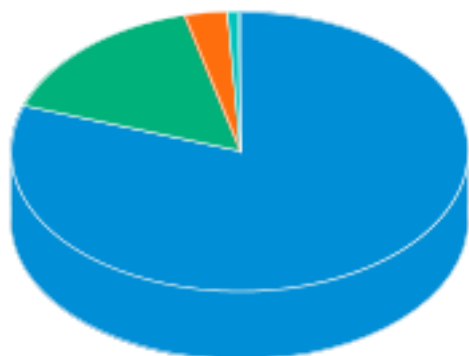
Retorno Acumulado (%)	BRHT11B	Excesso do CDI	CDI	IFIX	EVOLUÇÃO - DESDE O INÍCIO			
Desde o início	0,00	-87,26	87,26	87,77				
No mês	0,00	-0,24	0,24	2,08				
No ano	0,00	-1,54	1,54	-16,88				
03 meses	0,00	-0,88	0,88	-10,59				
06 meses	0,00	-1,98	1,98	-7,61				
12 meses	0,00	-4,90	4,90	4,48				
18 meses	0,00	-8,20	8,20	16,19				
24 meses	0,00	-11,61	11,61	21,65				
36 meses	0,00	-20,35	20,35	30,18				

**:: BR HOTÉIS FII - BRHT11B**

CNPJ: 15.461.076/0001-91 | 29/05/2020

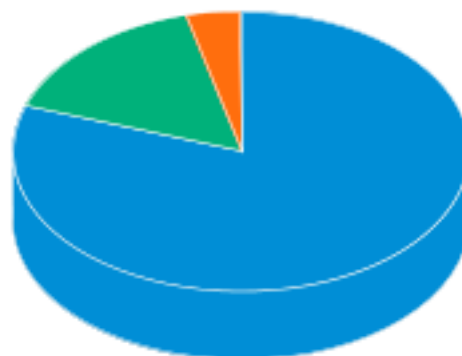
Últimos Proventos	Valor	Data Ex-1	Data Deliberação	Data Crédito	Ano do Exercício
Subscrição	29,89% a R\$ 90,817199	10/05/2018	20/04/2018	-	-
Dividendo	R\$ 0,85548397	30/06/2014	30/06/2014	14/07/2014	2014
Dividendo	R\$ 0,2280048	30/05/2014	30/05/2014	13/06/2014	2014
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

Tipo do Ativo



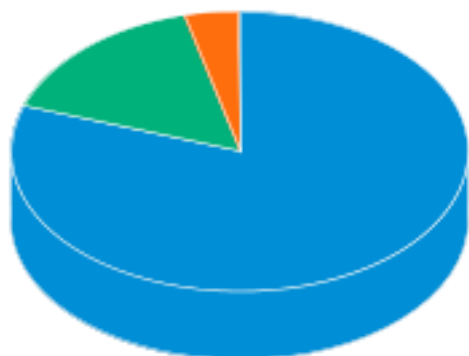
Imóveis	80,28 %
Títulos Federais	15,78 %
Outros	3,10 %
Valores a pagar/receber	0,83 %

Sector do Ativo



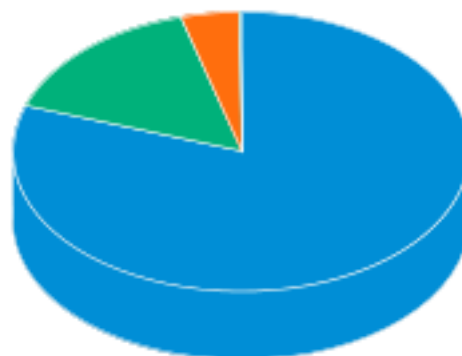
Imobiliário	80,28 %
Governo Federal	15,78 %
Não Classificado	3,94 %

Risco do Ativo



Risco de mercado imobiliário	80,28 %
Rating AAA	15,78 %
Outros	3,94 %

Classe do Ativo



Imóveis	80,28 %
Selic	15,50 %
Outros	4,13 %
Sem indexador	0,09 %

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 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-8,00000	-0,0052 %

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

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
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

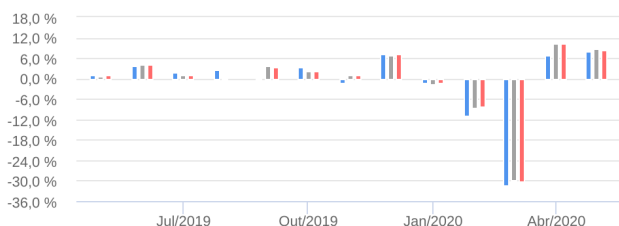
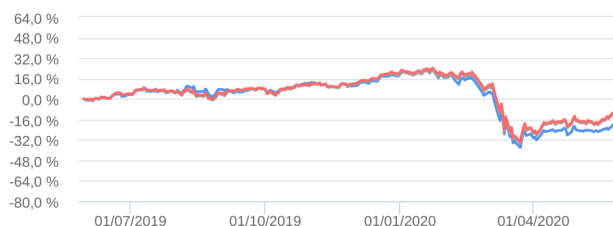
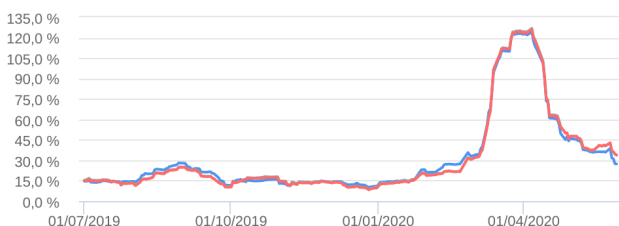
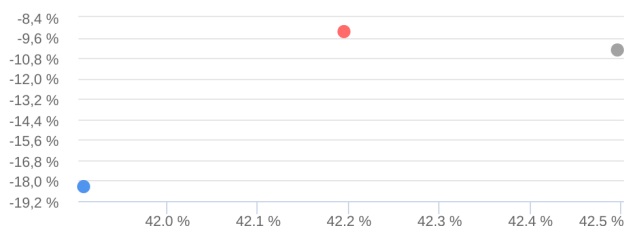
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 03.660.879/0001-96	Aplicação Mínima: R\$ 20.000,00
Gestão: Bradesco Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00
Administrador: BEM DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 20.000,00
Taxa de Administração: 1,50%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 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	

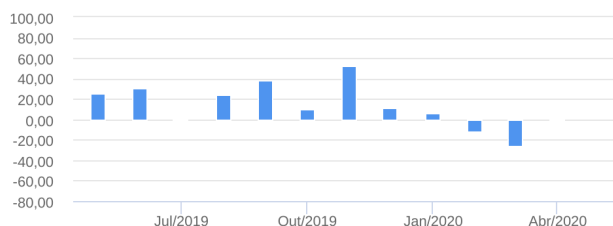
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	1.271,27	-30,73	-18,36	6,61	42,34	7,86	6,84	-31,54	-11,06	-1,29	7,19	-1,45	3,47	0,35	2,76	1,72	3,69
Excesso do Ibovespa	603,71	-6,31	-8,04	-9,38	4,16	-0,71	-3,41	-1,63	-2,63	0,34	0,35	-2,39	1,10	-3,22	3,42	0,89	-0,37
CDI	755,34	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	667,56	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	1.203,08	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	265,55	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	714,3315386	640.262,76	783.291,80	41,91%	-49,77%	19,90%	0,95	8,79%	7,86%	-31,54%	5
Ibovespa	-	-	-	42,50%	-46,82%	20,18%	1,00	0,00%	10,25%	-29,90%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/2020

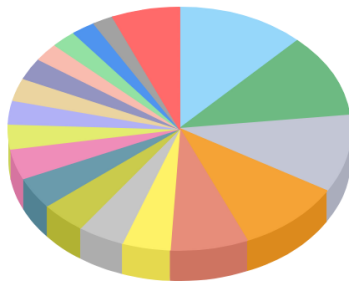
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Ações	98,72%	98,50%	97,91%	90,05%	93,39%	95,57%	94,98%	96,51%
Operações Compromissadas	1,31%	1,98%	3,19%	6,77%	3,82%	0,97%	1,63%	1,14%
Valores a receber	0,78%	0,73%	0,69%	0,36%	1,65%	1,15%	0,85%	0,32%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,81%	-1,20%	-1,79%	-0,12%	-0,79%	-0,13%	-0,40%	-0,19%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	-	-	-	-	-	2,44%	2,94%	2,22%
Outras Aplicações	-	-	-	2,95%	1,94%	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	640.262,76	593.878,23	557.582,12	852.904,45	971.708,91	977.683,78	901.862,74	861.409,56
Data da Divulgação	04/06/2020	07/05/2020	06/04/2020	09/03/2020	07/02/2020	08/01/2020	08/12/2019	06/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)	mai/2020							



VALE ON N1 - VALE3	12,17 %
PETROBRAS PN - PETR4	11,26 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	10,41 %
BRADESCO PN N1 - BBDC4	10,06 %
B3 ON NM - B3SA3	7,40 %
COSAN ON NM - CSAN3	4,57 %
CENTAURO ON NM - CNTO3	4,42 %
VIAVAREJO ON N2 - VVAR3	4,31 %
BRASIL ON NM - BBAS3	4,24 %
LOJAS AMERIC PN - LAME4	4,11 %
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	3,31 %
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	3,17 %
WEG ON NM - WEGE3	3,03 %
JBS ON NM - JBSS3	2,91 %
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	2,42 %
INTERMEDICA ON NM - GNDI3	2,38 %
SLC AGRICOLA ON NM - SLCE3	2,26 %
GERDAU PN N1 - GGBR4	1,96 %
Lançamentos positivos menores que 1,96%	6,41 %

**CARACTERÍSTICAS**

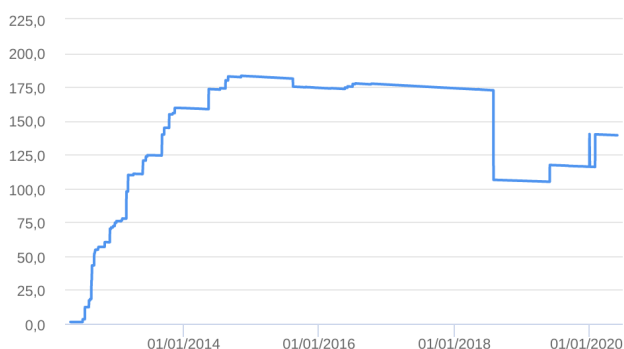
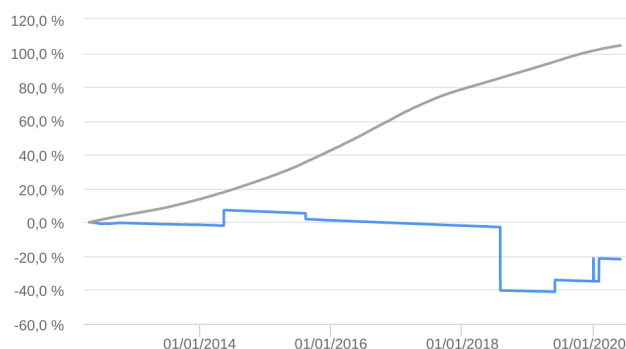
Gestão: Queluz Gestão de Recursos  
 Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros  
 Custodiante: Banco Bradesco  
 Auditor: EY  
 Taxa de Administração: 1,50%  
 Taxa de administração máxima: Não possui  
 Taxa de Performance: Não possui  
 Índice de Performance: Não possui

**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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-21,85	-0,64	32,76	-19,78	-20,99	-0,12	-0,13	-0,14	-0,11	-0,14	20,59	-0,10	-0,15	-0,25	-0,14	-0,15	-0,12
% do CDI	-20,91	-41,54	668,98	-170,46	-103,16	-52,53	-44,98	-40,09	-38,29	-37,34	5.494,89	-25,81	-30,75	-53,49	-27,63	-25,71	-25,54
CDI	104,49	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Dólar	187,84	34,62	36,61	46,29	66,30	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75
Euro	141,37	33,07	36,23	39,73	65,33	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80
Ibovespa	41,68	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IGP-M	62,55	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

**GRÁFICOS**
**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 30/04/2012 a 29/05/2020 (diária)**

**Retorno Acumulado - 30/04/2012 a 29/05/2020 (diária)**


■ Fundo

■ Fundo

■ CDI

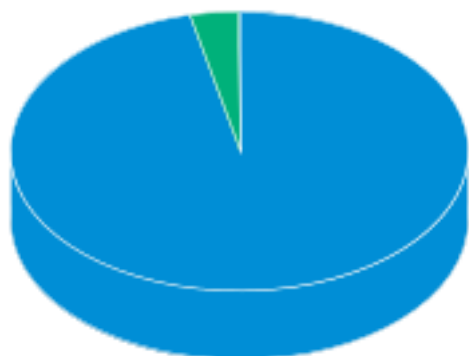
**HISTÓRICO**

PL Médio 12 meses: R\$ 124.056.203,44  
 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: -21,85%  
 Volatilidade Desde o Início: 18,94%

**INFORMAÇÕES OPERACIONAIS**

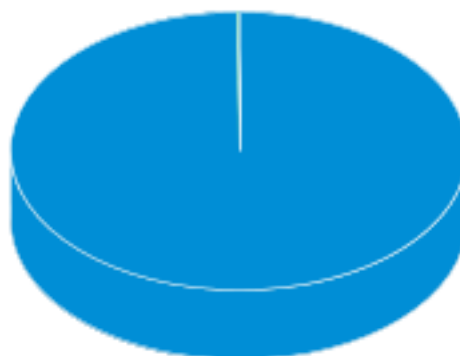
Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00  
 Movimentação mínima: Não há  
 Saldo mínimo: Não há  
 Contato: queluz@queluz.com.br  
 Disponibilidade dos recursos aplicados: Não se aplica  
 Conversão de cota para aplicação: Não se aplica  
 Conversão de cota para resgate: Não se aplica  
 Disponibilidade dos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

Tipo do Ativo



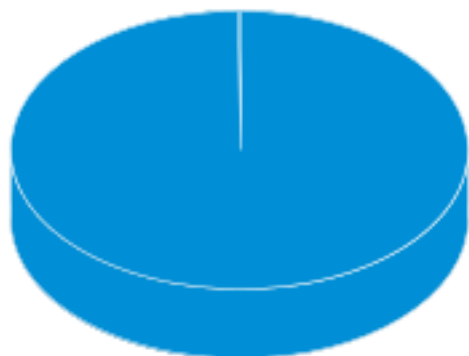
■ Ações	96,50 %
■ Valores a pagar/receber	3,50 %

Sector do Ativo



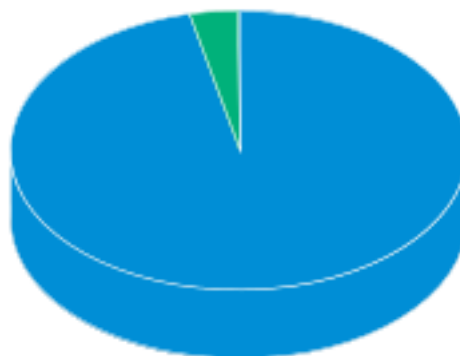
■ Não Classificado	99,88 %
■ Outros	0,12 %

Risco do Ativo



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

Classe do Ativo



■ Ações	96,50 %
■ Outros	3,50 %

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)	144.993,75773	103,4600 %
Outros Valores a receber	186,59506	0,1331 %
Outras Disponibilidades	22,19642	0,0158 %
Outros Valores a pagar	-5.057,78848	-3,6090 %



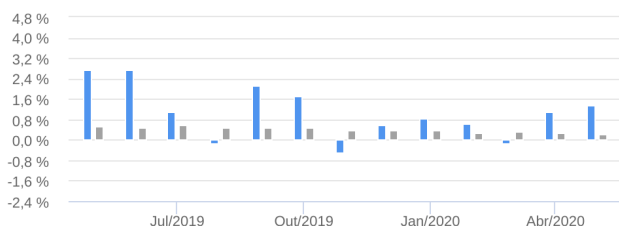
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 23.215.097/0001-55	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: Caixa Econômica Federal	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	47,44	3,85	12,20	27,86	39,35	1,38	1,11	-0,13	0,62	0,82	0,59	-0,51	1,71	2,12	-0,13	1,11	2,73
% do CDI	167,05	250,00	249,23	240,01	193,33	584,68	390,03	-38,62	210,09	217,54	158,37	-132,79	356,87	456,77	-25,81	194,91	583,33
CDI	28,40	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	41,89	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	45,22	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	18,60	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

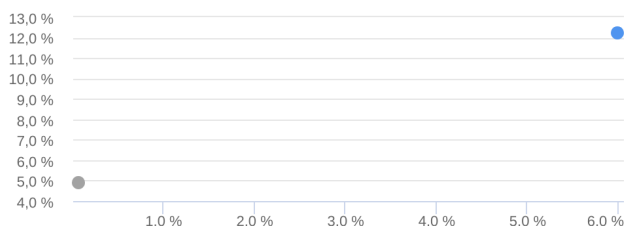
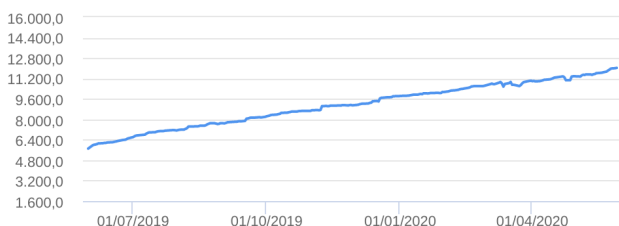
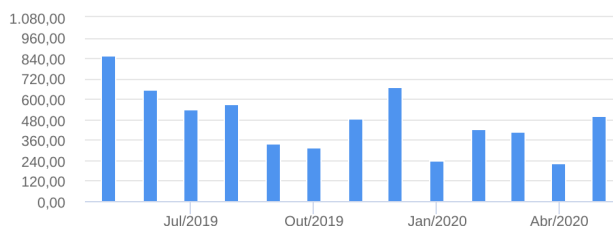
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,474365	12.026.220,42	9.092.219,51	6,00%	-4,27%	2,85%	1,31	6,00%	2,73%	-0,51%	9
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/2020

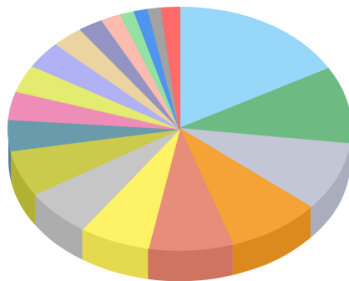
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	99,93%	99,93%	99,94%	99,93%	99,91%	99,89%	99,87%	99,85%
Operações Compromissadas	0,08%	0,07%	0,07%	0,07%	0,09%	0,11%	0,14%	0,16%
Valores a receber	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Títulos Públicos	-	-	-	-	-	-	-	0,00%
<b>Patrimônio Líquido (R\$ mil)</b>	<b>12.026.220,42</b>	<b>11.368.843,03</b>	<b>11.020.077,70</b>	<b>10.626.779,47</b>	<b>10.136.705,21</b>	<b>9.818.666,12</b>	<b>9.094.359,00</b>	<b>8.654.594,96</b>
Data da Divulgação	03/06/2020	06/05/2020	03/04/2020	03/03/2020	07/02/2020	08/01/2020	04/12/2019	06/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								mai/2020



Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2020	16,78 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2023 (BRSTNCNTF147)	10,24 %
LTN - Venc.: 01/07/2020 (BRSTNCLTN7F8)	9,15 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	8,82 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2021 (BRSTNCNTF0N5)	7,95 %
LTN - Venc.: 01/10/2020 (BRSTNCLTN004)	6,65 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2027 (BRSTNCNTF1P8)	6,38 %
LTN - Venc.: 01/07/2023 (BRSTNCLTN7Q5)	6,16 %
LTN - Venc.: 01/07/2021 (BRSTNCLTN7I2)	4,13 %
LTN - Venc.: 01/07/2022 (BRSTNCLTN7O0)	3,76 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2029 (BRSTNCNTF1Q6)	3,66 %
LTN - Venc.: 01/04/2021 (BRSTNCLTN7P7)	3,59 %
LTN - Venc.: 01/01/2022 (BRSTNCLTN7K8)	2,97 %
LTN - Venc.: 01/04/2022 (BRSTNCLTN7T9)	2,32 %
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	1,89 %
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	1,33 %
LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	1,30 %
LTN - Venc.: 01/10/2021 (BRSTNCLTN7R3)	1,24 %
Lançamentos positivos menores que 1,24%	1,68 %

## INSTITUIÇÕES

Gestão: LAD Capital	Administrador: LAD Capital
Diretor: Julius Haupt Buchenrode	Custodiante: Dispensada
Gestor: André Luís de Souza Fernandez	Auditor: UHY Bendoraytes

## PERFIL DO FUNDO

<p><b>Política de Investimento:</b> 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.</p> <p><b>Companhias Alvo:</b> 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.</p>	<p><b>Objetivo:</b> Obter rendimentos, no longo prazo, por meio da aquisição de Valores Mobiliários.</p> <p><b>Limite de Concentração por Companhia:</b> 100%</p>
---	---

## CARACTERÍSTICAS

Tipo Investidor Anbima: Não classificado	Data de Registro: 04/12/2014
Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00	Situação Atual: Em funcionamento normal
Quantidade de Classes: 1.0	Classificação Anbima: Fundo de Participações
Benchmark: Não informado	Classificação Quantum: Participações
Negociação em Mercado Secundário: CETIP / mercado de balcão não organizado	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

30/06/2020: R\$ 1.470.219.157,30
31/03/2020: R\$ 1.470.519.157,30
31/12/2019: R\$ 1.470.657.753,02
30/09/2019: R\$ 1.470.963.301,33

## 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

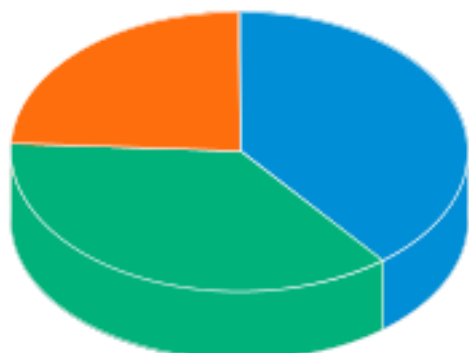
## CONTATO

Site: <a href="http://www.ladcapital.com.br">www.ladcapital.com.br</a>
Email: <a href="mailto:contato@ladcapital.com.br">contato@ladcapital.com.br</a>
Telefone: (11) 3815-5944

## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

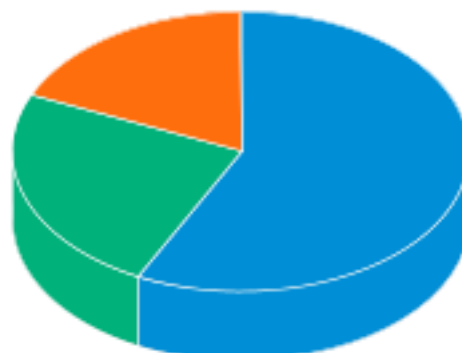
Ativo	DEZEMBRO/2019	
	Valor Investido (R\$ mil)	Participação
Ação de Companhia Fechada - BRAZCARNES PARTICIPAÇÕES S.A. ON (16.915.082/0001-34)	561.602,48	38,19%
Ações / CSDN3 / CNPJ do emissor: 10.826.798/0001-89 / Denominação Social do emissor: BRAZAL - BRASIL ALIMENTOS S.A	454.368,25	30,90%
Ações / CSDN4 / CNPJ do emissor: 10.826.798/0001-89 / Denominação Social do emissor: BRAZAL - BRASIL ALIMENTOS S.A	454.313,28	30,89%
Outros Valores a receber	424.593,76	28,87%
Outros Valores a pagar	-424.058,65	-28,83%
Outras Disponibilidades	0,04	0,00%

Tipo do Ativo



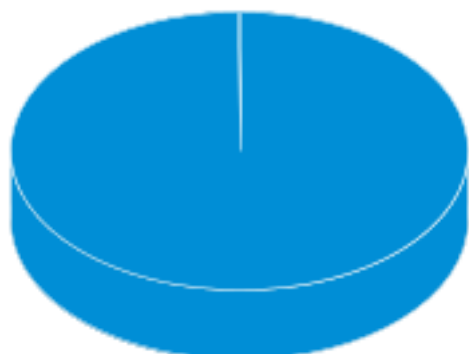
<span style="color: blue;">■</span> Outros	39,19 %
<span style="color: green;">■</span> Valores a pagar/receber	36,60 %
<span style="color: orange;">■</span> Ações	24,22 %

Setor do Ativo



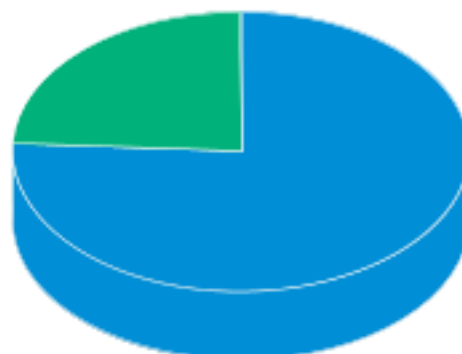
<span style="color: blue;">■</span> Não Classificado	57,47 %
<span style="color: green;">■</span> Holding	24,22 %
<span style="color: orange;">■</span> Outros	18,31 %

Risco do Ativo



<span style="color: blue;">■</span> Outros	100,00 %
--	----------

Classe do Ativo



<span style="color: blue;">■</span> Outros	75,78 %
<span style="color: green;">■</span> Ações	24,22 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Ação de Companhia Fechada - BRAZCARNES PARTICIPAÇÕES S.A. ON (16.915.082/0001-34)	561.602,47745	38,1830 %
Ações / CSDN3 / CNPJ do emissor: 10.826.798/0001-89 / Denominação Social do emissor: BRAZAL - BRASIL ALIMENTOS S.A	454.368,25343	30,8922 %
Ações / CSDN4 / CNPJ do emissor: 10.826.798/0001-89 / Denominação Social do emissor: BRAZAL - BRASIL ALIMENTOS S.A	454.313,28405	30,8885 %
Outros Valores a receber	424.593,75661	28,8678 %
Outras Disponibilidades	0,03715	0,0000 %
Outros Valores a pagar	-424.058,65139	-28,8315 %

**CARACTERÍSTICAS**

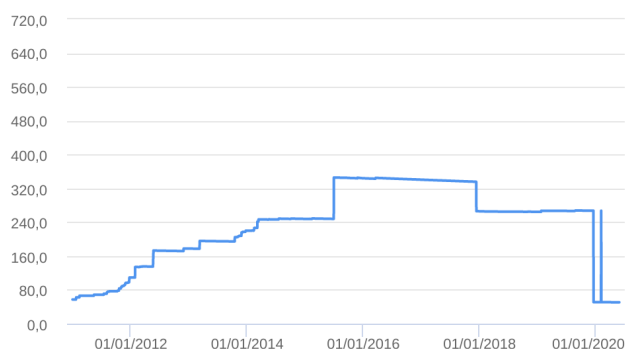
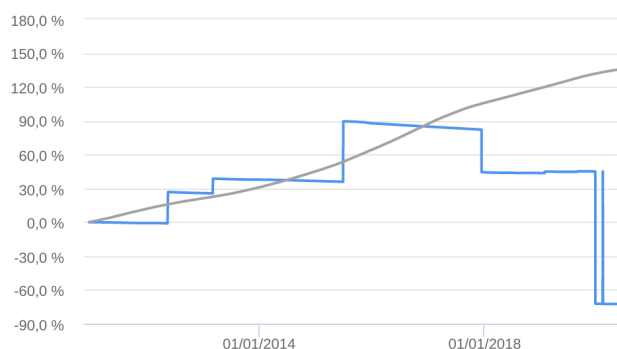
Gestão: Plural  
 Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros  
 Custodiante: Banco Bradesco  
 Auditor: EY  
 Taxa de Administração: 0,30%  
 Taxa de administração máxima: Não possui  
 Taxa de Performance: 20,00%  
 Índice de Performance: 100% do IPCA + 10,5% a.a.

**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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,11	-80,99	-0,03	-0,04	-0,03	0,36	-0,03	-0,02
% do CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-28,95	-21.613,53	-6,99	-7,51	-5,84	71,16	-5,56	-5,20
CDI	135,65	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Dólar	221,73	34,62	36,61	46,29	66,30	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75
Euro	172,65	33,07	36,23	39,73	65,33	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80
Ibovespa	28,46	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IGP-M	73,44	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

**GRÁFICOS**
**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/12/2010 a 29/05/2020 (diária)**

**Retorno Acumulado - 29/12/2010 a 29/05/2020 (diária)**


■ Fundo

■ Fundo

■ CDI

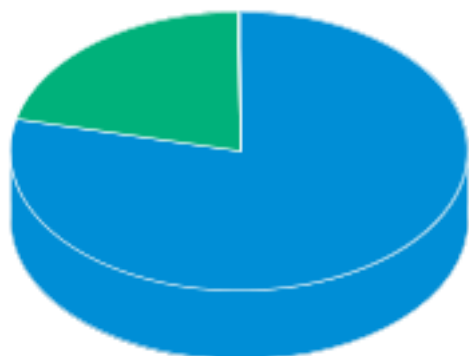
**HISTÓRICO**

PL Médio 12 meses: -  
 Início do Fundo: 01/03/2010  
 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**

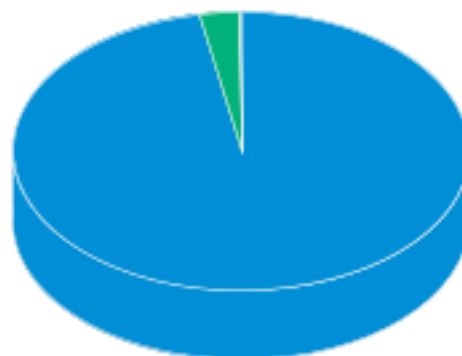
Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00  
 Movimentação mínima: Não há  
 Saldo mínimo: Não há  
 Contato: [asset@brasilplural.com](mailto:asset@brasilplural.com)  
 Disponibilidade dos recursos aplicados: Não se aplica  
 Conversão de cota para aplicação: Não se aplica  
 Conversão de cota para resgate: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

Tipo do Ativo



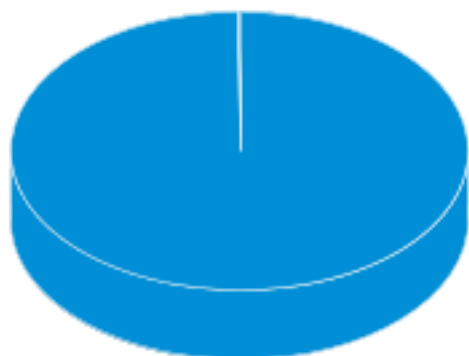
■ Ações	78,72 %
■ Valores a pagar/receber	21,26 %
■ Operação compromissada	0,01 %
■ Outros	0,00 %

Sector do Ativo



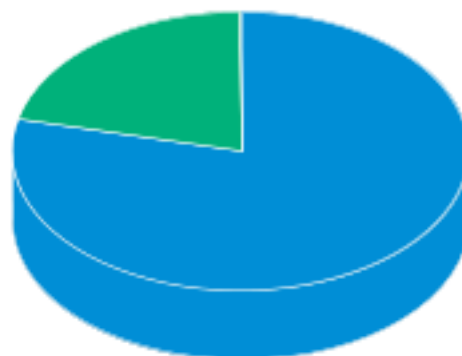
■ Não Classificado	97,04 %
■ Outros	2,95 %
■ Governo Federal	0,01 %

Risco do Ativo



■ Outros	99,99 %
■ Rating AAA	0,01 %

Classe do Ativo



■ Ações	78,72 %
■ Outros	21,27 %
■ Prefixado	0,01 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Ação de Companhia Fechada - BOLT ENERGIAS S.A. ON (12.524.216/0001-35)	63.138,38027	124,2130 %
Outros Valores a receber	2.366,72542	4,6561 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2020	9,30789	0,0183 %
Ações / STIG3 / CNPJ do emissor: 26.775.178/0001-06 / Denominação Social do emissor: STIG ENERGIA E PROJETOS S.A.	1,72516	0,0034 %
Outras Disponibilidades	1,03844	0,0020 %
Outros Valores a pagar	-14.686,44379	-28,8928 %

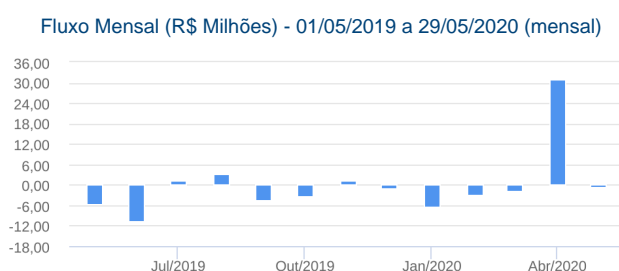
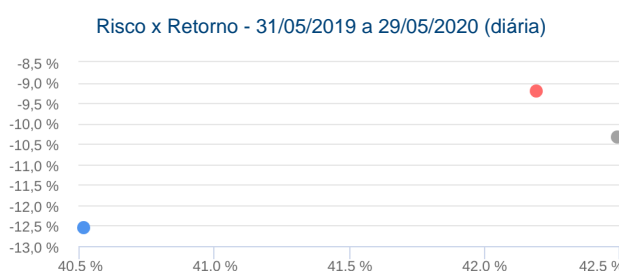
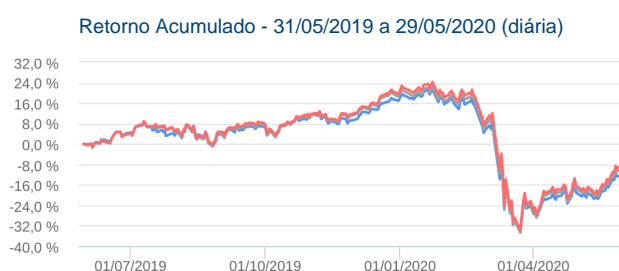
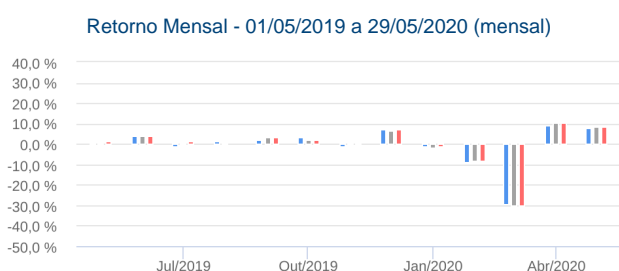
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 01.675.497/0001-00	Aplicação Mínima: R\$ 0,00
Gestão: Genial Investimentos	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BEM DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 3,00%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 3,00%	Conversão 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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	1.628,29	-25,23	-12,55	12,03	16,36	8,11	9,15	-29,74	-8,67	-1,25	7,13	-0,87	3,13	1,93	1,46	-0,84	4,32
Excesso do Ibovespa	1.012,17	-0,81	-2,24	-3,96	-21,81	-0,46	-1,10	0,16	-0,24	0,38	0,28	-1,82	0,77	-1,64	2,13	-1,67	0,26
CDI	1.994,92	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	616,12	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	1.414,29	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	450,70	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	172,829371	292.556,11	315.938,73	40,51%	-45,90%	19,24%	0,91	5,48%	9,15%	-29,74%	6
Ibovespa	-	-	-	42,50%	-46,82%	20,18%	1,00	0,00%	10,25%	-29,90%	0

Gráficos

Fundo Ibovespa IBX



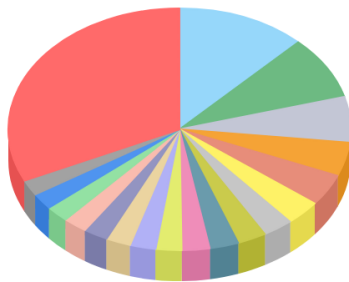
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) mai/2020

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

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Ações	77,21%	74,97%	75,14%	72,32%	79,57%	77,87%	78,54%	75,76%
Cotas de Fundos	13,81%	13,18%	13,33%	14,74%	12,88%	13,25%	13,21%	13,18%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	4,71%	5,16%	4,49%	4,49%	5,66%	7,13%	6,67%	9,77%
Outras Aplicações	2,46%	2,05%	2,16%	3,43%	-	-	-	-
Operações Compromissadas	1,36%	2,42%	5,59%	8,01%	1,61%	1,44%	1,77%	3,32%
Valores a receber	0,90%	2,05%	0,66%	1,46%	0,91%	0,52%	0,15%	0,09%
Brazilian Depository Receipt - BDR	0,88%	0,46%	-	-	-	-	-	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-1,34%	-0,28%	-1,37%	-4,45%	-0,76%	-0,33%	-0,34%	-2,12%
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	-	-	-	-	0,13%	0,12%	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	292.556,11	271.123,34	219.974,85	315.442,17	348.579,71	359.516,30	336.712,06	338.234,43
Data da Divulgação	09/06/2020	12/05/2020	10/04/2020	10/03/2020	06/02/2020	10/01/2020	09/12/2019	11/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)	mai/2020							



VALE ON N1 - VALE3	12,38 %
B3 ON NM - B3SA3	8,59 %
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	6,18 %
PETROBRAS ON - PETR3	4,58 %
JBS ON NM - JBSS3	4,29 %
AMBEV S/A ON - ABEV3	3,38 %
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	2,91 %
BRADESCO PN N1 - BBDC4	2,78 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	2,77 %
BTGP BANCO UNT - BPAC11	2,67 %
TELEF BRASIL PN - VIVT4	2,47 %
B2W DIGITAL ON NM - BTOW3	2,46 %
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	2,38 %
ITAUSA PN N1 - ITSA4	2,34 %
INTERMEDICA ON NM - GNDI3	2,30 %
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	2,23 %
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	2,19 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - SULA11	2,11 %
Lançamentos positivos menores que 2,11%	32,45 %



**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**

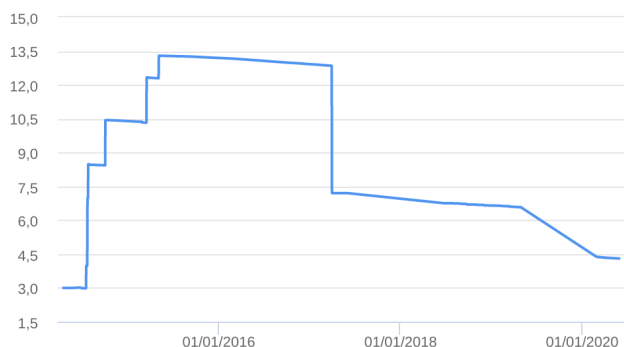
Classificação Quantum: Participações  
 Classificação Anbima: Fundos de Participações  
 Público Alvo: Investidores qualificados  
 Objetivo: Proporcionar a valorização das cotas, por meio de investimentos na aquisição direta de ações ou títulos e Valores Mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações.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

**RETORNO (%)**

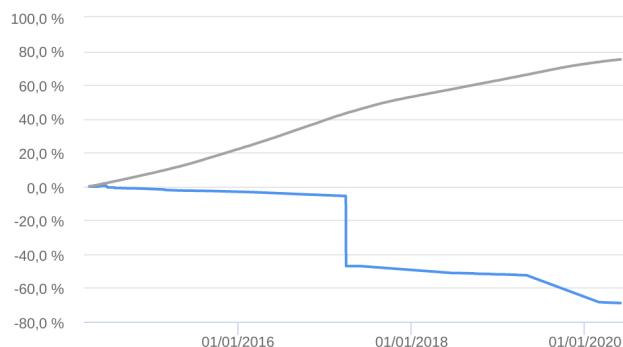
	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
% do CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	75,05	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Dólar	143,80	34,62	36,61	46,29	66,30	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75
Euro	96,18	33,07	36,23	39,73	65,33	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80
Ibovespa	73,23	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IGP-M	40,73	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

**GRÁFICOS**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 16/04/2014 a 29/05/2020 (diária)**



**Retorno Acumulado - 16/04/2014 a 29/05/2020 (diária)**



■ Fundo

**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: -

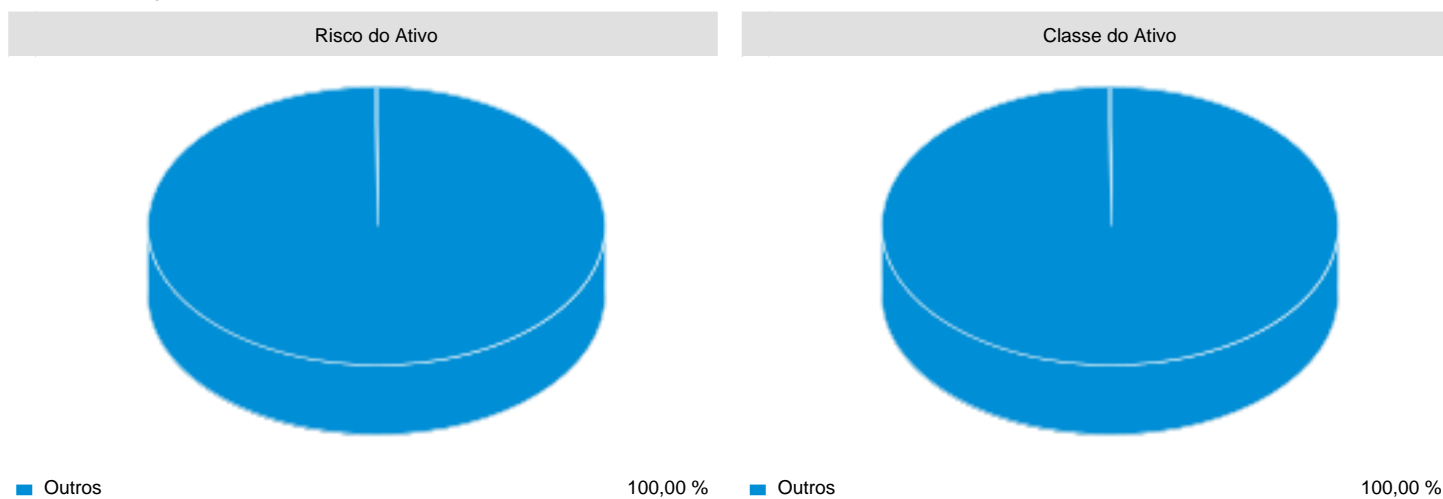
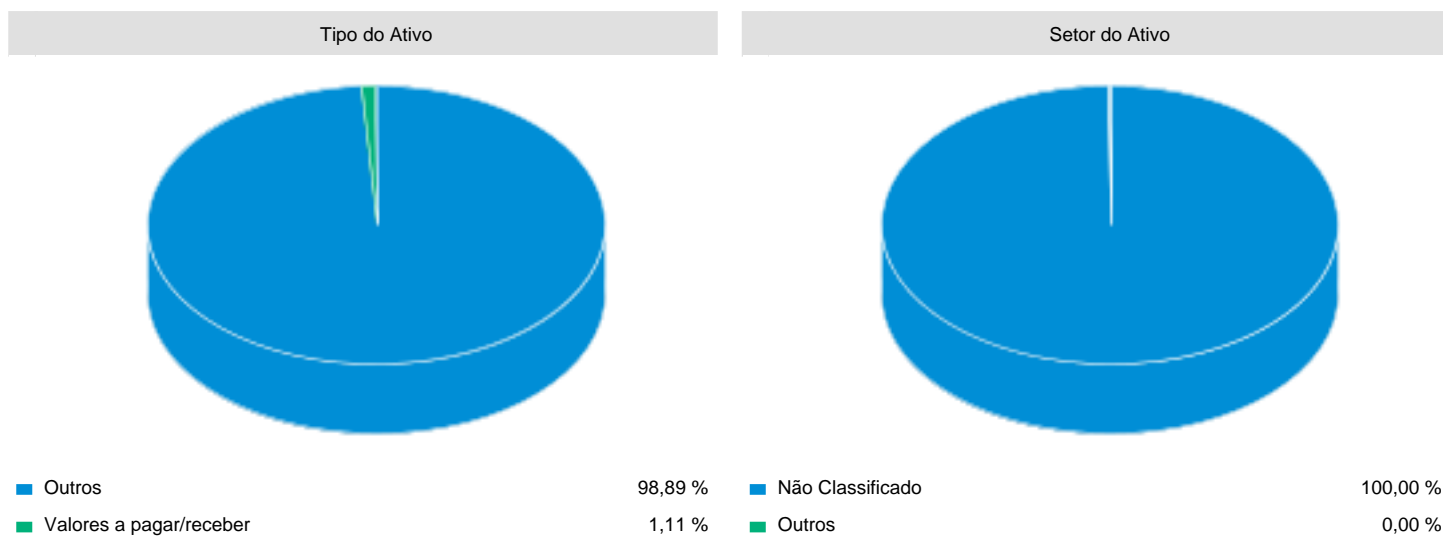
■ Fundo

■ CDI

**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.



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	101,0068 %
Outras Disponibilidades	2,55984	0,0590 %
Outros Valores a receber	0,20638	0,0048 %
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	-46,44701	-1,0705 %

**CARACTERÍSTICAS**

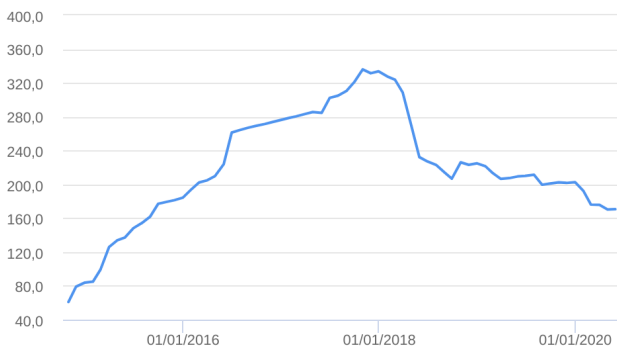
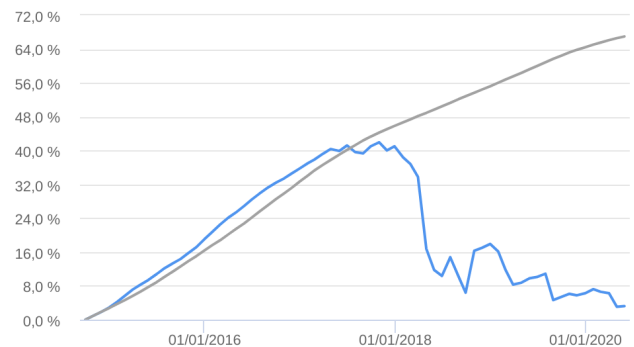
Gestão: Aurora Capital  
 Administrador: CM Capital Markets  
 Custodiante: CM Capital Markets  
 Auditor: BDO Brasil  
 Taxa de Administração: 3,26%  
 Taxa de administração máxima: Não possui  
 Taxa de Performance: 20,00%  
 Índice de Performance: Benchmark

**PERFIL DO FUNDO**

Classificação Quantum: Direito Creditório  
 Classificação Anbima: FIDC Outros  
 Público Alvo: Investidores qualificados  
 Objetivo: Obter rentabilidade equivalente ao IPCA acrescido de 7% ao ano.  
 Política de investimento: Aplica em direitos creditórios oriundos do segmento imobiliário, representados por CCI, CRI, CCB ou debêntures.

**RETORNO (%)**

	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	3,20	-2,88	-5,98	-7,65	-26,24	0,14	-3,02	-0,31	-0,58	0,90	0,47	-0,33	0,69	0,72	-5,63	0,72	0,29
% do CDI	4,78	-187,06	-122,84	-66,23	-130,53	61,34	-1.059,35	-92,20	-197,63	238,53	125,10	-87,31	143,83	154,86	-1.121,68	127,13	61,11
CDI	66,97	1,54	4,87	11,55	20,10	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Dólar	121,39	34,62	37,70	45,20	67,29	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75
Euro	94,76	33,07	37,20	38,24	65,40	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80
Ibovespa	61,51	-24,42	-9,92	13,87	39,37	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IGP-M	42,43	2,79	6,51	14,65	19,54	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

**GRÁFICOS**
**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 01/10/2014 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 01/10/2014 a 29/05/2020 (mensal)**


■ Fundo

■ Fundo

■ CDI

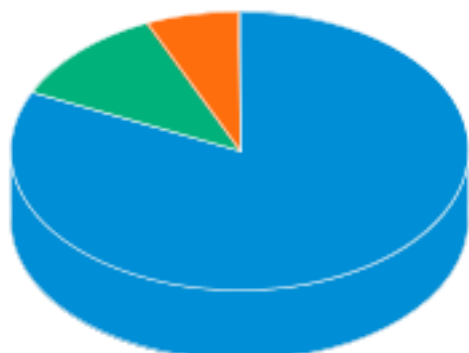
**HISTÓRICO**

PL Médio 12 meses: R\$ 194.104.064,70  
 Início do Fundo: 30/09/2014  
 Máximo Retorno Mensal: 9,32% (out/2018)  
 Mínimo Retorno Mensal: -12,71% (abr/2018)  
 Nº de Meses com Retorno Positivo: 48  
 Nº de Meses com Retorno Negativo: 20  
 Retorno Acumulado Desde o Início: 3,20%  
 Volatilidade Desde o Início: 8,87%

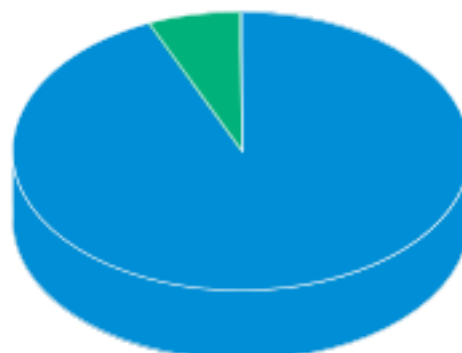
**INFORMAÇÕES OPERACIONAIS**

Aplicação mínima: R\$ 25.000,00  
 Movimentação mínima: R\$ 0,00  
 Saldo mínimo: Não informado  
 Contato: contato@auroracapital.com.br  
 Disponibilidade dos recursos aplicados: D+0  
 Conversão de cota para aplicação: D+0  
 Conversão de cota para resgate: D+1600  
 Disponibilidade dos recursos resgatados: D+1601

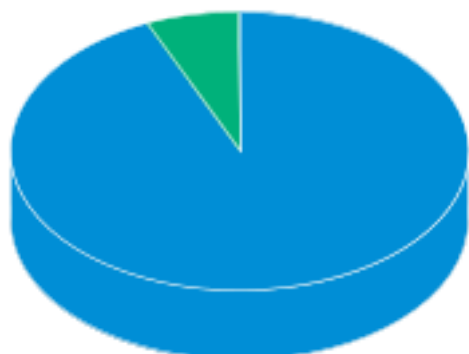
Tipo do Ativo



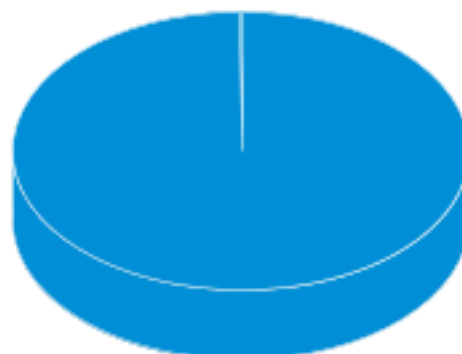
Setor do Ativo



Risco do Ativo

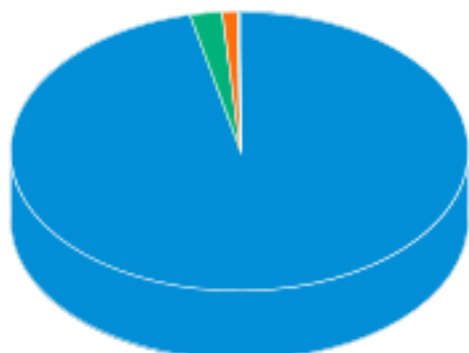


Classe do Ativo



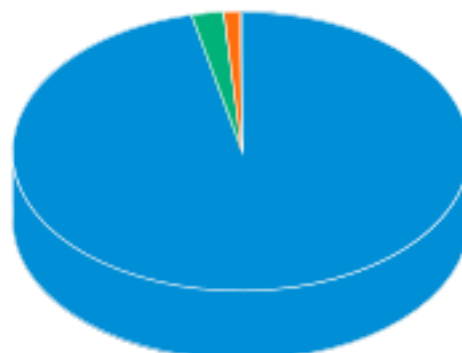
Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Direitos Creditórios - Crédito Imobiliário	251.269,00000	86,6101 %
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	26.590,00000	9,1653 %
Títulos Públicos Federais	20.487,00000	7,0617 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-8.231,00000	-2,8372 %

Tipo do Ativo



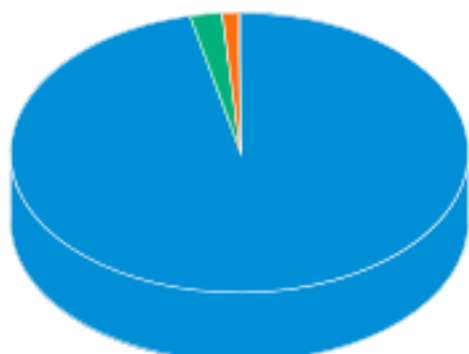
Imóveis	96,48 %
Títulos Federais	2,35 %
Direito Creditório	1,04 %
Valores a pagar/receber	0,11 %
Operação compromissada	0,01 %

Setor do Ativo



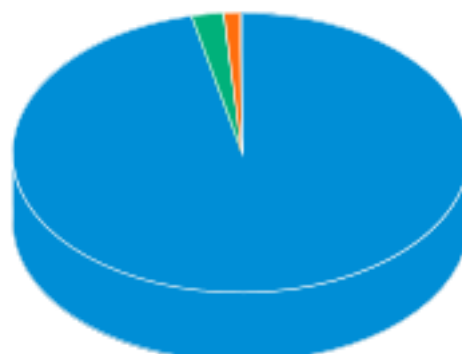
Imobiliário	96,48 %
Governo Federal	2,35 %
Não Classificado	1,17 %

Risco do Ativo



Risco de mercado imobiliário	96,48 %
Rating AAA	2,35 %
Outros	1,17 %

Classe do Ativo



Imóveis	96,48 %
Prefixado	2,36 %
Outros	1,15 %

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	20,3314 %
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	17,1687 %
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	15,8562 %
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	14,2320 %
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	8,9232 %
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	7,0030 %
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	4,8705 %
LTN	2.082,00000	2,3517 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
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	2,3155 %
Imóveis para Renda - Edifício Finabank   Rua Libero Badaró, 300 - São Paulo - SP  Matrícula nº 158.043 do 4º Cartório de Registro de Imóveis. Área construída: 143,95m². Área total: 219,33m².	1.710,00000	1,9315 %
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	1,7169 %
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	1,1747 %
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	1,1623 %
Direitos Creditórios - Crédito Imobiliário	926,73687	1,0468 %
Operações Compromissadas	12,89840	0,0146 %
Disponibilidades	5,00000	0,0056 %
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	0,00000	0,0000 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-0,42260	-0,0005 %
Valores a pagar - Longo Prazo (após 12 meses)	-1,21267	-0,0014 %
Valores a pagar	-91,00000	-0,1028 %

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

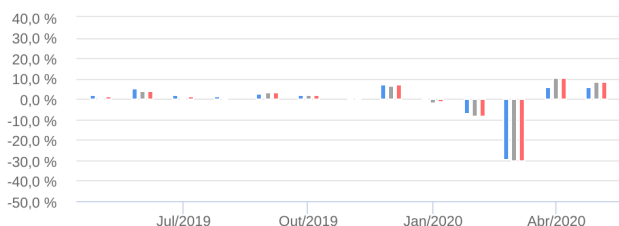
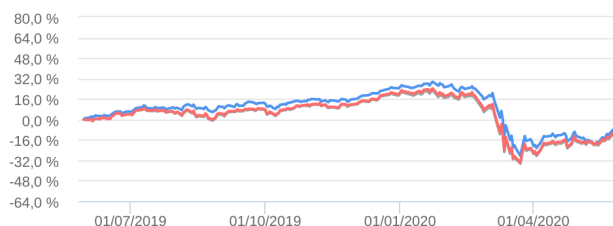
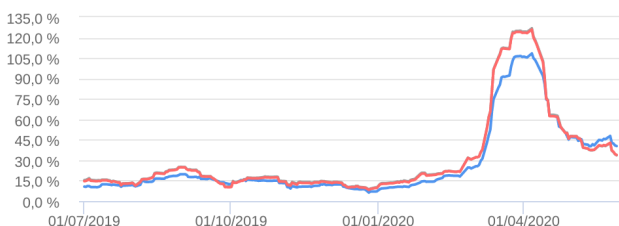
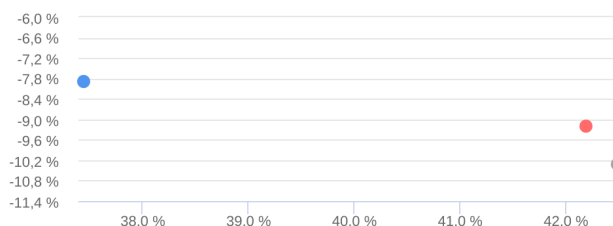
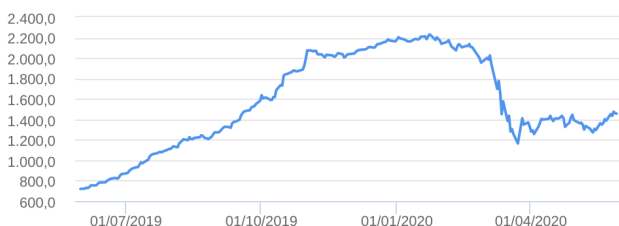
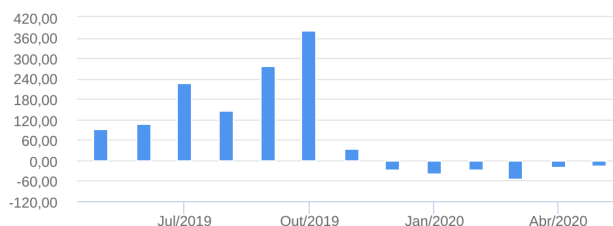
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 08.279.304/0001-41	Aplicação Mínima: R\$ 20.000,00
Gestão: Icatu Vanguarda	Aplicação Adicional: R\$ 5.000,00
Administrador: BEM DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 20.000,00
Taxa de Administração: 2,00%	Resgate Mínimo: R\$ 5.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 2,00%	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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	342,73	-25,90	-7,88	31,16	45,88	5,82	6,08	-29,46	-7,00	0,62	7,51	0,46	1,86	2,64	1,47	2,32	5,06
Excesso do Ibovespa	221,45	-1,48	2,44	15,18	7,71	-2,75	-4,18	0,44	1,43	2,25	0,66	-0,49	-0,50	-0,93	2,13	1,48	1,00
CDI	264,75	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	121,28	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	189,05	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	126,97	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	4,4273039	1.455.929,52	1.568.247,43	37,44%	-44,83%	17,78%	0,93	11,43%	7,51%	-29,46%	7
Ibovespa	-	-	-	42,50%	-46,82%	20,18%	1,00	0,00%	10,25%	-29,90%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/2020

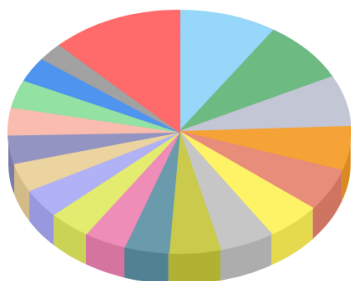
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Ações	73,12%	77,24%	77,94%	76,93%	75,33%	71,73%	71,84%	73,23%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	18,22%	15,39%	13,88%	18,59%	18,70%	19,04%	18,48%	17,83%
Operações Compromissadas	8,87%	7,69%	7,66%	4,22%	5,84%	9,40%	8,29%	16,36%
Valores a receber	0,75%	0,76%	0,97%	1,47%	0,85%	0,20%	1,62%	0,21%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,95%	-1,08%	-0,45%	-1,21%	-0,72%	-0,37%	-0,23%	-7,63%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.455.929,52	1.392.329,92	1.330.411,89	1.963.717,20	2.139.496,71	2.163.582,48	2.037.041,66	1.993.815,00
Data da Divulgação	08/06/2020	13/05/2020	10/04/2020	09/03/2020	05/02/2020	10/01/2020	14/01/2020	11/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								mai/2020



VALE ON N1 - VALE3	9,36 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2023	8,34 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - TAEE11	6,88 %
ITAUSA PN N1 - ITSA4	5,89 %
LOJAS RENNEN ON NM - LREN3	5,70 %
AMBEV S/A ON - ABEV3	5,21 %
BR MALLS PAR ON NM - BRML3	5,21 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - SAPR11	4,91 %
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	4,22 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - ALUP11	4,01 %
B3 ON NM - B3SA3	3,97 %
LIGHT S/A ON NM - LIGT3	3,92 %
OMEGA GER ON NM - OMGE3	3,86 %
BRADESCO ON N1 - BBDC3	3,82 %
TELEF BRASIL PN - VIVT4	3,73 %
COPASA ON NM - CSMG3	3,72 %
BRASIL ON NM - BBAS3	3,30 %
VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	2,48 %
Lançamentos positivos menores que 2,48%	12,40 %



## :: ILLUMINATI FIDC

## CARACTERÍSTICAS

Gestão: Queluz Gestão de Recursos  
 Administrador: Planner Corretora  
 Custodiante: Planner Corretora  
 Auditor: Baker Tilly Brasil  
 Taxa de Administração: 1,50%  
 Taxa de administração máxima: Não possui  
 Taxa de Performance: 20,00%  
 Índice de Performance: 100% do IPCA + 8,5% a.a.

## PERFIL DO FUNDO

Classificação Quantum: Direito Creditório  
 Classificação Anbima: FIDC Outros  
 Público Alvo: Exclusivo  
 Objetivo: Obter rentabilidade equivalente a IPCA + 8,5% a.a. investindo até 75% em direitos creditórios e o excedente em títulos de emissão do Tesouro Nacional (TN) e do BACEN, créditos securitizados pelo TN, CDB e RDB, FI Referenciado DI.  
 Política de investimento: Aplica em direitos creditórios oriundos de Cédulas de Crédito Imobiliário, de Certificados de Recebíveis Imobiliários, Cédulas de Crédito Bancário e Debêntures.

## RETORNO (%)

	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	3,90	-10,86	-7,26	-14,31	-6,52	-1,15	-10,86	0,42	5,44	-4,46	0,38	0,19	1,27	0,48	1,32	-1,26	1,61
% do CDI	9,29	-705,94	-149,11	-123,92	-32,46	-488,92	-3.812,02	123,68	1.852,44	-1.183,04	101,52	50,37	265,60	102,92	262,98	-221,41	344,39
CDI	41,99	1,54	4,87	11,55	20,10	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Dólar	34,22	34,62	37,70	45,20	67,29	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75
Euro	37,56	33,07	37,20	38,24	65,40	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80
Ibovespa	116,32	-24,42	-9,92	13,87	39,37	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IGP-M	25,03	2,79	6,51	14,65	19,54	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

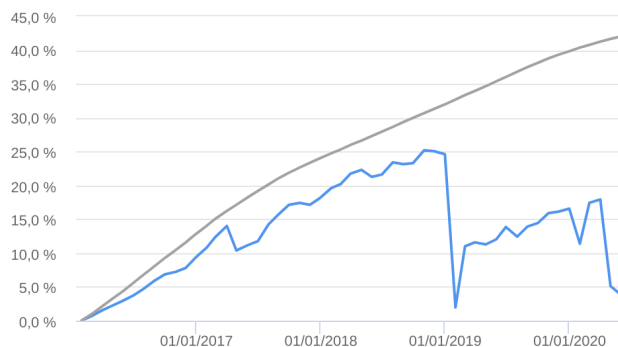
## GRÁFICOS

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 01/02/2016 a 29/05/2020 (mensal)



■ Fundo

Retorno Acumulado - 01/02/2016 a 29/05/2020 (mensal)



■ Fundo

■ CDI

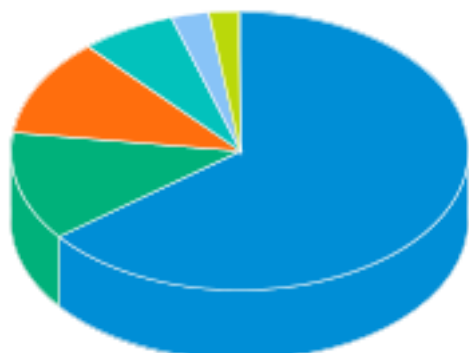
## HISTÓRICO

PL Médio 12 meses: R\$ 200.078.708,41  
 Início do Fundo: 29/01/2016  
 Máximo Retorno Mensal: 8,87% (fev/2019)  
 Mínimo Retorno Mensal: -18,18% (jan/2019)  
 Nº de Meses com Retorno Positivo: 40  
 Nº de Meses com Retorno Negativo: 12  
 Retorno Acumulado Desde o Início: 3,90%  
 Volatilidade Desde o Início: 12,16%

## INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

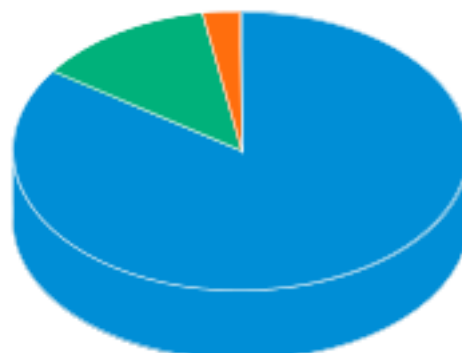
Aplicação mínima: R\$ 25.000,00  
 Movimentação mínima: Não informado  
 Saldo mínimo: Não informado  
 Contato: queluz@queluz.com.br  
 Disponibilidade dos recursos aplicados: D+0  
 Conversão de cota para aplicação: D+0  
 Conversão de cota para resgate: D+0 ou D+1259 (isento de taxa de resgate)  
 Disponibilidade dos recursos resgatados: D+1 ou D+1260 (isento de taxa de resgate)

Tipo do Ativo



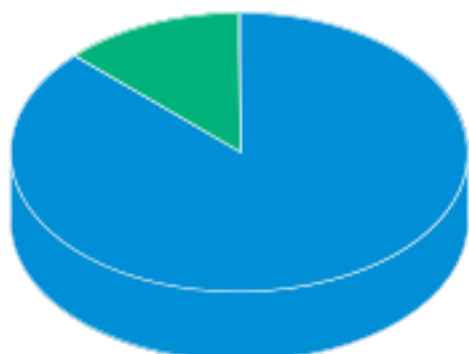
Outros	64,43 %
Títulos Federais	12,74 %
Nota Promissória	11,39 %
Valores a pagar/receber	6,62 %
Direito Creditório	2,70 %
Fundos de Investimento	2,12 %

Setor do Ativo



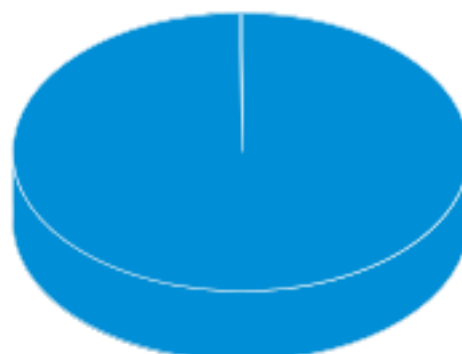
Não Classificado	84,56 %
Governo Federal	12,74 %
Outros	2,70 %

Risco do Ativo



Outros	87,26 %
Rating AAA	12,74 %

Classe do Ativo



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

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Outros Ativos Financeiros de Renda Fixa	122.632,00000	74,2671 %
Títulos Públicos Federais	24.244,00000	14,6824 %
Notas Promissórias Comerciais	21.671,00000	13,1242 %
Direitos Creditórios	5.134,00000	3,1092 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	4.044,00000	2,4491 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-12.602,00000	-7,6319 %

**CARACTERÍSTICAS**

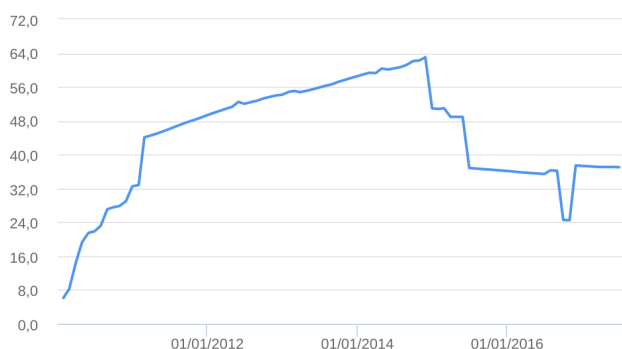
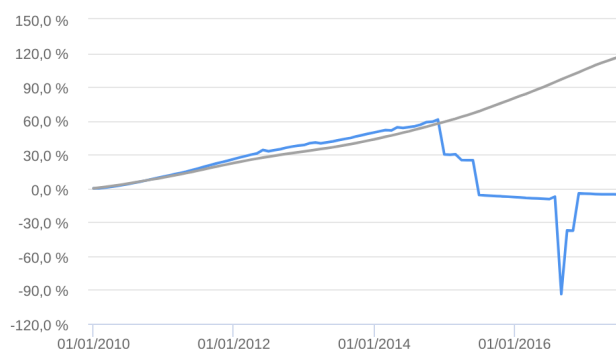
Gestão: RJI Gestão & Investimentos  
 Administrador: RJI Corretora de Valores  
 Custodiante: RJI Corretora de Valores  
 Auditor: KPMG  
 Taxa de Administração: 0,18%  
 Taxa de administração máxima: Não possui  
 Taxa de Performance: 25,00%  
 Índice de Performance: 120% do CDI

**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	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
% do CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	159,78	2,12	3,86	10,38	17,92	0,16	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46
Dólar	214,23	35,74	32,20	32,31	73,85	5,15	-4,98	0,92	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63
Euro	160,81	44,34	43,78	36,35	74,68	6,30	-0,03	2,08	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13
Ibovespa	44,88	-14,07	-1,75	29,59	40,28	-3,44	8,27	8,76	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57
IGP-M	105,76	9,64	13,02	18,62	29,16	2,74	2,23	1,56	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00

**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

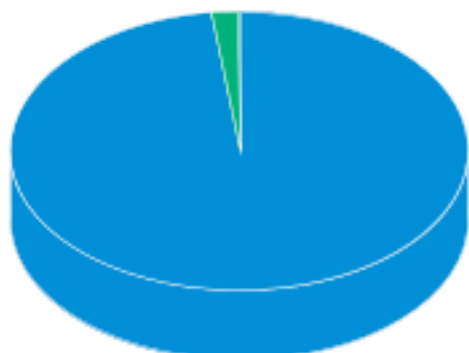
**HISTÓRICO**

PL Médio 12 meses: R\$ 0,01  
 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**

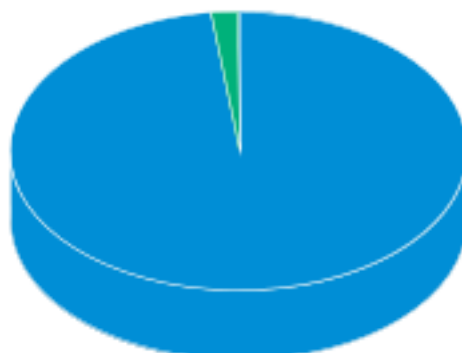
Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00  
 Movimentação mínima: Não há  
 Saldo mínimo: Não há  
 Contato: atendimento@rjgestora.com.br  
 Disponibilidade dos recursos aplicados: Não se aplica  
 Conversão de cota para aplicação: Não se aplica  
 Conversão de cota para resgate: Não se aplica  
 Disponibilidade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

Tipo do Ativo



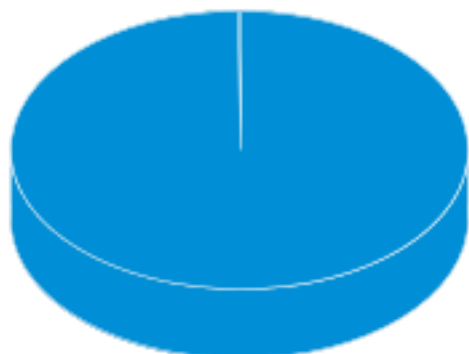
■ Direito Creditório 98,01 %  
■ Valores a pagar/receber 1,99 %

Sector do Ativo



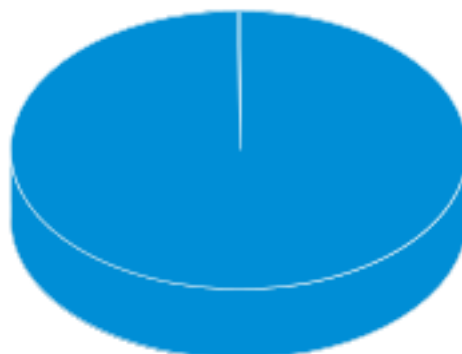
■ Outros 98,01 %  
■ Não Classificado 1,99 %

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	37.797,00000	101,6021 %
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	86,00000	0,2312 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-682,00000	-1,8333 %

**CARACTERÍSTICAS**

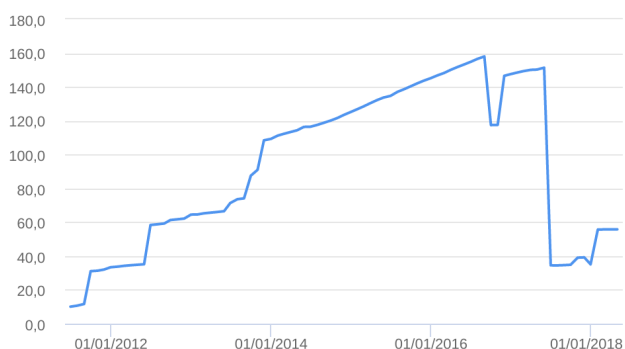
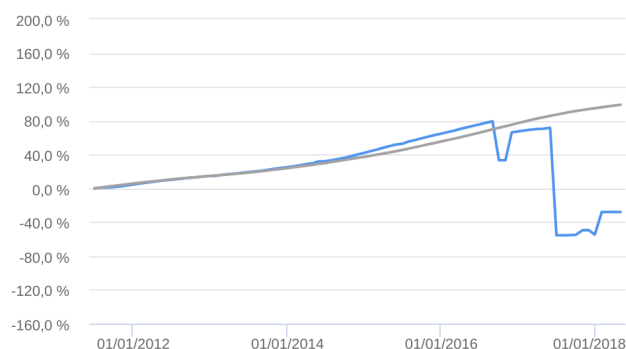
Gestão: RJI Corretora de Valores  
 Administrador: Gradual Investimentos  
 Custodiante: RJI Corretora de Valores  
 Auditor: KPMG  
 Taxa de Administração: 0,00%  
 Taxa de administração máxima: Não possui  
 Taxa de Performance: 25,00%  
 Índice de Performance: 120% do CDI

**PERFIL DO FUNDO**

Classificação Quantum: Direito Creditório  
 Classificação Anbima: FIDC Outros  
 Público Alvo: Investidores qualificados  
 Objetivo: Obter rentabilidade equivalente a 120% da taxa CDI.  
 Política de investimento: Aplica em direitos creditórios performados e a vencer, oriundos dos segmentos industrial, comercial, financeiro, agropecuário, imobiliário e de serviços.

**RETORNO (%)**

	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
% do CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	124,32	2,12	3,86	10,38	17,92	0,16	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46
Dólar	250,48	35,74	32,20	32,31	73,85	5,15	-4,98	0,92	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63
Euro	188,49	44,34	43,78	36,35	74,68	6,30	-0,03	2,08	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13
Ibovespa	59,24	-14,07	-1,75	29,59	40,28	-3,44	8,27	8,76	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57
IGP-M	79,20	9,64	13,02	18,62	29,16	2,74	2,23	1,56	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00

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

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


■ Fundo

■ Fundo

■ CDI

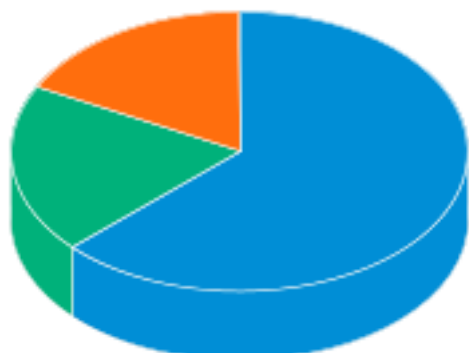
**HISTÓRICO**

PL Médio 12 meses: R\$ 52.127.439,92  
 Início do Fundo: 03/06/2011  
 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**

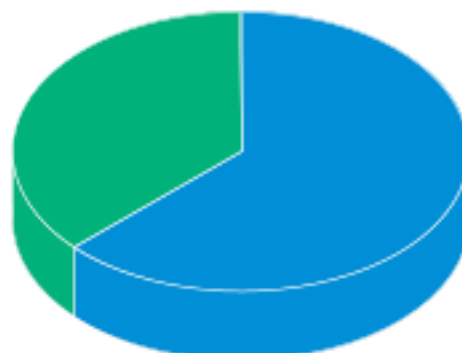
Aplicação mínima: R\$ 25.000,00  
 Movimentação mínima: Não informado  
 Saldo mínimo: R\$ 25.000,00  
 Contato: atendimento@rjicv.com.br  
 Disponibilidade dos recursos aplicados: D+0  
 Conversão de cota para aplicação: D+0  
 Conversão de cota para resgate: D+1200  
 Disponibilidade dos recursos resgatados: D+1260

Tipo do Ativo



<span style="color: blue;">■</span> Direito Creditório	63,05 %
<span style="color: green;">■</span> Fundos de Investimento	19,61 %
<span style="color: orange;">■</span> Valores a pagar/receber	17,34 %

Setor do Ativo



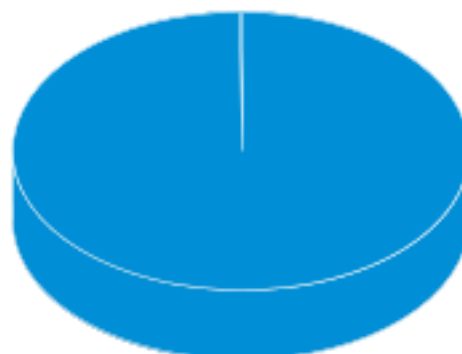
<span style="color: blue;">■</span> Outros	63,05 %
<span style="color: green;">■</span> Não Classificado	36,95 %

Risco do Ativo



<span style="color: blue;">■</span> Outros	100,00 %
--	----------

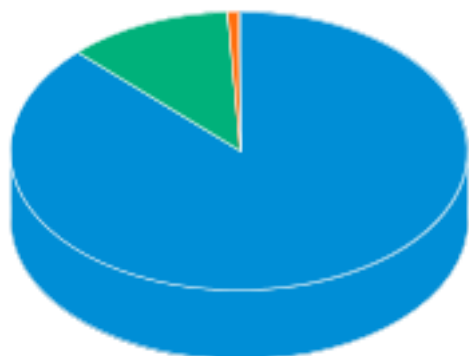
Classe do Ativo



<span style="color: blue;">■</span> Outros	100,00 %
--	----------

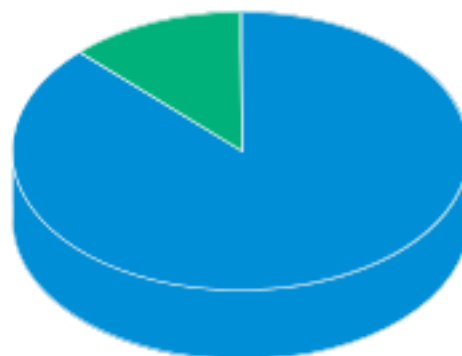
Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Direitos Creditórios - Multiclasse	104.909,00000	65,2882 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	32.623,00000	20,3023 %
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	26.002,00000	16,1819 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-2.848,00000	-1,7724 %

Tipo do Ativo



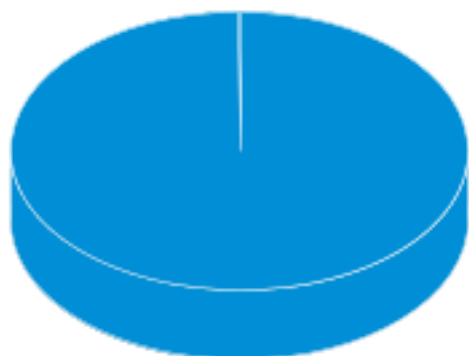
■ Ações	87,49 %
■ Fundos de Investimento	11,69 %
■ Valores a pagar/receber	0,82 %

Setor do Ativo



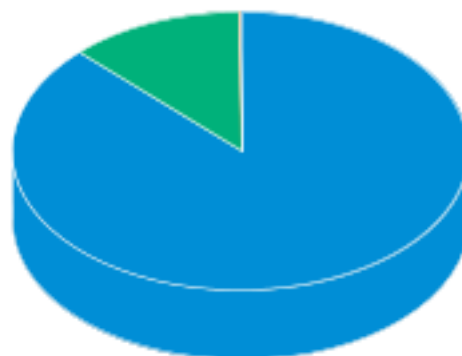
■ Não Classificado	87,62 %
■ Outros	12,38 %

Risco do Ativo



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

Classe do Ativo



■ Ações	87,49 %
■ Outros	12,41 %
■ Sem indexador	0,10 %

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	87,6550 %
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 %

**CARACTERÍSTICAS**

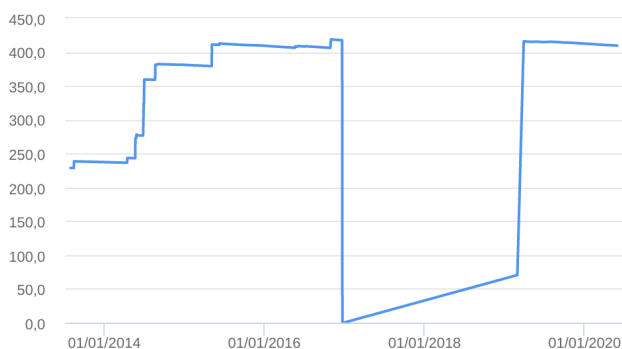
Gestão: Infra Asset Management  
 Administrador: RJI Corretora de Valores  
 Custodiante: RJI Corretora de Valores  
 Auditor: BDO Brasil  
 Taxa de Administração: 2,00%  
 Taxa de administração máxima: Não possui  
 Taxa de Performance: 20,00%  
 Índice de Performance: 100% do IPCA + 10% a.a.

**PERFIL DO FUNDO**

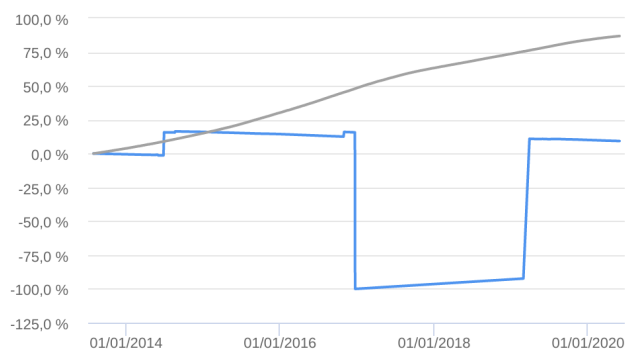
Classificação Quantum: Participações  
 Classificação Anbima: Fundos de Participações  
 Público Alvo: Investidores qualificados  
 Objetivo: Obter retornos superiores ao IPCA + 10% a.a., no longo prazo, por meio de investimentos em carteira diversificada de valores mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações.  
 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.

**RETORNO (%)**

	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
% do CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	86,85	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Dólar	138,69	34,62	36,61	46,29	66,30	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75
Euro	99,87	33,07	36,23	39,73	65,33	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80
Ibovespa	79,99	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IGP-M	49,92	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

**GRÁFICOS**
**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/07/2013 a 29/05/2020 (diária)**


■ Fundo

**Retorno Acumulado - 31/07/2013 a 29/05/2020 (diária)**


■ Fundo

■ CDI

**HISTÓRICO**

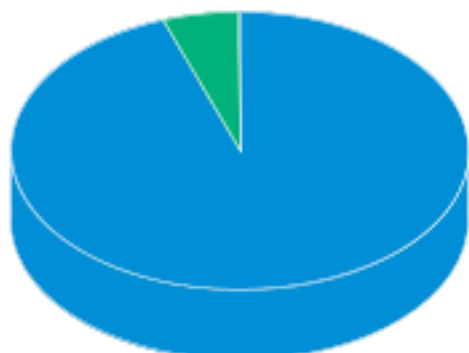
PL Médio 12 meses: -  
 Início do Fundo: 19/12/2011  
 Máximo Retorno Mensal: - (-)  
 Mínimo Retorno Mensal: - (-)  
 Nº de Meses com Retorno Positivo: -  
 Nº de Meses com Retorno Negativo: -  
 Retorno Acumulado Desde o Início: -  
 Volatilidade Desde o Início: -

**INFORMAÇÕES OPERACIONAIS**

Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00  
 Movimentação mínima: Não há  
 Saldo mínimo: Não há  
 Contato: contato@infraasset.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

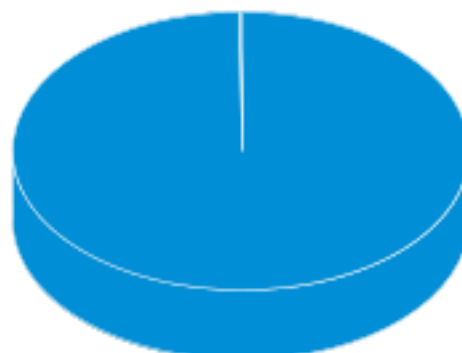


Tipo do Ativo



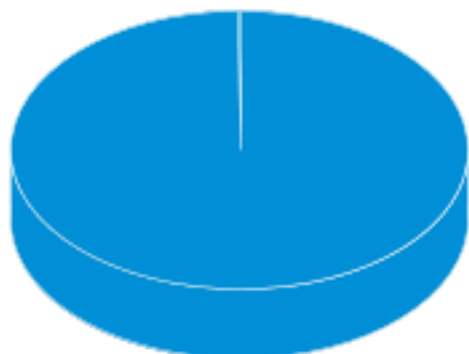
■ Outros	94,52 %
■ Valores a pagar/receber	5,48 %

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	106,1479 %
Outras Disponibilidades	2,22505	0,0005 %
Outros Valores a receber	1,02034	0,0002 %
Outros Valores a pagar	-25.245,06912	-6,1487 %

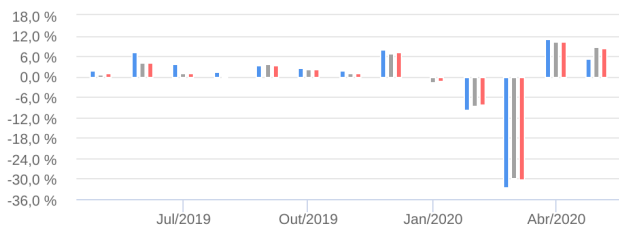
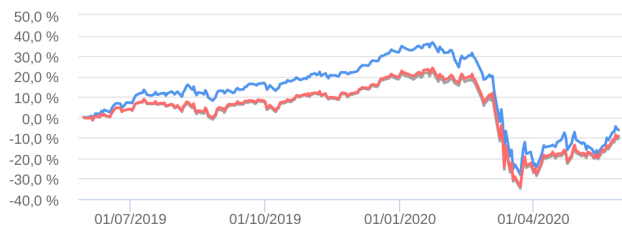
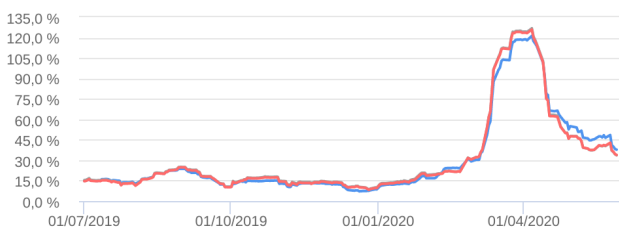
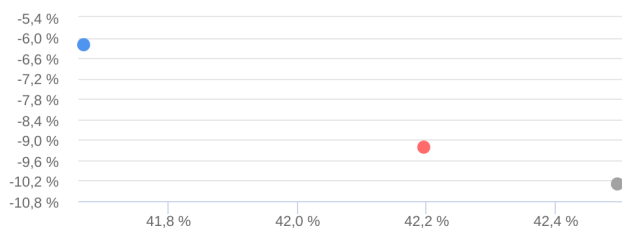
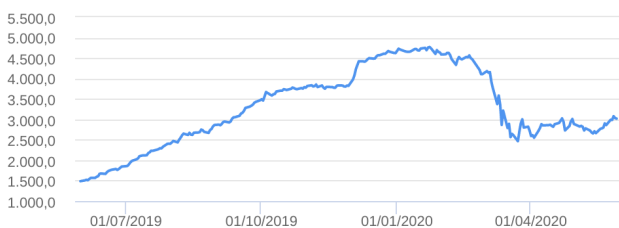
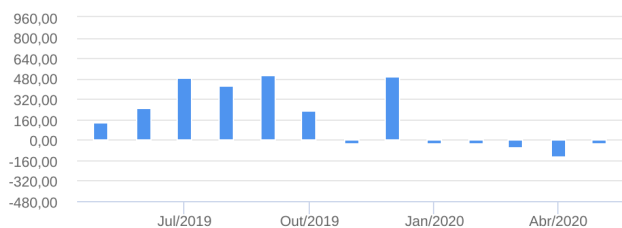
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 24.571.992/0001-75	Aplicação Mínima: R\$ 100,00
Gestão: Itaú Unibanco	Aplicação Adicional: R\$ 100,00
Administrador: Itaú Unibanco	Saldo Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração: 1,90%	Resgate Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração (Máxima): 2,00%	Conversão 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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	68,97	-28,85	-6,22	24,05	51,55	5,36	11,03	-32,44	-9,79	-0,19	8,13	1,90	2,38	3,42	1,57	3,75	7,22
Excesso do Ibovespa	19,78	-4,43	4,10	8,06	13,38	-3,21	0,78	-2,54	-1,36	1,44	1,28	0,95	0,02	-0,15	2,23	2,91	3,17
CDI	30,90	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	49,19	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	51,70	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	18,94	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	16,896958	3.016.388,88	3.280.920,92	41,67%	-47,39%	19,79%	0,98	9,08%	11,03%	-32,44%	8
Ibovespa	-	-	-	42,50%	-46,82%	20,18%	1,00	0,00%	10,25%	-29,90%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/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.

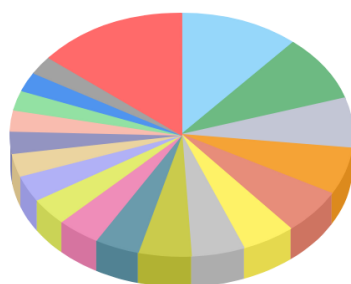
**:: ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	100,13%	100,03%	99,93%	100,09%	100,13%	101,35%	101,18%	100,96%
Valores a receber	0,05%	0,16%	0,78%	0,19%	0,07%	0,08%	0,13%	0,09%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,18%	-0,20%	-0,71%	-0,28%	-0,21%	-1,43%	-1,31%	-1,05%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	3.016.388,88	2.886.370,47	2.717.755,34	4.106.560,00	4.585.787,42	4.621.308,30	3.818.759,95	3.774.193,65
Data da Divulgação	05/06/2020	08/05/2020	07/04/2020	06/03/2020	07/02/2020	08/01/2020	06/12/2019	07/11/2019

**Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)**

mai/2020



ENERGISA UNT N2 - ENGI11	11,38 %
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	8,91 %
PETROBRAS ON - PETR3	6,74 %
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	6,28 %
TOTVS ON NM - TOTS3	6,05 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	5,09 %
PETROBRAS DISTRIB ON - BRDT3	5,07 %
EZTEC ON NM - EZTC3	5,02 %
CCR SA ON NM - CCRO3	4,24 %
B2W DIGITAL ON NM - BTOW3	4,09 %
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	3,69 %
CARREFOUR BR ON NM - CRFB3	3,51 %
LOCALIZA ON NM - RENT3	3,12 %
CEA MODAS ON NM - CEAB3	2,96 %
CYRE COM-CCP ON NM - CCPR3	2,82 %
FLEURY ON NM - FLRY3	2,65 %
JBS ON NM - JBSS3	2,57 %
Investimento no Exterior - COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	2,49 %
Lançamentos positivos menores que 2,49%	14,15 %

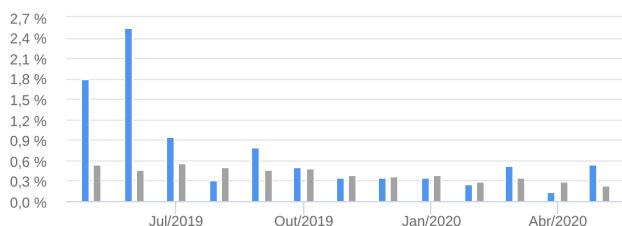
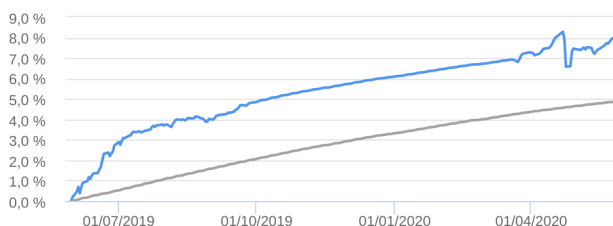
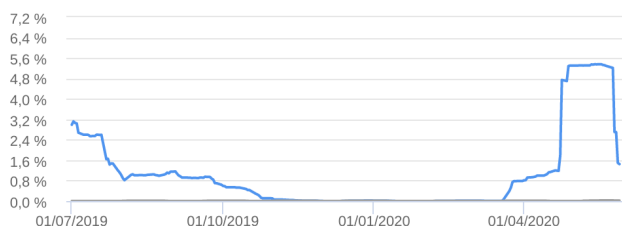
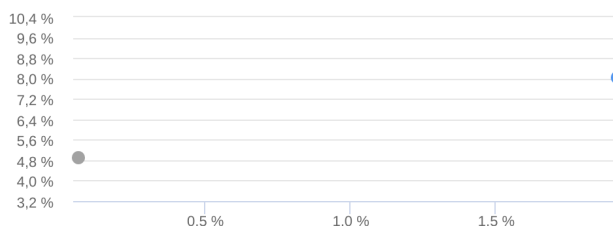
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 21.838.150/0001-49	Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00
Gestão: Itaú Unibanco	Aplicação Adicional: R\$ 1,00
Administrador: Itaú Unibanco	Saldo Mínimo: R\$ 1,00
Taxa de Administração: 0,40%	Resgate Mínimo: R\$ 1,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,40%	Conversão 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	

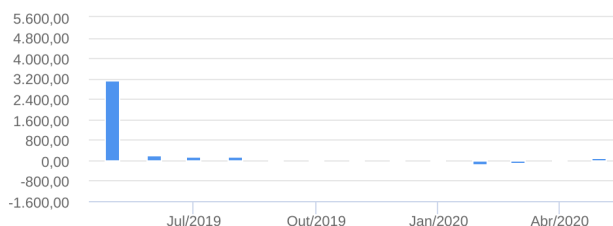
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	78,44	1,82	8,02	19,48	32,98	0,54	0,14	0,53	0,26	0,34	0,34	0,35	0,50	0,78	0,32	0,95	2,55
% do CDI	142,74	118,50	163,77	167,82	162,06	229,20	50,29	156,25	87,71	90,48	91,74	91,67	103,57	168,78	63,16	166,84	543,38
CDI	54,95	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	64,81	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	67,89	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	34,83	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	17,844125	5.202.369,35	5.060.013,93	1,92%	-1,57%	0,91%	3,09	1,91%	2,55%	0,14%	6
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/2020

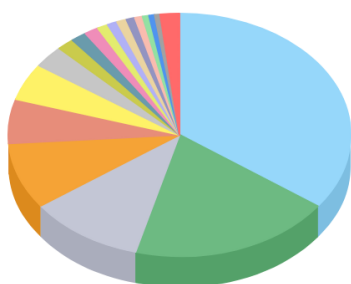
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	100,00%	100,00%	99,98%	100,03%	100,00%	100,03%	100,00%	100,00%
Valores a receber	0,14%	0,04%	0,13%	0,24%	0,15%	0,00%	0,26%	0,04%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,13%	-0,04%	-0,11%	-0,27%	-0,15%	-0,03%	-0,26%	-0,05%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	5.202.369,35	5.079.848,33	5.019.962,42	5.092.614,95	5.214.674,76	5.156.074,28	5.189.532,77	5.147.659,27
Data da Divulgação	05/06/2020	07/05/2020	07/04/2020	06/03/2020	07/02/2020	07/01/2020	06/12/2019	06/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								mai/2020



Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	35,13 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2020	19,16 %
LFT - Venc.: 01/09/2021 (BRSTNCLF1R58)	10,92 %
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	8,86 %
LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	5,89 %
LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	4,97 %
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	2,94 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	1,63 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022 (BRSTNCNTB3Y0)	1,49 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	1,36 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	1,02 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023 (BRSTNCNTB4O9)	0,94 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	0,93 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2035 (BRSTNCNTB0O7)	0,83 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021 (BRSTNCNTB4T8)	0,73 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2020 (BRSTNCNTB3A0)	0,60 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	0,54 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	0,52 %
Lançamentos positivos menores que 0,52%	1,81 %

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															

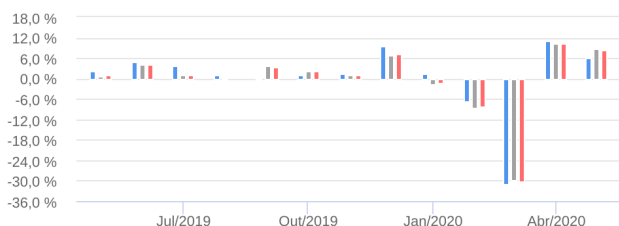
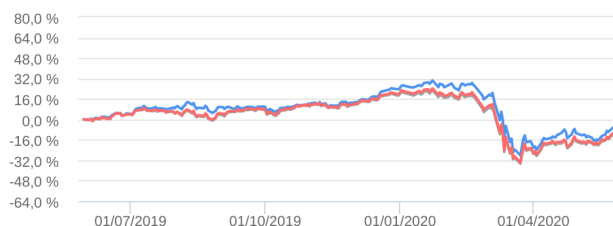
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	113,00	-23,43	-5,39	24,48	55,06	6,10	10,96	-31,06	-6,85	1,27	9,45	1,37	1,20	0,34	0,99	3,84	4,76
Excesso do Ibovespa	59,84	1,00	4,93	8,50	16,89	-2,47	0,71	-1,15	1,58	2,90	2,60	0,43	-1,16	-3,23	1,65	3,00	0,71
CDI	96,68	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	53,16	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	77,92	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	53,92	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

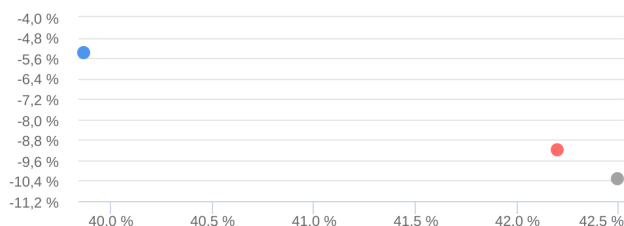
  

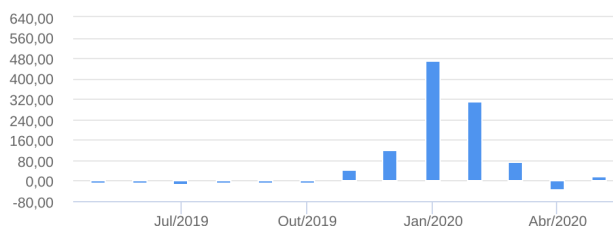
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	21,29986	1.359.288,65	928.817,28	39,87%	-45,09%	18,93%	0,97	8,87%	10,96%	-31,06%	8
Ibovespa	-	-	-	42,50%	-46,82%	20,18%	1,00	0,00%	10,25%	-29,90%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/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.

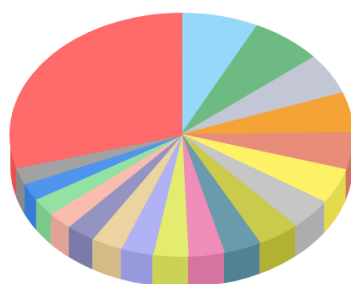
**:: ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	100,09%	99,92%	100,00%	100,13%	100,73%	100,69%	100,23%	100,24%
Valores a receber	0,36%	0,40%	0,83%	0,19%	0,11%	0,36%	0,22%	0,18%
Disponibilidades	0,00%	0,04%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,45%	-0,37%	-0,84%	-0,33%	-0,84%	-1,05%	-0,45%	-0,41%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.359.288,65	1.265.270,02	1.171.296,54	1.592.945,43	1.376.050,19	895.445,37	707.425,05	657.114,26
Data da Divulgação	05/06/2020	07/05/2020	07/04/2020	06/03/2020	07/02/2020	07/01/2020	06/12/2019	06/11/2019

**Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)**

mai/2020



VALE ON N1 - VALE3	7,42 %
TOTVS ON NM - TOTS3	6,85 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	5,53 %
ENERGISA UNT N2 - ENGI11	5,45 %
B3 ON NM - B3SA3	4,97 %
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	4,78 %
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	4,16 %
SUL AMERICA UNT N2 - SULA11	4,10 %
INTERMEDICA ON NM - GNDI3	3,62 %
CARREFOUR BR ON NM - CRFB3	3,45 %
QUALICORP ON NM - QUAL3	3,36 %
GRUPO NATURAON NM - NTCO3	3,09 %
AREZZO CO ON NM - ARZZ3	2,99 %
LOCAMERICA ON NM - LCAM3	2,80 %
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - NTCO3	2,41 %
JBS ON NM - JBSS3	2,38 %
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	2,32 %
ALPARGATAS PN N1 - ALPA4	2,29 %
Lançamentos positivos menores que 2,29%	29,88 %

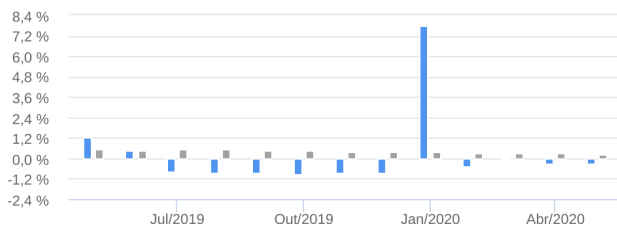
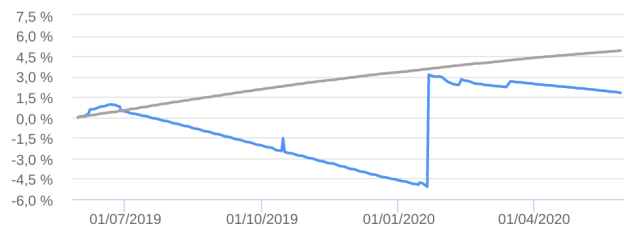
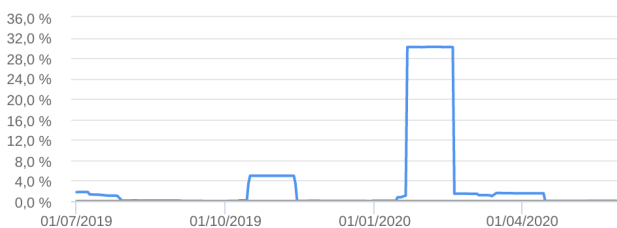
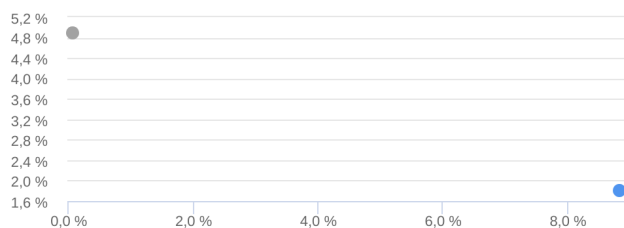
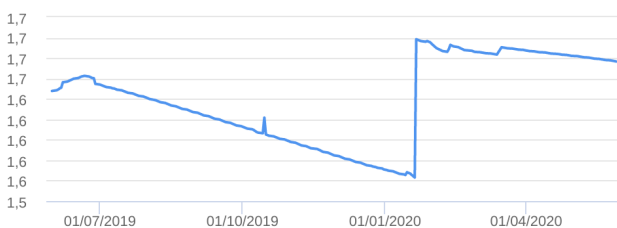
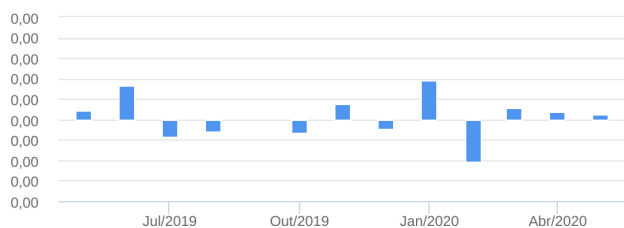
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 12.228.008/0001-99	Aplicação Mínima: R\$ 25.000,00
Gestão: Graphen Investimentos	Aplicação Adicional: Não informado
Administrador: RJI Corretora de Valores	Saldo Mínimo: R\$ 25.000,00
Taxa de Administração: 0,00%	Resgate Mínimo: Não informado
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Multimercados Dinâmico	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 297615	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du
Início do Fundo: 10/01/2011	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-97,11	6,72	1,80	-94,63	-94,07	-0,33	-0,33	0,10	-0,46	7,82	-0,87	-0,86	-0,92	-0,84	-0,86	-0,82	0,42
% do CDI	-72,04	436,98	36,75	-815,33	-462,21	-139,05	-114,75	29,19	-157,55	2.076,20	-231,09	-227,29	-191,80	-182,01	-170,88	-144,14	89,83
CDI	134,80	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	24,63	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	64,50	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	72,89	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	0,02889664	1.676,58	1.640,18	8,84%	-5,98%	4,20%	-3,02	8,84%	7,82%	-0,92%	1
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/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.



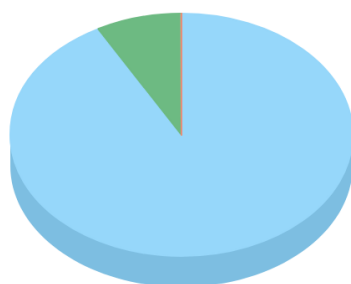
:: LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	109,56%	109,31%	109,07%	108,86%	108,61%	109,05%	108,74%	108,44%
Valores a receber	0,02%	0,04%	0,00%	0,02%	0,04%	0,00%	0,02%	0,04%
Disponibilidades	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%
Valores a pagar	-9,59%	-9,36%	-9,08%	-8,89%	-8,65%	-9,06%	-8,77%	-8,49%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.676,58	1.682,09	1.687,61	1.685,94	1.693,79	1.570,94	1.584,66	1.598,48
Data da Divulgação	05/06/2020	11/05/2020	07/04/2020	03/03/2020	04/02/2020	03/01/2020	10/12/2019	11/11/2019

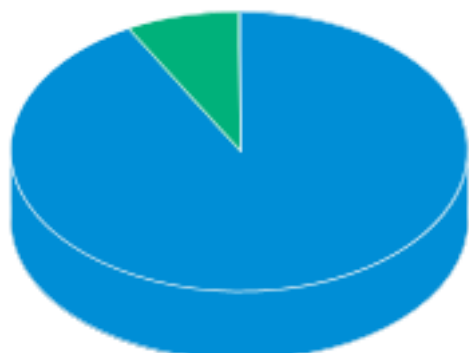
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

mai/2020



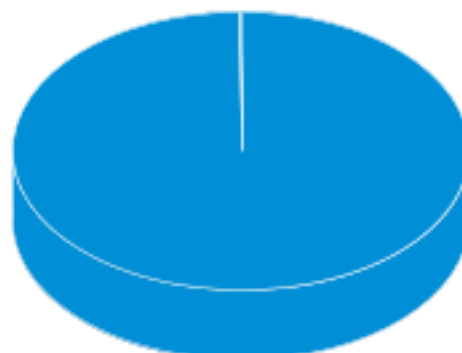
Cotas de PUMA MULTISTRATÉGIA FIP (sem carteira nesta data)	99,97 %
Outros Valores a pagar	8,75 %
Outros Valores a receber	0,02 %
Outras Disponibilidades	0,01 %
Cotas de LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL	0,00 %

Tipo do Ativo



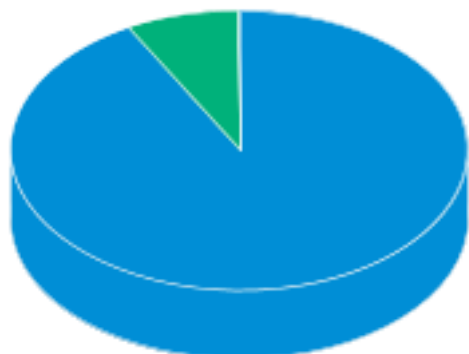
<span style="color: blue;">■</span> Fundos de Investimento	91,93 %
<span style="color: green;">■</span> Valores a pagar/receber	8,07 %

Setor do Ativo



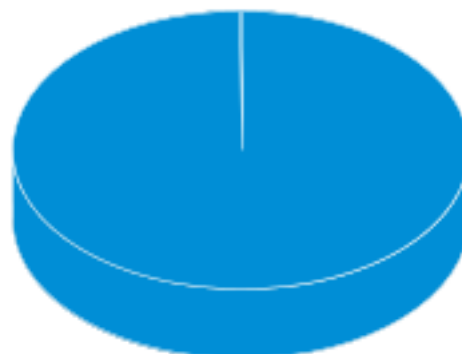
<span style="color: blue;">■</span> Não Classificado	99,98 %
<span style="color: green;">■</span> Outros	0,02 %

Risco do Ativo



<span style="color: blue;">■</span> Risco de mercado imobiliário	91,93 %
<span style="color: green;">■</span> Outros	8,07 %
<span style="color: orange;">■</span> Cotas de fundos	0,00 %

Classe do Ativo



<span style="color: blue;">■</span> Outros	100,00 %
--	----------

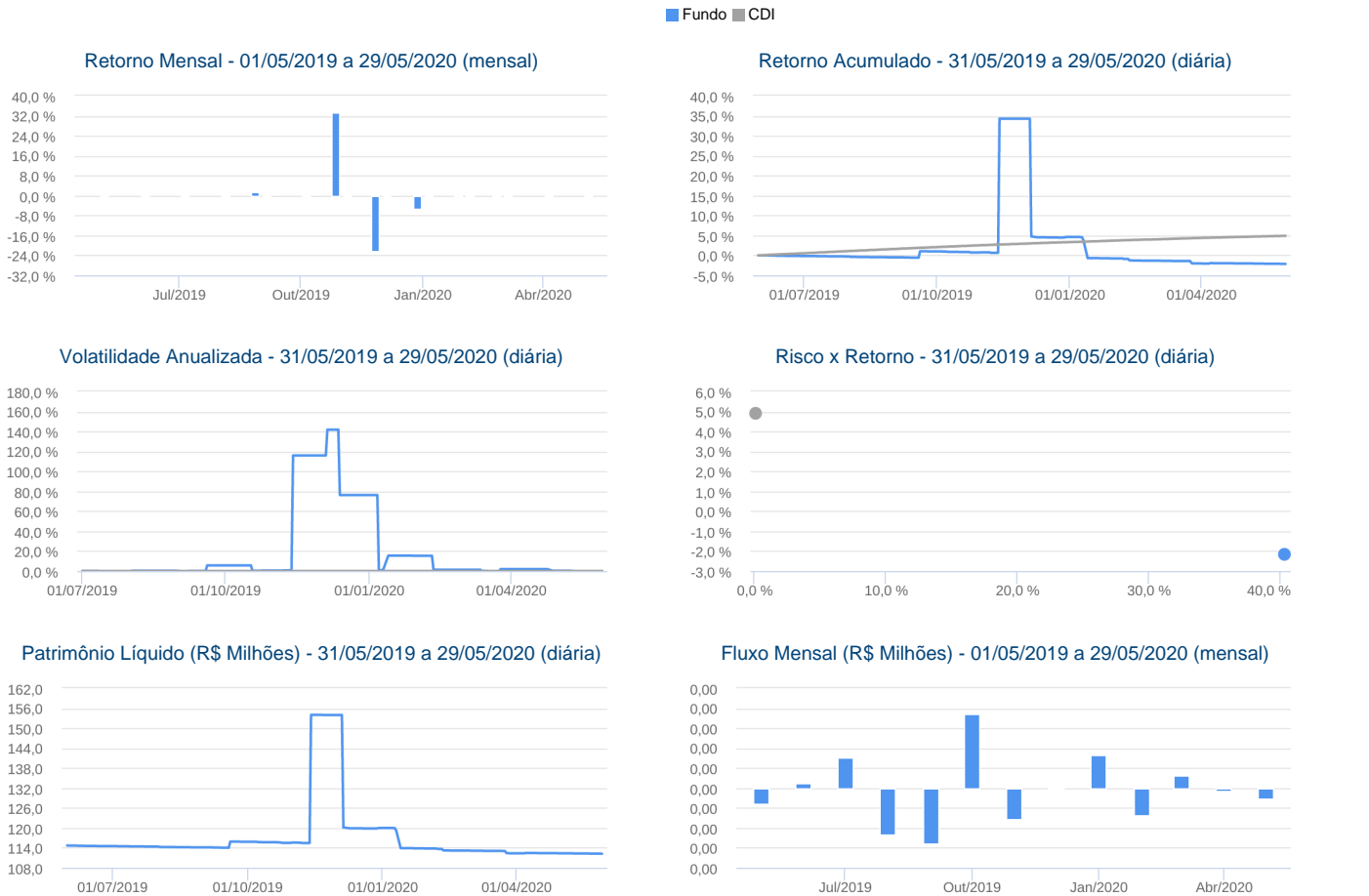
Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Cotas de PUMA MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira nesta data)	1.836,86034	109,5601 %
Outros Valores a receber	0,32351	0,0193 %
Outras Disponibilidades	0,16385	0,0098 %
Cotas de LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL	0,00023	0,0000 %
Outros Valores a pagar	-160,77082	-9,5892 %

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 09.613.226/0001-32	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: 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 du ou D+1081 (isento de taxa de resgate)
Início do Fundo: 19/11/2008	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-31,89	-6,48	-2,16	-3,90	-44,55	-0,14	0,01	-0,70	-0,58	-5,15	-22,08	33,24	-0,23	1,49	-0,20	-0,14	-0,15
% do CDI	-16,96	-420,96	-44,18	-33,63	-218,91	-57,45	4,22	-207,54	-197,57	-1.367,26	-5.891,87	8.739,50	-48,73	322,13	-40,00	-23,89	-32,94
CDI	187,97	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	161,65	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	234,12	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	89,60	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	0,681138	112.205,61	116.908,27	40,39%	-27,14%	19,18%	-21,02	40,39%	33,24%	-22,08%	2
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

Gráficos



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

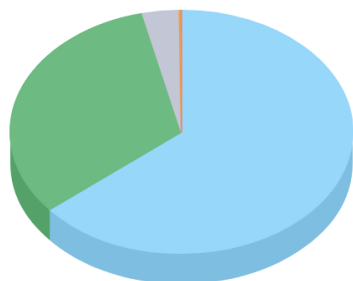
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Valores a receber	181,61%	180,86%	180,38%	179,11%	178,07%	168,91%	131,62%	184,08%
Outras Aplicações	9,83%	9,83%	9,96%	10,07%	10,13%	13,90%	30,07%	10,31%
Títulos de Crédito Privado	0,50%	1,00%	1,51%	1,99%	2,48%	2,82%	2,56%	3,92%
Disponibilidades	0,04%	0,15%	0,01%	0,02%	0,00%	0,01%	0,00%	0,01%
Valores a pagar	-91,98%	-91,84%	-91,86%	-91,19%	-90,69%	-85,64%	-64,26%	-98,33%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	112.205,61	112.357,85	112.344,35	113.138,83	113.799,30	119.977,36	153.968,44	115.554,17
Data da Divulgação	14/07/2020	01/06/2020	01/06/2020	05/03/2020	11/02/2020	07/01/2020	09/12/2019	02/12/2019

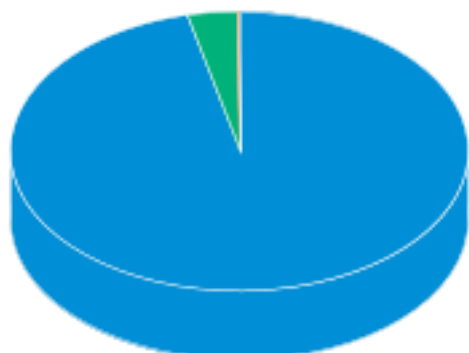
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

mai/2020



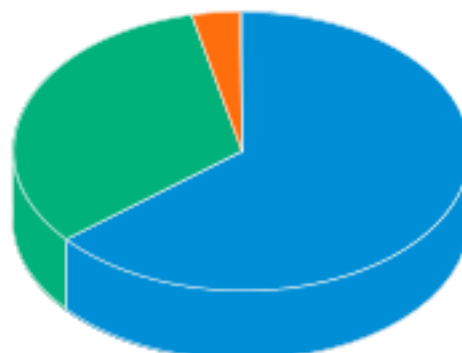
Outros Valores a receber	94,60 %
Outros Valores a pagar	47,91 %
LFT	5,12 %
CCB - REFREX EVAPORADORES DO BRASIL S.A. (05.883.919/0001-94)	0,26 %
- V...	
Outras Disponibilidades	0,02 %

Tipo do Ativo



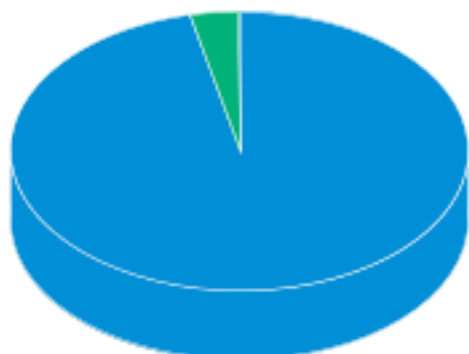
Valores a pagar/receber	96,36 %
Títulos Federais	3,46 %
Títulos Privados	0,18 %

Sector do Ativo



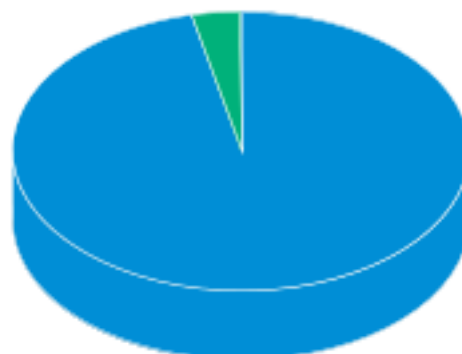
Outros	63,96 %
Não Classificado	32,58 %
Governo Federal	3,46 %

Risco do Ativo



Outros	96,54 %
Rating AAA	3,46 %

Classe do Ativo



Outros	96,54 %
Selic	3,46 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Outros Valores a receber	203.778,82821	181,6120 %
LFT	11.026,85638	9,8274 %
CCB - REFREX EVAPORADORES DO BRASIL S.A. (05.883.919/0001-94) - Venc.: 12/06/2020	563,41323	0,5021 %
Outras Disponibilidades	45,23424	0,0403 %
Outros Valores a pagar	-103.208,71734	-91,9818 %

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 23.896.287/0001-85	Aplicação Mínima: R\$ 0,00
Gestão: 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	

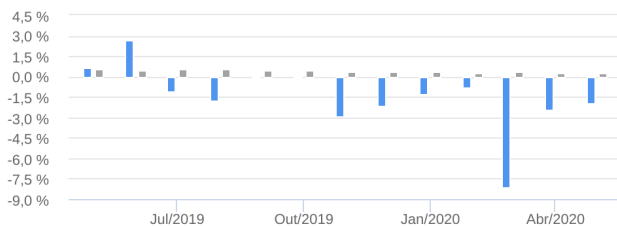
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-18,21	-14,02	-18,85	-31,52	-25,93	-1,98	-2,46	-8,15	-0,81	-1,30	-2,13	-2,91	-0,16	0,06	-1,79	-1,08	2,66
% do CDI	-63,24	-910,90	-385,05	-271,58	-127,41	-839,25	-862,99	-2.407,21	-275,26	-344,31	-569,66	-764,37	-33,10	12,67	-355,86	-189,96	567,79
CDI	28,79	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	36,94	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	40,07	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	18,62	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	0,81790816	33.315,02	39.716,96	14,67%	-23,45%	6,97%	13,51	14,67%	2,66%	-8,15%	1
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

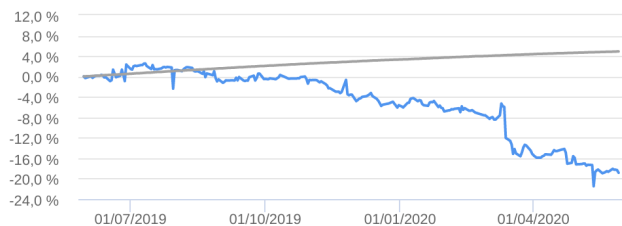
**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)



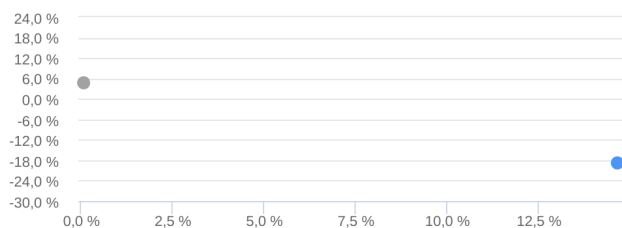
Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)



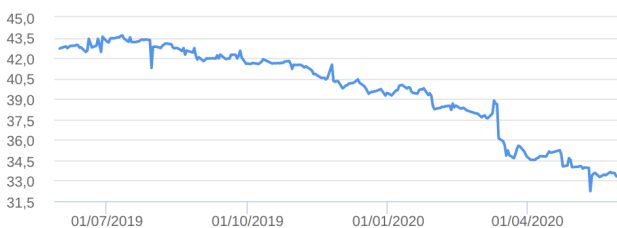
Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)



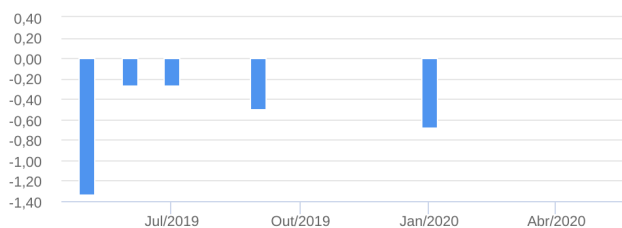
Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)



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

mai/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.

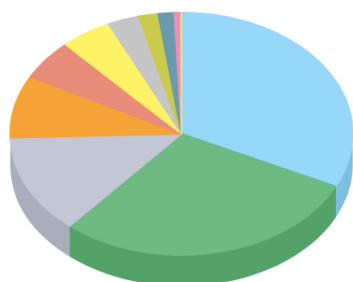
:: PYXIS INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Valores a receber	77,09%	75,57%	73,70%	67,70%	67,17%	65,44%	61,35%	58,76%
Debêntures	32,74%	32,49%	32,28%	30,72%	31,01%	30,55%	30,01%	29,54%
Títulos Públicos	31,66%	31,00%	29,49%	31,37%	31,74%	30,97%	29,27%	29,93%
Títulos de Crédito Privado	19,65%	20,16%	21,60%	22,76%	23,02%	23,75%	25,16%	25,31%
Operações Compromissadas	7,16%	7,20%	7,27%	4,66%	4,84%	5,06%	5,22%	5,15%
Outros valores mobiliários ofertados privadamente	1,46%	1,93%	2,37%	2,62%	3,04%	3,35%	3,66%	3,92%
Disponibilidades	0,11%	0,13%	0,10%	1,53%	0,04%	0,22%	0,08%	0,05%
Valores a pagar	-69,86%	-68,48%	-66,80%	-61,35%	-60,86%	-59,34%	-55,37%	-52,67%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	33.315,02	33.987,64	34.844,43	37.934,28	38.243,48	39.438,81	40.299,00	41.505,79
Data da Divulgação	08/06/2020	07/05/2020	09/04/2020	09/03/2020	10/02/2020	12/02/2020	09/12/2019	27/11/2019

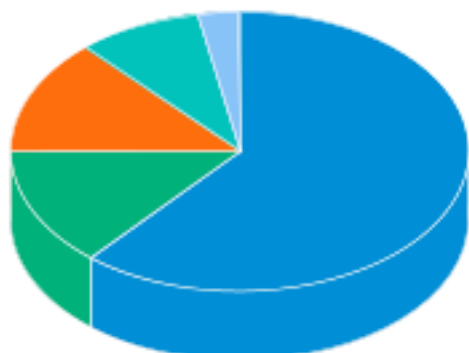
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

mai/2020



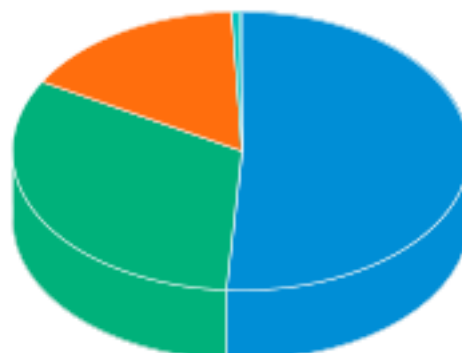
Outros Valores a receber	45,39 %
Outros Valores a pagar	41,13 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	18,64 %
Debênture simples - RIOL11	11,76 %
Debênture simples - PACR11	7,52 %
CCI - FAMÍLIA PAULISTA CRÉDITO IMOBILIÁRIO S.A. (53.146.221/0001-...	6,84 %
...	
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2025	4,21 %
CCI - HABITASEC SECURITIZADORA (09.304.427/0001-58) - Venc.: 31/1...	2,59 %
CCI - DOMUS COMPANHIA HIPOTECARIA (10.372.647/0001-06) - Venc.: ...	2,13 %
3...	
Certificado de Recebível Imobiliário - HABITASEC SECURITIZADORA S...	0,86 %
Outras Disponibilidades	0,06 %

Tipo do Ativo



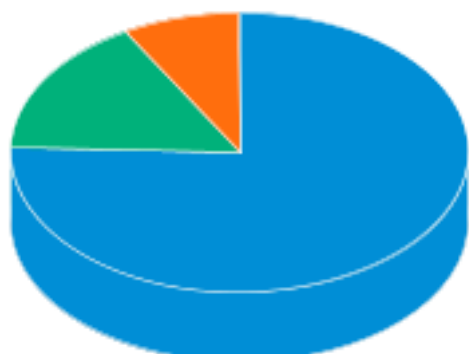
Valores a pagar/receber	61,35 %
Debêntures	13,66 %
Títulos Federais	13,20 %
Títulos Privados	8,81 %
Operação compromissada	2,99 %

Setor do Ativo



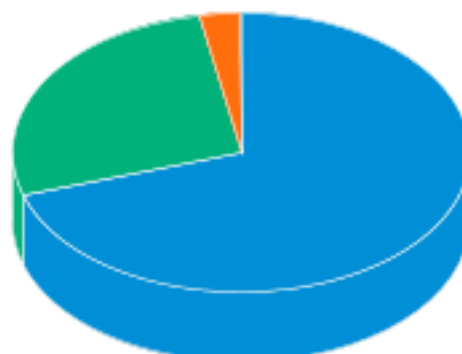
Não Classificado	51,04 %
Outros	32,16 %
Governo Federal	16,19 %
Imobiliário	0,61 %

Risco do Ativo



Outros	75,48 %
Rating AAA	16,19 %
Rating BB	8,33 %

Classe do Ativo



Outros	70,15 %
Inflação	26,86 %
Selic	2,99 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Outros Valores a receber	25.684,19830	77,0919 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	10.546,11907	31,6545 %
Debênture simples - RIOL11	6.654,56892	19,9739 %
Debênture simples - PACR11	4.253,56445	12,7672 %
CCI - FAMÍLIA PAULISTA CRÉDITO IMOBILIÁRIO S.A. (53.146.221/0001-39) - Venc.: 13/01/2022	3.870,27367	11,6167 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2025	2.384,51107	7,1572 %
CCI - HABITASEC SECURITIZADORA (09.304.427/0001-58) - Venc.: 31/12/2022	1.467,46719	4,4046 %
CCI - DOMUS COMPANHIA HIPOTECARIA (10.372.647/0001-06) - Venc.: 31/10/2020	1.207,34695	3,6239 %
Certificado de Recebível Imobiliário - HABITASEC SECURITIZADORA S.A. (09.304.427/0001-58) / 17/08/2020 - Código Cetip: 16H0156564	487,75694	1,4640 %
Outras Disponibilidades	35,11170	0,1054 %
Outros Valores a pagar	-23.274,59026	-69,8594 %

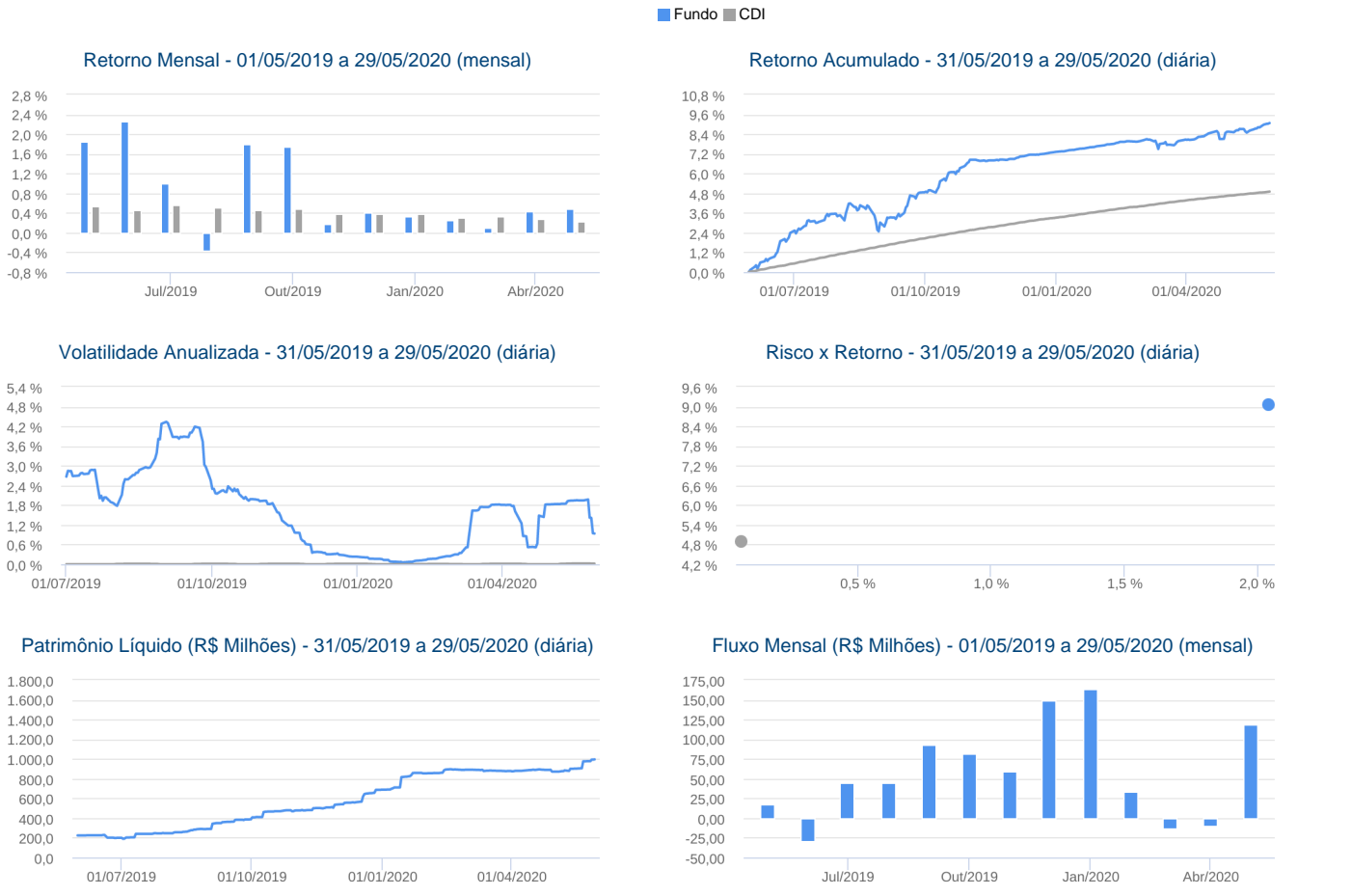


Características	Informações Operacionais
CNPJ: 26.507.132/0001-06	Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00
Gestão: Santander Brasil Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00
Administrador: Banco Santander	Saldo Mínimo: R\$ 10.000,00
Taxa de Administração: 0,40%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração (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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	26,83	1,64	9,07	19,50	26,26	0,48	0,44	0,09	0,27	0,34	0,40	0,19	1,75	1,79	-0,37	0,99	2,25
% do CDI	128,34	106,44	185,26	167,98	129,04	204,94	156,05	27,22	90,55	90,75	107,64	48,88	364,64	385,21	-74,56	174,41	480,92
CDI	20,91	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	31,87	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	34,26	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	18,72	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	12,6832544	994.985,52	574.375,65	2,04%	-1,64%	0,97%	3,35	2,03%	2,25%	-0,37%	7
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**



**Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)** mai/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.

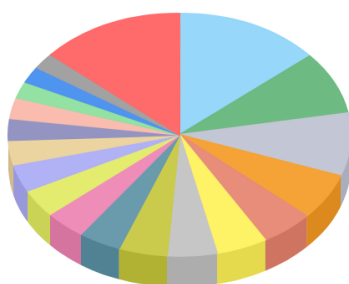
**:: SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	100,05%	100,03%	100,04%	100,08%	100,03%	100,03%	100,06%	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	-0,05%	-0,04%	-0,04%	-0,08%	-0,03%	-0,03%	-0,06%	-0,03%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	994.985,52	871.769,86	877.373,79	889.776,36	853.720,75	687.082,65	536.156,16	476.037,70
Data da Divulgação	09/06/2020	18/05/2020	30/04/2020	06/03/2020	07/02/2020	08/01/2020	06/12/2019	08/11/2019

**Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)**

mai/2020



LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	13,77 %
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	8,38 %
LFT - Venc.: 01/09/2021 (BRSTNCLF1R58)	8,38 %
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	6,18 %
LFT - Venc.: 01/03/2022 (BRSTNCLF1R66)	4,99 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2025	4,82 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2028	4,68 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2023	4,57 %
LFT - Venc.: 01/03/2021 (BRSTNCLF1R41)	4,03 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2027	3,88 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	3,74 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2023	3,66 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2030	3,26 %
LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	2,90 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	2,78 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	2,22 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	2,18 %
LFT - Venc.: 01/09/2020 (BRSTNCLF1R33)	2,12 %
Lançamentos positivos menores que 2,12%	13,54 %

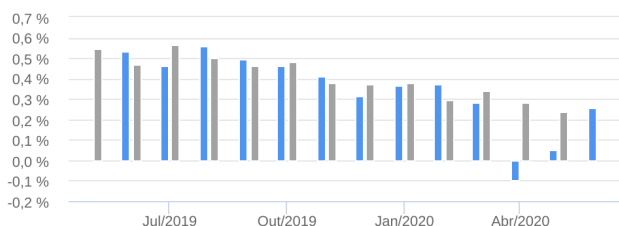
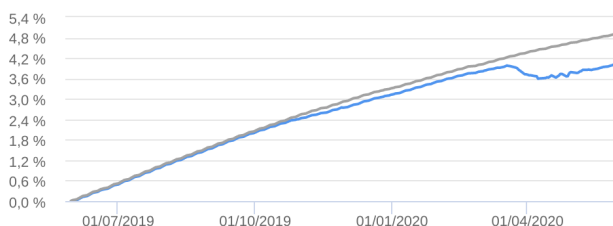
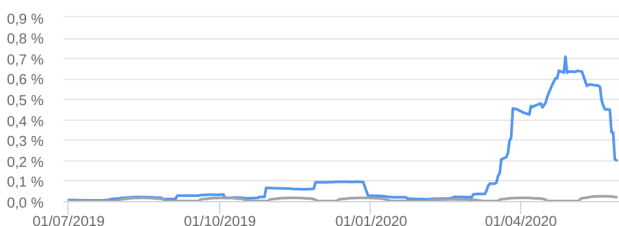
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 02.224.354/0001-45	Aplicação Mínima: R\$ 500.000,00
Gestão: Santander Brasil Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 100,00
Administrador: Banco Santander	Saldo Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração (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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	1.701,16	0,86	4,02	10,67	19,39	0,25	0,05	-0,10	0,28	0,37	0,37	0,31	0,41	0,46	0,49	0,56	0,46
% do CDI	97,18	55,90	82,19	91,92	95,28	107,78	17,49	-29,45	95,12	99,39	98,29	82,71	86,08	99,16	98,56	98,44	98,71
CDI	1.752,86	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	814,83	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	1.837,18	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	436,37	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

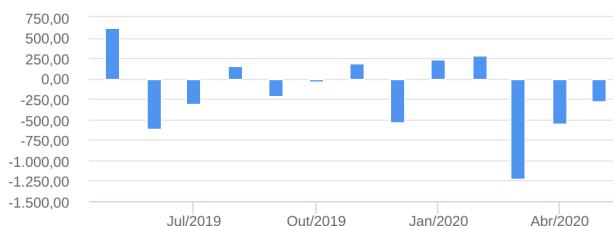
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	184,633759	2.557.300,34	4.333.503,64	0,26%	-0,37%	0,12%	1,49	0,24%	0,56%	-0,10%	1
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/2020

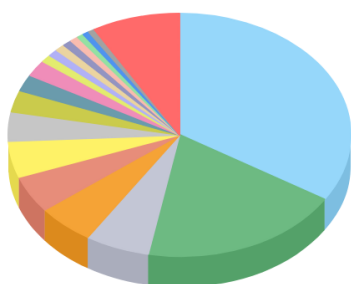
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	100,07%	100,02%	100,03%	100,01%	100,02%	100,02%	100,12%	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	-0,07%	-0,02%	-0,03%	-0,01%	-0,02%	-0,02%	-0,12%	-0,02%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.557.300,34	2.829.946,61	3.385.573,18	4.610.254,17	4.320.739,66	4.076.826,63	4.601.854,40	4.397.786,27
Data da Divulgação	09/06/2020	09/05/2020	30/04/2020	06/03/2020	07/02/2020	08/01/2020	06/12/2019	08/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								mai/2020



LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	33,99 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	19,00 %
Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.111/0001-03) - V...	6,07 %
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc:...	5,43 %
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Ven...	4,93 %
Letra Financeira - BANCO ITAÚ S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc.: ...	4,82 %
Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (90.400.888/0001...	3,93 %
Letra Financeira - BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (90.400.888/0001-4...	2,89 %
Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Ven...	2,19 %
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc...	2,18 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	1,01 %
Letra Financeira - BANCO RCI BRASIL S.A. (62.307.848/0001-15) - V...	0,95 %
Debênture simples - GUAR11	0,94 %
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/0001-23...	0,85 %
Debênture simples - ELET12	0,81 %
Debênture simples - LAMEA1	0,63 %
Debênture simples - SSED11	0,62 %
Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note - COMPANHIA BRASI...	0,61 %
Lançamentos positivos menores que 0,61%	8,27 %

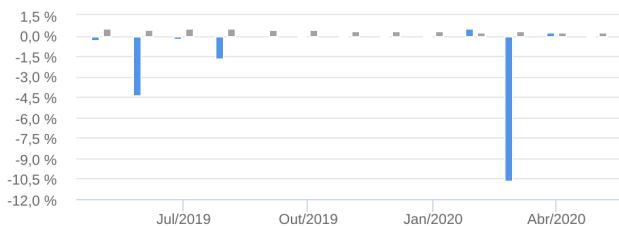
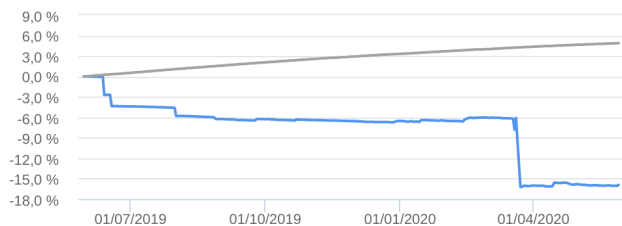
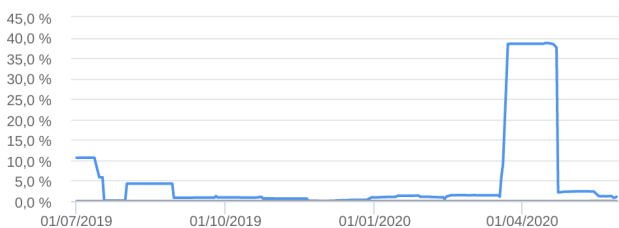
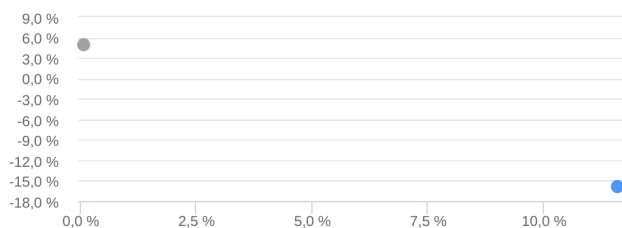
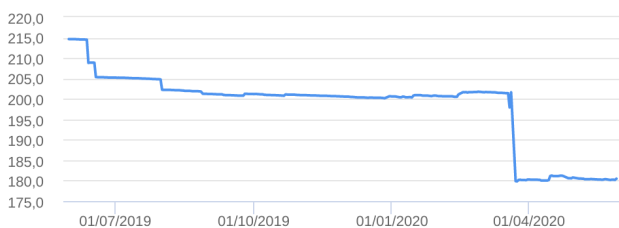
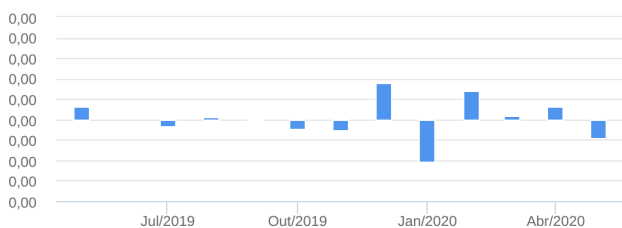
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 14.655.180/0001-54	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: Queluz Gestão de Recursos	Aplicação Adicional: Não informado
Administrador: RJI Corretora de Valores	Saldo Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração: 1,50%	Resgate Mínimo: Não informado
Taxa 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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-	-10,04	-15,93	-	-	-0,16	0,27	-10,64	0,51	0,04	0,02	-0,18	-0,12	-0,02	-1,73	-0,21	-4,40
% do CDI	-	-652,62	-325,26	-	-	-67,91	96,10	-3.144,82	174,53	11,50	5,00	-48,27	-25,50	-3,25	-344,26	-37,62	-937,91
CDI	100,12	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	52,65	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	78,36	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	57,38	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	1.177.49064531	180.467,79	198.247,17	11,61%	-16,23%	5,51%	2,10	11,61%	0,51%	-10,64%	1
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

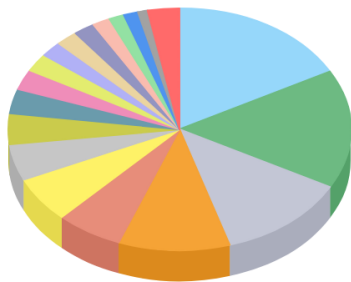
mai/2020

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**

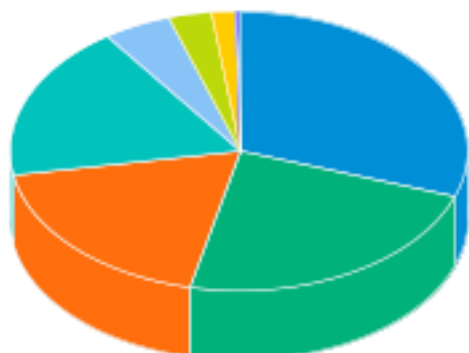
29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	33,80%	33,78%	34,03%	40,91%	40,77%	40,88%	40,95%	40,93%
Títulos de Crédito Privado	21,27%	21,24%	21,29%	19,03%	19,13%	19,13%	19,14%	26,01%
Debêntures	18,83%	18,80%	18,85%	16,91%	17,00%	17,14%	17,15%	17,13%
Valores a receber	15,62%	15,59%	12,99%	11,60%	11,45%	11,17%	11,17%	11,15%
Títulos ligados ao agronegócio	4,86%	4,85%	4,90%	4,42%	4,47%	4,51%	4,55%	4,58%
Outros valores mobiliários ofertados privadamente	2,03%	2,03%	2,03%	1,82%	1,83%	1,83%	1,83%	-
Títulos Públicos	1,74%	1,73%	1,73%	1,54%	1,54%	1,54%	1,53%	1,52%
Operações Compromissadas	0,30%	0,43%	0,56%	0,52%	0,56%	0,54%	0,41%	0,52%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-2,03%	-2,02%	-2,05%	-1,82%	-1,85%	-1,84%	-1,84%	-1,85%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	180.467,79	180.757,25	180.263,65	201.729,96	200.701,08	200.614,22	200.576,65	200.945,60
Data da Divulgação	08/06/2020	07/05/2020	02/04/2020	04/03/2020	06/02/2020	08/01/2020	10/12/2019	12/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								mai/2020



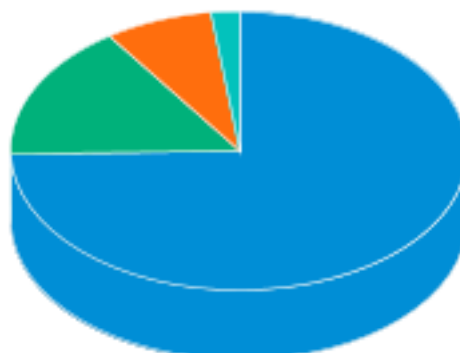
CCI - DOMUS COMPANHIA HIPOTECARIA (10.372.647/0001-06) - Venc.: 3...	17,42 %
Outros Valores a receber	16,19 %
Cotas de CAM AGRO EFICIÊNCIA AMBIENTAL MULTIESTRATÉGIA FIP (sem c...	12,60 %
Debênture simples - ANOB11	10,76 %
Debênture simples - CSPE11	6,41 %
Cotas de CAM VANGUARDA IMOBILIÁRIO MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira...	6,24 %
Certificado de Recebível do Agronegócio - REDENÇÃO FRIGORIFICO DO...	4,94 %
CCI - DOMUS COMPANHIA HIPOTECARIA (10.372.647/0001-06) - Venc.: 2...	4,18 %
Cotas de SÃO DOMINGOS FII - FISD11 (sem carteira nesta data)	3,34 %
Cotas de CAM THRONE IMOBILIÁRIO MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira...	2,77 %
Cotas de CAM VERA CRUZ IMOBILIÁRIO FIP (sem carteira nesta data)	2,47 %
Outros Valores a pagar	2,10 %
Ações / COEI3 / CNPJ do emissor: 23.877.260/0001-45 / Denominação...	2,08 %
Certificado de Recebível Imobiliário - BSI CAPITAL SECURITIZADORA...	2,06 %
Cotas de AQ3 RENDA FII - ARFI11B (sem carteira nesta data)	1,71 %
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	1,46 %
Debênture simples - RIOL11	1,39 %
Ações / ORFAPE / CNPJ do emissor: 28.794.331/0001-60 / Denominaçã...	0,94 %
Lançamentos positivos menores que 0,94%	3,04 %

Tipo do Ativo



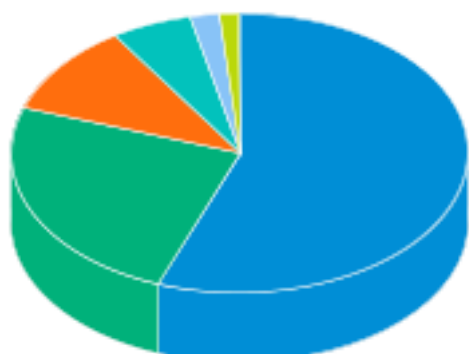
Fundos de Investimento	30,36 %
Títulos Privados	23,17 %
Debêntures	18,72 %
Valores a pagar/receber	17,92 %
Títulos ligados ao Agronegócio	4,83 %
Outros	2,96 %
Títulos Federais	1,73 %
Operação compromissada	0,30 %

Setor do Ativo



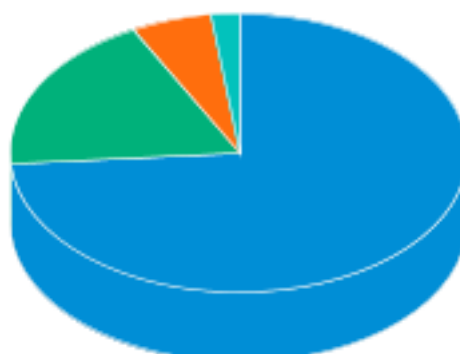
Não Classificado	74,56 %
Outros	15,86 %
Imobiliário	7,56 %
Governo Federal	2,02 %

Risco do Ativo



Outros	55,71 %
Risco de mercado imobiliário	24,57 %
Rating D	10,53 %
Cotas de fundos	5,79 %
Rating AAA	2,02 %
Rating BB	1,36 %

Classe do Ativo



Outros	73,72 %
Inflação	18,72 %
Imóveis	5,54 %
Selic	2,02 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
CCI - DOMUS COMPANHIA HIPOTECARIA (10.372.647/0001-06) - Venc.: 30/09/2021	30.957,27340	17,7902 %
Outros Valores a receber	28.781,86762	16,5401 %
Cotas de CAM AGRO EFICIÊNCIA AMBIENTAL MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira nesta data)	22.387,90798	12,8657 %
Debênture simples - ANOB11	19.116,60893	10,9857 %
Debênture simples - CSPE11	11.385,80832	6,5431 %
Cotas de CAM VANGUARDA IMOBILIÁRIO MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira nesta data)	11.096,58360	6,3769 %

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
Certificado de Recebível do Agronegócio - REDENÇÃO FRIGORIFICO DO PARA (01.227.165/0001-63) - Venc.: 24/04/2022	8.774,34340	5,0424 %
CCI - DOMUS COMPANHIA HIPOTECARIA (10.372.647/0001-06) - Venc.: 22/04/2025	7.429,52962	4,2695 %
Cotas de SÃO DOMINGOS FII - FISD11 (sem carteira nesta data)	5.941,83625	3,4146 %
Cotas de CAM THRONE IMOBILIÁRIO MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira nesta data)	4.925,66332	2,8306 %
Cotas de CAM VERA CRUZ IMOBILIÁRIO FIP (sem carteira nesta data)	4.390,22851	2,5229 %
Ações / COE13 / CNPJ do emissor: 23.877.260/0001-45 / Denominação Social do emissor: COROAMENTO EMPREENDIMENTOS IMOBILIÁRIOS S.A.	3.701,78884	2,1273 %
Certificado de Recebível Imobiliário - BSI CAPITAL SECURITIZADORA S.A. (11.257.352/0001-43) / 18/05/2021	3.666,25007	2,1069 %
Cotas de AQ3 RENDA FII - ARFI11B (sem carteira nesta data)	3.032,05876	1,7424 %
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	2.599,98097	1,4941 %
Debênture simples - RIOL11	2.477,05482	1,4235 %
Ações / ORFAPE / CNPJ do emissor: 28.794.331/0001-60 / Denominação Social do emissor: ORFAPE INVESTIMENTOS LTDA	1.676,71100	0,9636 %
Cotas de BRAZIL REALTY FII - BZLI11 (sem carteira nesta data)	1.078,99145	0,6201 %
Cotas de GESTÃO EMPRESARIAL MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira nesta data)	1.007,77171	0,5791 %
Debênture simples - PACR11	994,69998	0,5716 %
Cotas de LSH MULTIESTRATÉGIA FIP (sem carteira nesta data)	789,20230	0,4535 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2020	542,12989	0,3115 %
LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	531,17982	0,3053 %
Cotas de OSLO FI MULTIMERCADO (sem carteira nesta data)	455,84008	0,2620 %
Outras Disponibilidades	4,78970	0,0028 %
Outros Valores a pagar	-3.733,20825	-2,1454 %

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

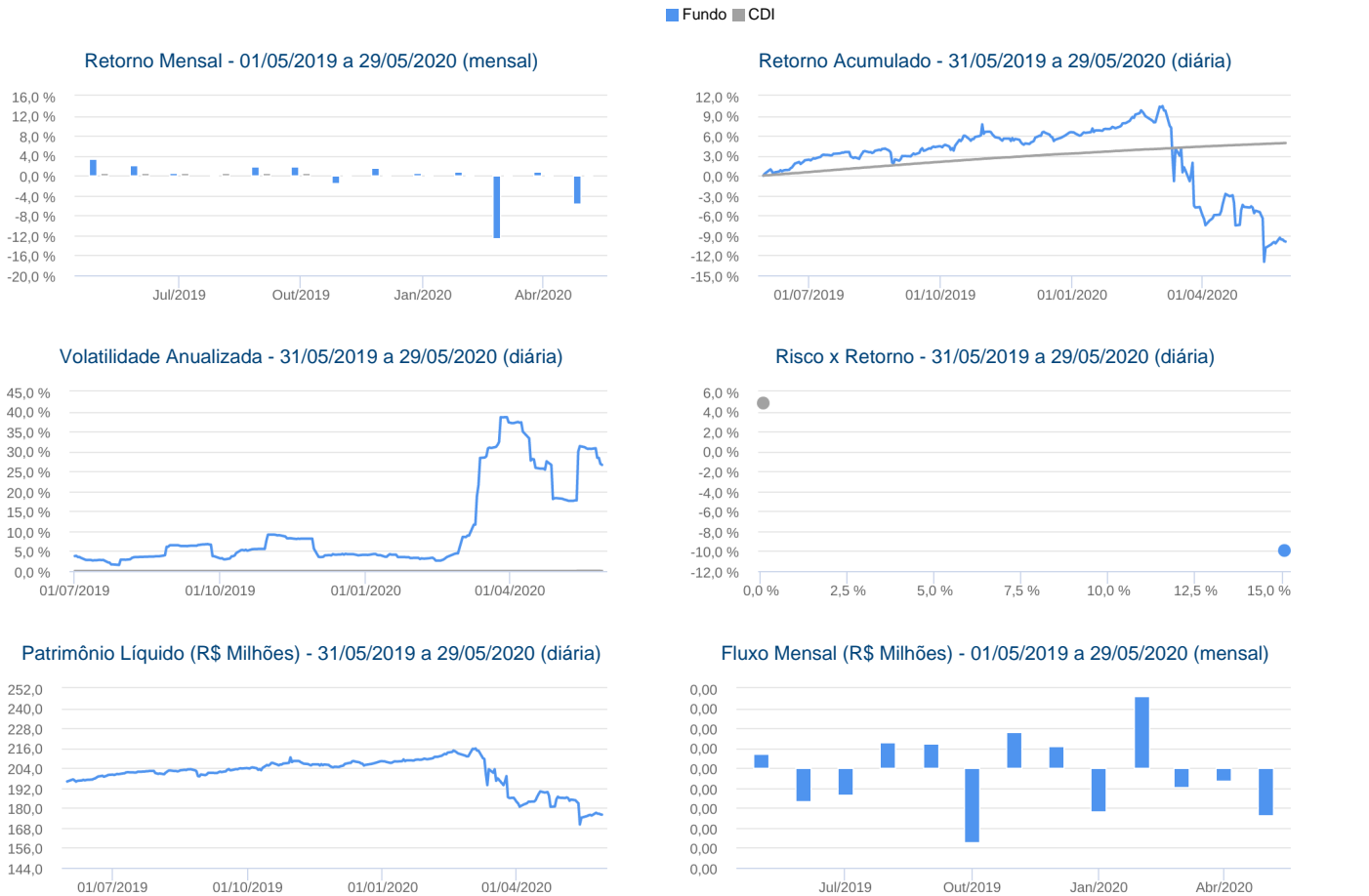


Características	Informações Operacionais
CNPJ: 13.594.673/0001-69	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: Veritas Capital Management	Aplicação Adicional: R\$ 100.000,00
Administrador: RJI Corretora de Valores	Saldo Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração: 0,80%	Resgate Mínimo: R\$ 100.000,00
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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	34,43	-15,45	-9,93	-9,70	-2,73	-5,47	0,72	-12,42	0,85	0,55	1,62	-1,36	1,79	1,92	-0,31	0,45	2,01
% do CDI	30,40	-1.004,36	-202,81	-83,55	-13,41	-2.321,72	251,12	-3.671,52	290,12	145,32	433,02	-357,20	373,84	414,31	-61,77	78,47	428,96
CDI	113,27	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	58,99	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	96,83	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	64,89	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	1,34433898	175.940,86	200.609,53	15,09%	-21,20%	7,16%	19,19	15,08%	2,01%	-12,42%	7
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

Gráficos



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

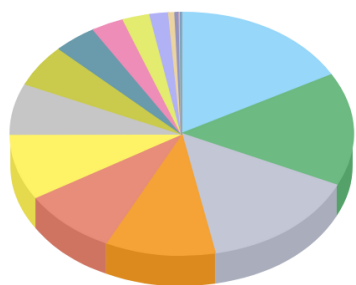
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Outros valores mobiliários ofertados privadamente	27,09%	25,43%	25,85%	20,91%	20,54%	19,90%	19,60%	-
Cotas de Fundos	26,92%	25,56%	25,45%	31,99%	32,37%	32,80%	42,37%	43,04%
Títulos Públicos	18,55%	31,66%	31,12%	25,60%	25,80%	14,13%	13,88%	14,65%
Valores a receber	15,87%	6,85%	6,90%	6,30%	6,01%	6,05%	6,15%	6,06%
Debêntures	12,06%	11,49%	11,59%	10,47%	10,88%	11,18%	11,60%	11,74%
Operações Compromissadas	2,73%	2,05%	2,17%	7,42%	7,11%	18,67%	9,18%	8,41%
Disponibilidades	0,04%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-3,26%	-3,05%	-3,07%	-2,69%	-2,72%	-2,73%	-2,78%	-2,75%
Títulos de Crédito Privado	-	-	-	-	-	-	-	18,84%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	175.940,86	186.131,15	184.808,85	211.025,21	209.242,14	208.103,17	204.780,55	207.601,30
Data da Divulgação	09/06/2020	08/05/2020	06/04/2020	07/03/2020	07/02/2020	10/01/2020	10/12/2019	12/11/2019

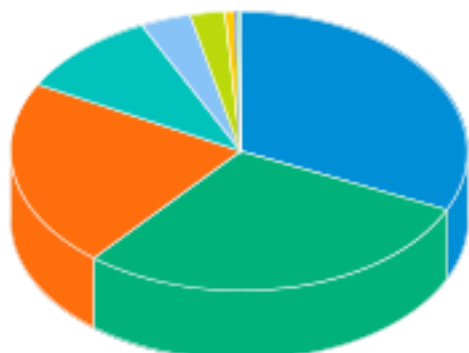
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

mai/2020



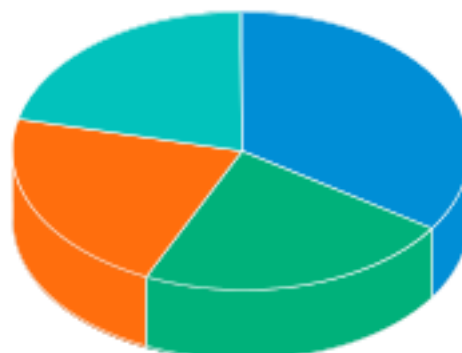
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	18,03 %
Certificado de Recebível Imobiliário - REIT SECURITIZADORA RECEBI...	16,02 %
Outros Valores a receber	15,87 %
Certificado de Recebível Imobiliário - HABITASEC SECURITIZADORA S...	11,07 %
Debênture simples - SGOI11	9,56 %
Cotas de MZL IMA-B FI RENDA FIXA	9,30 %
Cotas de UM INVESTIMENTOS ALOCAÇÃO MACRO FI RENDA FIXA	7,24 %
Cotas de ILLUMINATI FIDC	5,98 %
Cotas de UM INVESTIMENTOS ALOCAÇÃO MACRO II FI RENDA FIXA	4,33 %
Outros Valores a pagar	-3,26 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2020	2,73 %
Debêntures - VENTURE CAPITAL PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	1,88 %
S.A. (...)	
Debênture simples - LSHB14	0,62 %
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	0,43 %
Cotas de HUNGRIA FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,08 %
LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	0,06 %
Outras Disponibilidades	0,04 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	0,03 %

Tipo do Ativo



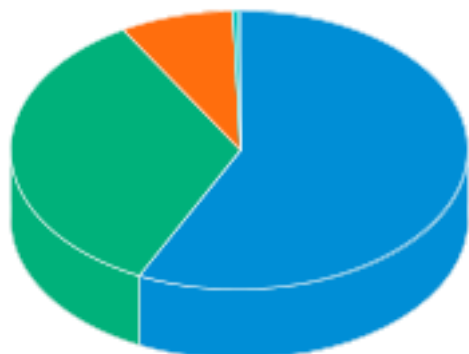
Títulos Federais	31,81 %
Valores a pagar/receber	29,22 %
Títulos Privados	21,85 %
Debêntures	10,11 %
Outros	3,58 %
Operação compromissada	2,49 %
Nota Promissória	0,63 %
Direito Creditório	0,20 %
Fundos de Investimento	0,12 %

Setor do Ativo



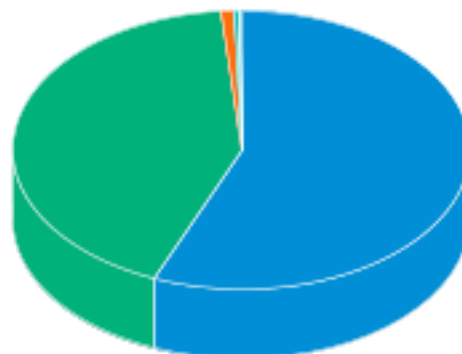
Governo Federal	34,30 %
Não Classificado	22,58 %
Imobiliário	21,85 %
Outros	21,28 %

Risco do Ativo



Outros	57,22 %
Rating AAA	34,30 %
Rating A	7,98 %
Rating BBB	0,50 %

Classe do Ativo



Outros	56,30 %
Inflação	42,25 %
Selic	0,94 %
CDI	0,50 %
Prefixado	0,01 %
Sem indexador	0,00 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	65.814,82110	37,4075 %
Outros Valores a receber	42.553,10061	24,1861 %
Certificado de Recebível Imobiliário - REIT SECURITIZADORA RECEBIVEIS IMOBILIARIOS S.A. (13.349.677/0001-81) / 27/01/2022 - Código Cetip: 17A0908726	28.189,99653	16,0225 %
Certificado de Recebível Imobiliário - HABITASEC SECURITIZADORA S.A. (09.304.427/0001-58) / 17/08/2020 - Código Cetip: 16H0156564	19.476,00000	11,0697 %

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 colistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do colista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. 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
Debênture simples - SGO11	17.416,45167	9,8991 %
Outros Ativos Financeiros de Renda Fixa	7.807,57718	4,4376 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2020	4.807,42643	2,7324 %
Debêntures - VENTURE CAPITAL PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A. (24.241.659/0001-06) - Venc.: 18/08/2022	3.553,41780	2,0197 %
Títulos Públicos Federais	1.543,53595	0,8773 %
Notas Promissórias Comerciais	1.379,72148	0,7842 %
Debênture simples - LSHB14	1.087,14455	0,6179 %
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	1.036,30537	0,5890 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2023	601,19174	0,3417 %
Direitos Creditórios	326,86494	0,1858 %
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	262,43717	0,1492 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	258,55180	0,1470 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	168,86514	0,0960 %
LFT - Venc.: 01/03/2021 (BRSTNCLF1R41)	120,83842	0,0687 %
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	120,28714	0,0684 %
LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	115,98773	0,0659 %
Direitos Creditórios - Direitos	114,99532	0,0654 %
Outras Disponibilidades	65,58154	0,0373 %
LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	52,09398	0,0296 %
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	51,53181	0,0293 %
LFT - Venc.: 01/09/2021 (BRSTNCLF1R58)	49,64158	0,0282 %
LFT - Venc.: 01/03/2022 (BRSTNCLF1R66)	48,06559	0,0273 %
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	24,49523	0,0139 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	17,89193	0,0102 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2022	1,96443	0,0011 %
LFT - Venc.: 01/09/2020 (BRSTNCLF1R33)	1,22921	0,0007 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2045	0,20149	0,0001 %
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,02024	0,0000 %
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	0,00057	0,0000 %
Valores a pagar / Taxa de Fiscalização CVM	-0,05875	0,0000 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	-0,06032	0,0000 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,18754	-0,0001 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-0,46525	-0,0003 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-802,35256	-0,4560 %
Outros Valores a pagar	-20.324,74313	-11,5521 %

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).

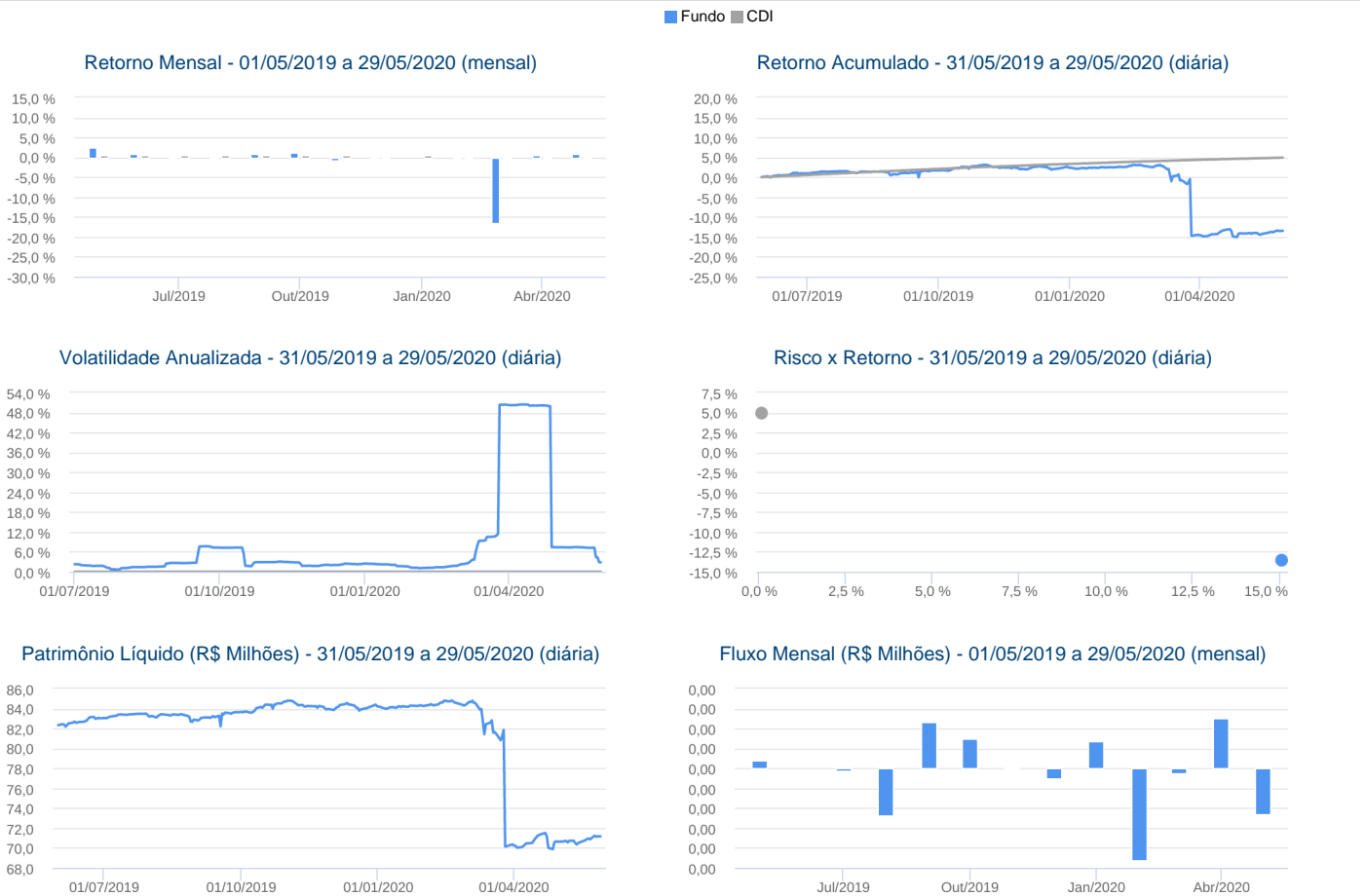
Fonte: Quantum

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-11,65	-15,52	-13,49	-18,12	-18,01	0,76	0,40	-16,59	0,09	0,03	0,35	-0,91	1,27	0,91	-0,37	0,22	0,83
% do CDI	-29,89	-1.008,57	-275,56	-156,15	-88,48	322,48	139,92	-4.901,61	29,37	7,44	93,26	-238,05	265,10	195,50	-73,49	38,99	176,49
CDI	38,97	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	74,61	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	78,64	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	22,81	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	1,1687048	71.162,05	81.400,47	15,09%	-17,61%	7,16%	13,47	15,08%	1,27%	-16,59%	5
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**



**Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) mai/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.

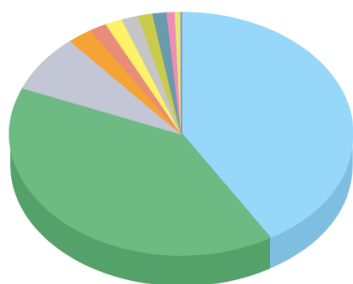
**:: TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA**

29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Valores a receber	193,96%	195,44%	196,22%	163,67%	163,81%	163,86%	164,43%	162,94%
Cotas de Fundos	63,30%	63,03%	62,78%	68,84%	68,77%	68,71%	68,60%	68,87%
Debêntures	9,53%	9,60%	9,64%	8,04%	8,05%	8,05%	8,08%	8,01%
Títulos Públicos	7,48%	7,66%	7,69%	6,46%	6,44%	6,42%	6,38%	6,47%
Operações Compromissadas	6,52%	6,44%	6,20%	5,55%	5,62%	5,69%	5,76%	5,59%
Disponibilidades	0,01%	0,00%	0,39%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%
Valores a pagar	-180,80%	-182,17%	-182,92%	-152,57%	-152,71%	-152,73%	-153,27%	-151,89%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	71.162,05	70.625,00	70.344,55	84.331,39	84.258,70	84.235,08	83.941,74	84.708,78
Data da Divulgação	08/06/2020	07/05/2020	02/04/2020	04/03/2020	04/02/2020	08/01/2020	09/12/2019	08/11/2019

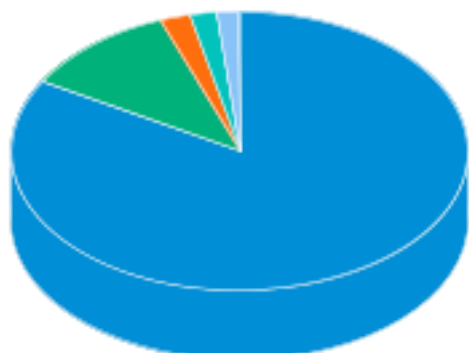
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

ago/2020



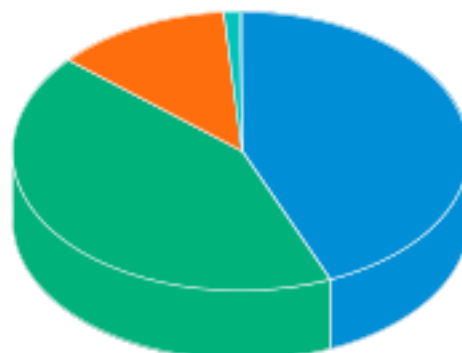
Outros Valores a receber	203,47 %
Outros Valores a pagar	-195,93 %
Cotas de ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	37,56 %
Cotas de UM INVESTIMENTOS FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	11,72 %
LFT - Venc.: 01/03/2025	7,82 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	7,82 %
LFT - Venc.: 01/09/2023	7,75 %
LFT - Venc.: 01/03/2024	6,77 %
LFT - Venc.: 01/03/2026	6,48 %
Debêntures - LSHB14 - LSH BARRA EMPREENDIMENTOS	3,77 %
IMOBILIÁRIOS S.A....	
Cotas de ÁTICO IMOBILIÁRIOS FIDC	2,59 %
LFT - Venc.: 01/03/2023	0,17 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2021	0,02 %
Outras Disponibilidades	0,00 %

Tipo do Ativo



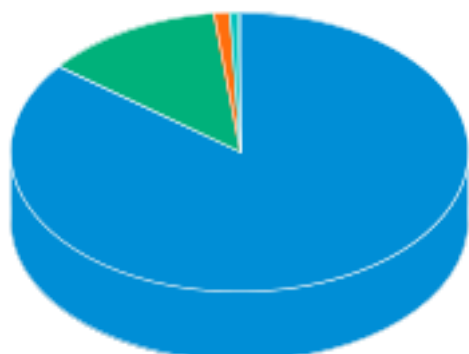
Valores a pagar/receber	83,44 %
Títulos Federais	10,87 %
Títulos Privados	2,22 %
Debêntures	1,86 %
Operação compromissada	1,61 %
Direito Creditório	0,00 %

Setor do Ativo



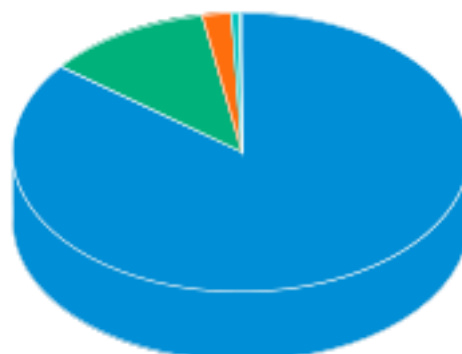
Não Classificado	43,64 %
Outros	42,73 %
Governo Federal	12,47 %
Energia	1,16 %

Risco do Ativo



Outros	85,67 %
Rating AAA	12,47 %
Rating A	1,16 %
Rating BBB	0,70 %

Classe do Ativo



Outros	85,66 %
Inflação	11,56 %
Selic	2,07 %
CDI	0,70 %
Prefixado	0,01 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Outros Valores a receber	155.670,76360	218,7553 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023 (BRSTNCNTB4O9)	24.017,70455	33,7507 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	8.558,58681	12,0269 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021 (BRSTNCNTB4T8)	5.202,96179	7,3114 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2021	4.642,12654	6,5233 %
CCI - COPEG - CRE (11.920.641/0001-80) - Venc.: 01/01/2027	4.256,03418	5,9808 %
Debênture simples - CMTR26	4.224,41989	5,9363 %
CCI - MTTG EMPREENDIMENTOS E PARTICIPAÇÕES LTDA. (09.613.866/0001-42) - Venc.: 01/01/2027	3.835,04250	5,3892 %
Debênture simples - LSHB14	2.556,91822	3,5931 %

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 colistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do colista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. 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
Outros Ativos - Curto Prazo (em até 12 meses)	1.736,62844	2,4404 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2020	1.058,79175	1,4879 %
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	983,07538	1,3815 %
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	574,21426	0,8069 %
LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	127,33130	0,1789 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2023	126,83987	0,1782 %
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	55,14124	0,0775 %
Operações Compromissadas	29,26854	0,0411 %
LFT - Venc.: 01/03/2021 (BRSTNCLF1R41)	25,49458	0,0358 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	24,41826	0,0343 %
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	10,73632	0,0151 %
LFT - Venc.: 01/09/2021 (BRSTNCLF1R58)	10,47184	0,0147 %
LFT - Venc.: 01/03/2022 (BRSTNCLF1R66)	10,14091	0,0143 %
Outras Disponibilidades	8,49524	0,0119 %
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	4,99227	0,0070 %
LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	2,01628	0,0028 %
LFT - Venc.: 01/09/2020 (BRSTNCLF1R33)	0,25934	0,0004 %
Direitos Creditórios - Crédito Imobiliário	0,00000	0,0000 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-3,64268	-0,0051 %
Outros Valores a pagar	-146.587,17672	-205,9906 %

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



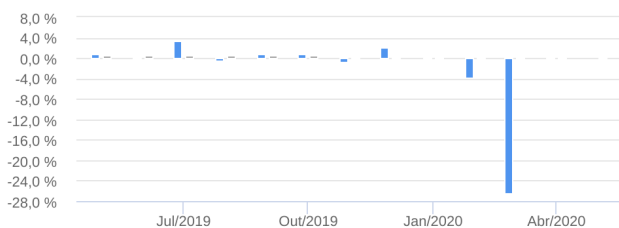
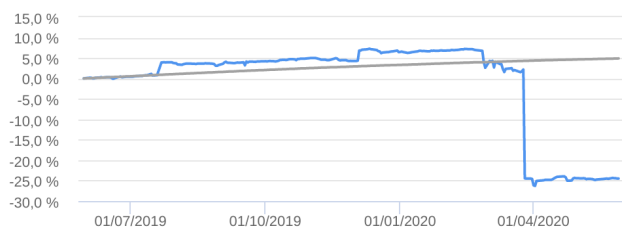
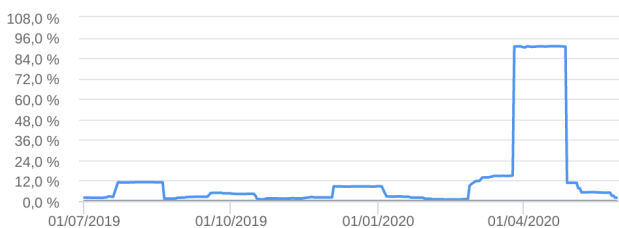
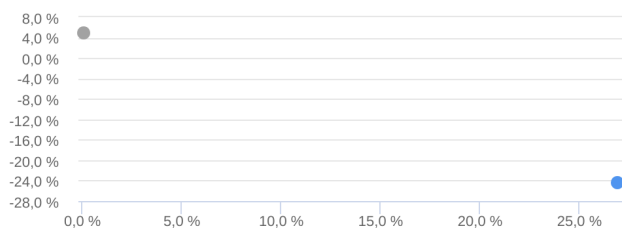
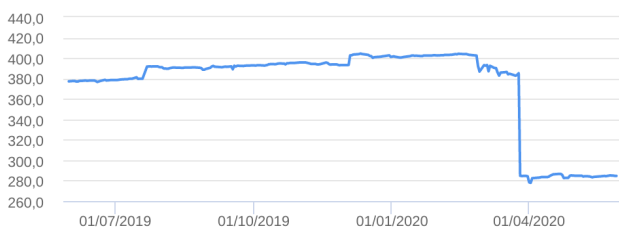
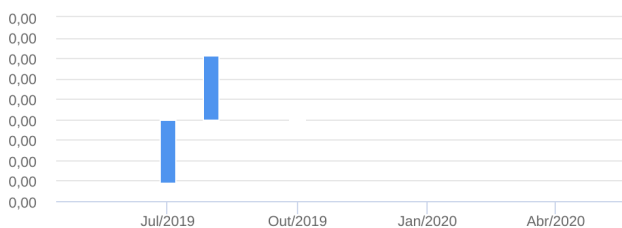
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 12.845.801/0001-37	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: Plural	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: RJI Corretora de Valores	Saldo Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração: 0,75%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 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	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-5,69	-29,05	-24,49	-35,79	-36,75	-0,10	0,23	-26,51	-3,91	0,34	2,06	-0,64	0,73	0,90	-0,44	3,31	0,34
% do CDI	-5,04	-1.887,98	-500,19	-308,32	-180,58	-41,09	80,37	-7.833,65	-1.332,39	89,32	549,56	-169,38	151,31	193,64	-88,09	583,77	72,21
CDI	112,82	1,54	4,90	11,61	20,35	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	53,68	-24,42	-10,32	15,99	38,17	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	90,12	-24,19	-9,21	19,03	40,62	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	64,68	2,79	6,53	14,80	19,28	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

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	0,94309397	284.581,78	373.438,18	26,97%	-31,29%	12,81%	33,62	26,96%	3,31%	-26,51%	4
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

**Retorno Mensal - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

**Retorno Acumulado - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Volatilidade Anualizada - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Risco x Retorno - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2019 a 29/05/2020 (diária)**

**Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/05/2019 a 29/05/2020 (mensal)**

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

mai/2020

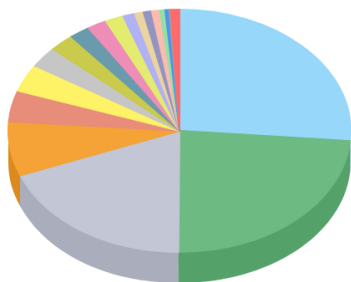
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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**

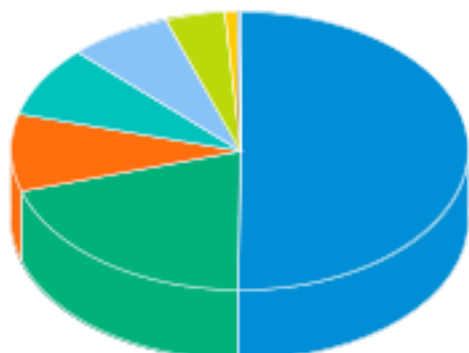
29/05/2020

Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Cotas de Fundos	68,57%	68,57%	68,46%	64,83%	67,64%	67,47%	66,59%	66,76%
Valores a receber	30,61%	23,49%	23,55%	17,31%	16,63%	16,68%	17,20%	17,09%
Debêntures	11,42%	18,51%	18,55%	13,63%	13,10%	13,15%	13,43%	13,34%
Operações Compromissadas	7,88%	7,90%	7,98%	5,90%	4,25%	4,31%	4,44%	4,45%
Outros valores mobiliários ofertados privadamente	6,98%	6,97%	6,99%	5,14%	4,93%	4,95%	5,05%	-
Títulos Públicos	0,29%	0,30%	0,30%	0,22%	0,21%	0,21%	0,21%	0,22%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-25,77%	-25,74%	-25,83%	-7,02%	-6,76%	-6,78%	-6,92%	-6,88%
Títulos de Crédito Privado	-	-	-	-	-	-	-	5,02%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	284.581,78	284.857,78	284.206,95	386.711,35	402.462,06	401.112,77	393.019,79	395.568,43
Data da Divulgação	08/06/2020	07/05/2020	02/04/2020	04/03/2020	04/02/2020	08/01/2020	09/12/2019	12/11/2019
Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)								mai/2020



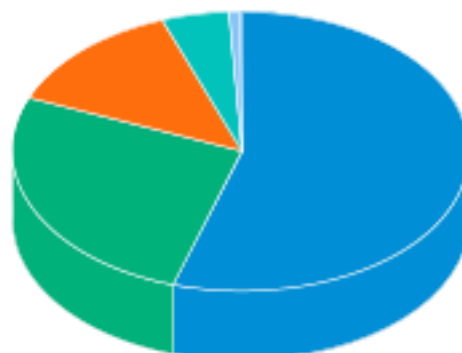
Outros Valores a receber	34,58 %
Outros Valores a pagar	31,19 %
Cotas de OAK FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO (sem carteira nesta da...	24,84 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	9,50 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2021	5,42 %
Certificado de Recebível Imobiliário - ISEC SECURITIZADORA S.A. (...)	4,79 %
Debênture simples - EBPH11	3,62 %
Debênture simples - LSHB14	3,12 %
CCI - COPEG - CRE (11.920.641/0001-80) - Venc.: 01/01/2027	2,54 %
Debênture conversível - BITN11	2,42 %
CCI - MTTG EMPREENDIMENTOS E PARTICIPAÇÕES LTDA. (09.613.866 /0001...	2,28 %
Cotas de AQ3 RENDA FII - ARFI11B (sem carteira nesta data)	1,49 %
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	1,09 %
Debênture simples - CMTR26	1,03 %
Outros Ativos Financeiros de Renda Fixa	1,02 %
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	0,63 %
Debêntures - SPE BRASIL INCORPORAÇÃO (11.317.056/0001-90) - Venc....	0,51 %
Títulos Públicos Federais	0,20 %
Lançamentos positivos menores que 0,20%	1,03 %

Tipo do Ativo



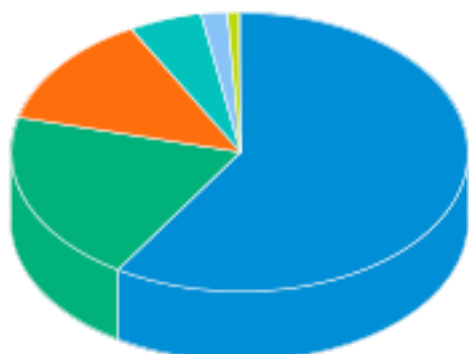
Valores a pagar/receber	50,18 %
Fundos de Investimento	20,07 %
Títulos Federais	8,98 %
Debêntures	8,25 %
Títulos Privados	7,32 %
Operação compromissada	4,25 %
Outros	0,78 %
Nota Promissória	0,14 %
Direito Creditório	0,03 %

Setor do Ativo



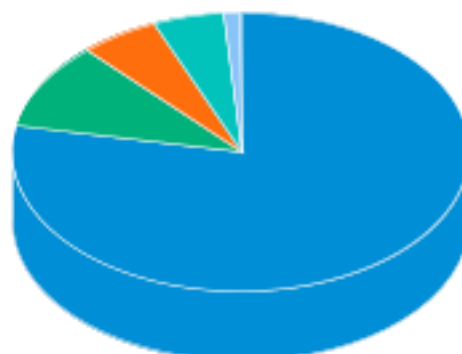
Não Classificado	54,73 %
Outros	26,47 %
Governo Federal	13,23 %
Imobiliário	4,78 %
Energia	0,78 %

Risco do Ativo



Outros	58,96 %
Cotas de fundos	20,05 %
Rating AAA	13,23 %
Rating BBB	5,13 %
Rating CCC	1,85 %
Rating A	0,78 %

Classe do Ativo



Outros	77,93 %
Inflação	10,23 %
Selic	5,58 %
CDI	5,13 %
Imóveis	1,13 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Outros Valores a receber	143.246,80256	50,3359 %
Cotas de OAK FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO (sem carteira nesta data)	102.885,60764	36,1533 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	39.362,70590	13,8318 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2021	22.435,17449	7,8836 %
Certificado de Recebível Imobiliário - ISEC SECURITIZADORA S.A. (08.769.451/0001-08) / 07/11/2025 - Código Cetip: 13K0072448	19.861,48627	6,9792 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Debênture simples - EBPH11	15.013,44939	5,2756 %
Debênture simples - LSHB14	12.903,51751	4,5342 %
CCI - COPEG - CRE (11.920.641/0001-80) - Venc.: 01/01/2027	10.501,90252	3,6903 %
Debênture conversível - BITN11	10.039,86513	3,5279 %
CCI - MTTG EMPREENDIMENTOS E PARTICIPAÇÕES LTDA. (09.613.866/0001-42) - Venc.: 01/01/2027	9.463,09188	3,3253 %
Cotas de AQ3 RENDA FII - ARF111B (sem carteira nesta data)	6.154,71521	2,1627 %
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	4.494,76592	1,5794 %
Debênture simples - CMTR26	4.250,18885	1,4935 %
Outros Ativos Financeiros de Renda Fixa	4.223,80756	1,4842 %
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	2.625,27223	0,9225 %
Debêntures - SPE BRASIL INCORPORAÇÃO (11.317.056/0001-90) - Venc.: 15/10/2024	2.101,59407	0,7385 %
Títulos Públicos Federais	835,03482	0,2934 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021 (BRSTNCNTB4T8)	833,58533	0,2929 %
Notas Promissórias Comerciais	746,41312	0,2623 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2023	583,40867	0,2050 %
Debêntures - VENTURE CAPITAL PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S.A. (24.241.659/0001-06) - Venc.: 18/05/2021	545,58383	0,1917 %
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	253,62592	0,0891 %
Direitos Creditórios	176,83009	0,0621 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 409	139,28728	0,0489 %
LFT - Venc.: 01/03/2021 (BRSTNCLF1R41)	117,26406	0,0412 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	112,31344	0,0395 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2020	75,71204	0,0266 %
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	49,38245	0,0174 %
LFT - Venc.: 01/09/2021 (BRSTNCLF1R58)	48,16593	0,0169 %
LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	48,16548	0,0169 %
LFT - Venc.: 01/03/2022 (BRSTNCLF1R66)	46,64383	0,0164 %
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	22,96231	0,0081 %
Outras Disponibilidades	18,98889	0,0067 %
LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	9,27403	0,0033 %
LFT - Venc.: 01/09/2020 (BRSTNCLF1R33)	1,19285	0,0004 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	-434,05003	-0,1525 %
Outros Valores a pagar	-129.211,95176	-45,4042 %

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).

**CARACTERÍSTICAS**

Gestão: A5 Capital Partners  
 Administrador: Planner Corretora  
 Custodiante: Planner Corretora  
 Auditor: EY  
 Taxa de Administração: 0,11%  
 Taxa de administração máxima: Não possui  
 Taxa de Performance: 20,00%  
 Índice de Performance: 100% do IPCA + 10,5% a.a.

**PERFIL DO FUNDO**

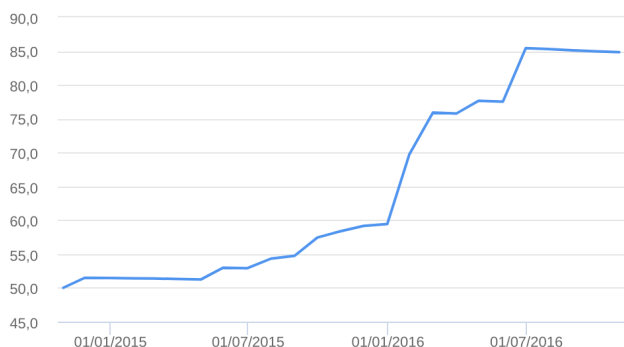
Classificação Quantum: Participações  
 Classificação Anbima: Fundos de Participações  
 Público Alvo: Investidores qualificados  
 Objetivo: Obter meta de rentabilidade de IPCA acrescido de 10,5% ao ano, por meio da aquisição de Valores Mobiliários.  
 Política de investimento: Investe em ações, debêntures, 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.

**RETORNO (%)**

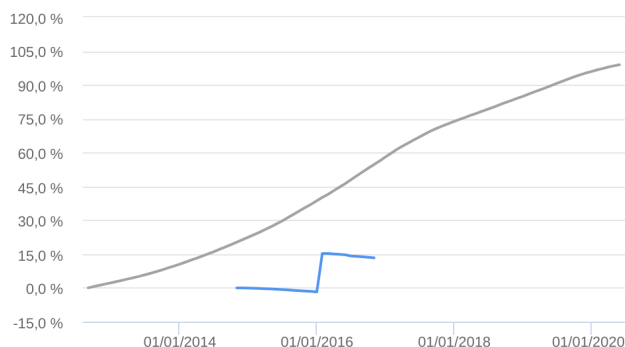
	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
% do CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	98,93	1,54	4,87	11,55	20,10	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Dólar	166,36	34,62	37,70	45,20	67,29	-0,01	4,39	15,56	5,37	5,92	-4,58	5,49	-3,85	0,63	9,92	-1,76	-2,75
Euro	135,31	33,07	37,20	38,24	65,40	1,61	3,61	15,86	4,46	4,44	-2,76	4,30	-1,66	-0,13	8,53	-3,85	-0,80
Ibovespa	53,17	-24,42	-9,92	13,87	39,37	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IGP-M	55,45	2,79	6,51	14,65	19,54	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

**GRÁFICOS**

**Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 03/09/2012 a 29/05/2020 (mensal)**



**Retorno Acumulado - 03/09/2012 a 29/05/2020 (mensal)**



■ Fundo

**HISTÓRICO**

PL Médio 12 meses: -  
 Início do Fundo: 06/06/2012  
 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: -

■ Fundo

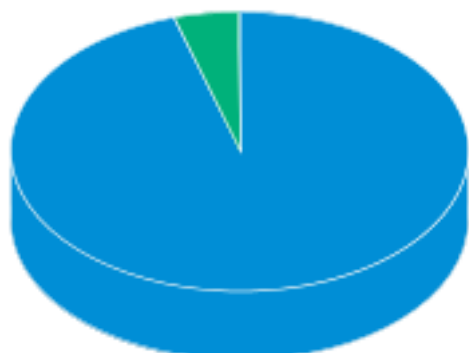
■ CDI

**INFORMAÇÕES OPERACIONAIS**

Aplicação mínima: R\$ 1.000.000,00  
 Movimentação mínima: Não há  
 Saldo mínimo: Não há  
 Contato: contato@a5.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

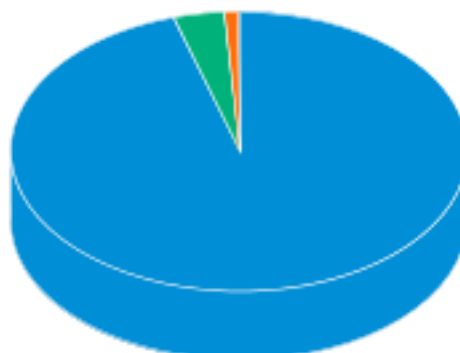
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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 Mensais.  
 Fonte: Quantum Axis.

Tipo do Ativo



■ Ações	95,45 %
■ Valores a pagar/receber	4,55 %

Sector do Ativo



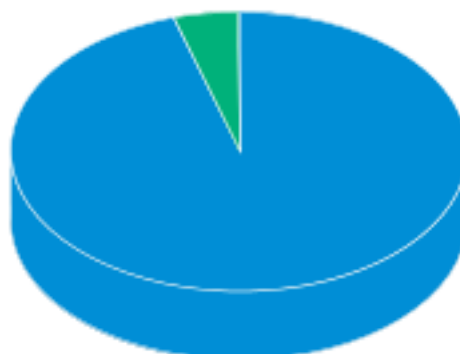
■ Holding	95,45 %
■ Não Classificado	3,61 %
■ Outros	0,94 %

Risco do Ativo



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

Classe do Ativo



■ Ações	95,45 %
■ Outros	4,55 %

Nome do Ativo	Valor do Ativo (R\$)	Participação do Ativo
Ação de Companhia Fechada - W7BZ HOLDING S.A. ON (16.596.059/0001-24)	140.207,55166	102,8817 %
Outros Valores a receber	1.375,00000	1,0089 %
Outras Disponibilidades	0,07025	0,0001 %
Outros Valores a pagar	-5.302,29230	-3,8907 %