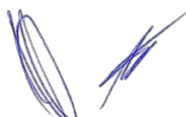


PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

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

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	051 /2020 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	051 /2020 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13	Data:	14/04/20
Valor:		
R\$ 3.000.000,00	Fundos de Ações em geral - Art. 8º, II, "a"	
Três milhões de reais		
Sim para todos os fundos desta APR		
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:		
Fundo:	MONGERAL AEGON FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	
CNPJ do Fundo:	33.254.944/0001-44	
Segmento:	FI de Ações - Geral	
Tipo de Ativo:	Fundos de Ações em geral - Art. 8º, II, "a"	
Tipo de operação realizada:	Aplicação	
Valor da operação:	R\$ 3.000.000,00	
Quantidade de Cotas:	3.507.191,02757658	
Valor da Cota (R\$):	R\$	0,8553854000
Data da Operação:	14/04/2020	
Data de Liquidação:	14/04/2020	
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	30.592.700,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	9,806%	
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%	
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A. 3234-4	7.909-X
Administrador:	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	
CNPJ do Administrador:	00.066.670/0001-00	
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	11/10/2019	
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BAC	Sim	
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 7.202.894.760,00	
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	2,12%	
Gestor:	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	
CNPJ do Gestor:	16.500.294/0001-50	
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	17/04/2019	
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não	
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	87.6
% Recursos do Gestor com RPPS	1,43%	
Empresa de Rating	Moody's	
Conceito	MQ2	
Representação do conceito	Muito bom	
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim	
Distribuidor:	ETERNUM AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS EIRELI	
CNPJ do Distribuidor:	12.049.428/0001-08	
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	17/04/2019	



Data de Início FI:	30/05/2019	
Taxa Administração do FI (%):	2,00	
Índice de Referência do FI :	IBOVESPA	
Tx Performance do FI (%):	0,20	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	IBOVESPA	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	100,00	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	SIM	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0 dias	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	2	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	0,00	
Segmento:	R\$ 0,00	
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00	
% Carteira do Fundo:	0,00	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA e Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos(Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O FUNDO tem por objetivo proporcionar aos seus COTISTAS, rentabilidade por meio das oportunidades oferecidas preponderantemente pelo mercado de renda variável, não obstante o FUNDO poderá aproveitar oportunidades através de investimentos em outras classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de Fundos de Investimento negociados nos mercados interno e externo.
	Principais riscos do fundo:	Mercado
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	-2,69%	
Retorno Médio Anual	-27,91%	
Retorno Total	-21,76%	

Maior Retorno	9,80%
Menor Retorno	-32,27%
Qtde. mês Positivo	6
Qtde. mês Negativo	3
Qtde. mês acima do Benchmark	6
Qtde. mês abaixo do Benchmark	3
Risco Mensal Período	12,36%
Risco Mensal 12 MESES	12,36%
Risco Anual do Período	42,82%
Retorno Relativo ao Benchmark	8,18%
Sharpe	-0,77
Information Ratio	0,91
Tracking Error	7,93%
VAR HISTÓRICO (95%)	18,47%
VAR 12 MESES (95%)	18,47%
Sharpe Modificado	-0,78
Beta (12 meses)	1,28
Erro Quadrático Médio (EQM)	2,39%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos: 16/03/2020
Outras Observações:	
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em FIP seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantêm a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo

O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?

Pergunta não se aplica ao fundo

Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)

PROPONENTE
Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Divisão de Investimentos
CPF:052.430.264-25
Entidade Certificadora: ANBIMA
CPA 20 e CEA
Validade da Certificação: 05/12/2020

GESTOR/AUTORIZADOR
José Carlos Augusto de Barros
Chefe de Investimentos
CPF:334.326.354-00
Entidade Certificadora: ANBIMA
CPA 20 e CEA
Validade da Certificação: 21/11/2021

Recife, 14 de abril de 2020

Ofício nº 051/2020 GI

Ilmos(as) Senhores(as)
Denise Nasser
Eternum/MAG Investimentos

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), no fundo MONGERAL AEGON FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CNPJ: 33.254.944/0001-44.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através do **gerenciador financeiro do Banco do Brasil S.A.**, Agência 3234-4, conta corrente 7.909-X, com os dados a seguir:

Banco: Banco Bradesco S.A.
Agência: 2856
Conta Corrente: 27.879-3
Favorecido: MONGERAL AEGON FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
CNPJ: 33.254.944/0001-44
Valor: R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 051/2020


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO



Características	Informações Operacionais
CNPJ: 33.254.944/0001-44	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: Mongeral Aegon Investimentos	Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00
Administrador: BEM DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração: 1,50%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 1,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Ações Livre	Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
Código de Referência: 498629	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3
Início do Fundo: 19/06/2019	

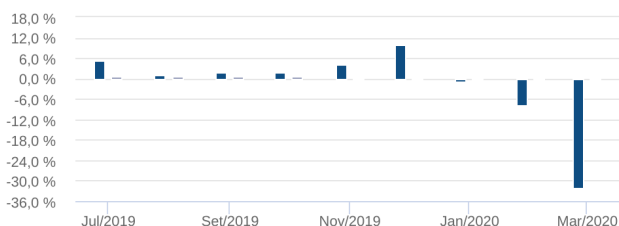
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19
Fundo	-14,46	-33,01	-	-	-	-32,27	-7,82	-0,81	9,80	4,13	1,93	1,98	0,84	5,41	-	-	-
% do CDI	-350,43	-2.891,89	-	-	-	-9.536,10	-2.663,74	-215,59	2.616,76	1.085,96	402,15	426,94	167,96	953,15	-	-	-
CDI	4,13	1,14	5,29	12,02	21,46	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52
Ibovespa	-20,32	-30,89	-14,14	-6,47	24,44	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98
IBX	-19,36	-30,63	-12,80	-3,96	27,39	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06
IGP-M	4,94	1,82	6,45	15,54	16,34	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92

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	0,8553854	30.592,70	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,29%	0

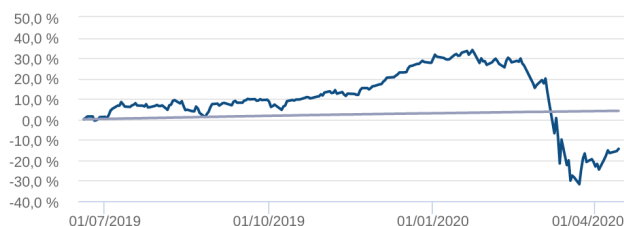
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 21/06/2019 a 14/04/2020 (mensal)



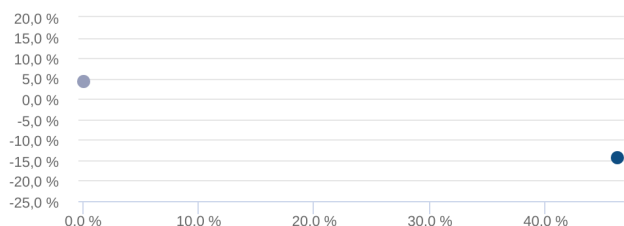
Retorno Acumulado - 21/06/2019 a 14/04/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 21/06/2019 a 14/04/2020 (diária)



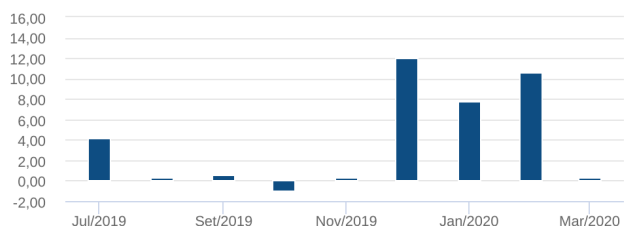
Risco x Retorno - 21/06/2019 a 14/04/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 21/06/2019 a 14/04/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 21/06/2019 a 14/04/2020 (mensal)



Composição da Carteira

mar/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. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Performance dos Fundos em Carteira

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

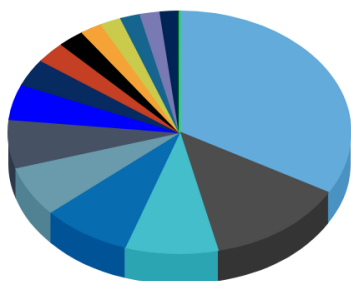
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19
Ações	90,73%	83,04%	84,16%	69,72%	85,94%	86,88%	86,50%	89,87%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	4,90%	8,02%	7,03%	8,28%	8,92%	10,26%	8,47%	5,05%
Valores a receber	2,59%	0,58%	1,81%	0,42%	0,14%	0,08%	3,46%	1,03%
Operações Compromissadas	2,07%	13,15%	8,31%	2,81%	8,77%	4,63%	2,52%	4,30%
Outras Aplicações	1,86%	4,00%	3,03%	-	-	-	-	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,18%
Valores a pagar	-2,15%	-8,79%	-4,35%	-1,10%	-3,79%	-1,85%	-0,94%	-1,37%
Cotas de Fundos	-	-	-	19,86%	-	-	-	-
Mercado Futuro - Posições vendidas	-	-	-	-	0,02%	-	-	-0,06%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	25.504,66	37.138,19	28.743,97	21.110,55	8.263,44	7.647,19	8.497,08	7.780,87
Data da Divulgação	10/04/2020	09/03/2020	06/02/2020	10/01/2020	18/12/2019	12/11/2019	11/10/2019	06/09/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

mar/2020



Ações (omitidas)	34,74 %
VALE ON N1 - VALE3	13,66 %
PETROBRAS ON - PETR3	9,13 %
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	8,78 %
B3 ON NM - B3SA3	7,01 %
JBS ON NM - JBSS3	6,73 %
BRASIL ON NM - BBAS3	4,90 %
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	3,82 %
Outros Certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários	2,95 %
Outros Valores a receber	2,59 %
Outros Valores a pagar	-2,15 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2020	2,07 %
BRADERCO PN N1 - BBDC4	1,96 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - BIDI11	1,96 %
BTGP BANCO UNT - BPAC11	1,86 %
Outras Disponibilidades	0,00 %