



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

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	082 /2020 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	082 /2020 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13	Data:	26/05/29
Valor:		
R\$ 15.000.000,00	FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	
Quinze milhões de reais		
Sim para todos os fundos desta APR		
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:		
Fundo:	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	
CNPJ do Fundo:	33.913.562/0001-85	
Segmento:	FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	
Tipo de Ativo:	FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	
Tipo de operação realizada:	Aplicação	
Valor da operação:	R\$ 15.000.000,00	
Quantidade de Cotas:	382.014,37898557	
Valor da Cota (R\$):	R\$	39,2655377000
Data da Operação:	26/05/2020	
Data de Liquidação:	27/05/2020	
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 221.676.580,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	6,767%	
Limite Máximo por PL do fundo	10,00%	
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4 7.909-X
Administrador:	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	
CNPJ do Administrador:	01.522.368/0001-82	
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	06/05/2020	
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim	
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 1.273.702.880,00	
% 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.	1,82%	
Gestor:	XP VISTA ASSET MANAGEMENT (GRUPO XP)	
CNPJ do Gestor:	16.789.525/0001-98	
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não	
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	128.017.669,57
% Recursos do Gestor com RPPS	0,23%	
Empresa de Rating	Moody's	
Conceito	MQ1	
Representação do conceito	Excelente	
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim	
Distribuidor:	XP INVESTIMENTOS CORRETORA DE CÂMBIO TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	
CNPJ do Distribuidor:	02.332.886/0001-04	
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	14/10/2019	

Data de Início FI:	08/11/2019	
Taxa Administração do FI (%):	0,80	
Índice de Referência do FI :	MSCI World	
Tx Performance do FI (%):	Não possui	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance	
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):	5	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR QUALIFICADO	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Sim	
CNPJ do Fundo:	33.362.028/0001-28	
Segmento:	Exterior	
Tipo de Ativo:	FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	
% Carteira do Fundo:	95,00	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar a seus cotistas valorizações de suas cotas mediante aplicação de seu patrimônio líquido em cotas de fundos de investimento que apresentem como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado à vista de bolsa de valores ou entidade do mercado de balcão organizado.
	Principais riscos do fundo:	Mercado, Crédito, Liquidez, Concentração, Decorrente da Restrição de Negociação dos Ativos Financeiros, Decorrente da Precificação dos Ativos, Cambial, Regulatório, Enquadramento Fiscal, Derivativos, Mercado Externo, Decorrente do Investimento no Mercado Externo – FATCA
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Alto
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		5,48%
Retorno Médio Anual		89,67%
Retorno Total		30,57%

Maior Retorno	17,78%
Menor Retorno	-2,97%
Qtde. mês Positivo	3
Qtde. mês Negativo	2
Qtde. mês acima do Benchmark	4
Qtde. mês abaixo do Benchmark	1
Risco Mensal Período	8,62%
Risco Mensal 12 MESES	8,50%
Risco Anual do Período	29,87%
Retorno Relativo ao Benchmark	12,84%
Sharpe	2,87
Information Ratio	4,44
Tracking Error	10,76%
VAR HISTÓRICO (95%)	19,94%
VAR 12 MESES (95%)	11,91%
Sharpe Modificado	2,88
Beta (12 meses)	0,69
Erro Quadrático Médio (EQM)	3,77%
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 19/05/2020
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?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
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 PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
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 nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo

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

Pergunta não se aplica ao fundo

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


PROPONENTE
Anderson 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 AUTORIZADO
José Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Investimentos
CPF:334.326.354-00
Entidade Certificadora: ANBIMA
CPA 20 e CEA
Validade da Certificação: 21/11/2021

Recife, 26 de maio de 2020

Ofício nº 082/2020 GI

Ilmo Senhor
**Lauter Ferreira
XPI**
Gerente

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 15.000.000,00 (Quinze milhões de reais), no fundo MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO AÇÕES INVESTIMENTO NO EXTERIOR CNPJ: 33.913.562/0001-85.

Informamos que foi encaminhado TED via Banco do Brasil S.A., com os seguintes dados:

Banco: XP Investimentos (102)
Agência: 0001
Conta: 80389-2
Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev
CNPJ: 07.749.668/0001-85
Valor: R\$ 15.000.000,00 (Quinze milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 082//2020


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO





Datas e horários baseados no fuso horário (GMT -3:00) em Brasília, Brasil
Sincronizado com o NTP.br e Observatório Nacional (ON)
Certificado de assinatura gerado em 25/05/2020 às 12:39:46 (GMT -3:00)

Ofício 082.pdf

 ID única do documento: #58e828ac-8fba-496d-8b32-3d8854e7b726

Hash do documento original (SHA256): 76248cd82cbcd2cee7df1352f69776ff7020ecfa7028610a2db968fa8aa2666b

Este Log é exclusivo ao documento número #58e828ac-8fba-496d-8b32-3d8854e7b726 e deve ser considerado parte do mesmo, com os efeitos prescritos nos Termos de Uso.

Assinaturas (2)

-  **Élcio Guimarães (Participante)**
Assinou em 25/05/2020 às 12:46:54 (GMT -3:00)
-  **José Marcos Alves de Barros (Participante)**
Assinou em 25/05/2020 às 12:42:19 (GMT -3:00)

Histórico completo

Data e hora	Evento
25/05/2020 às 12:42:19 (GMT -3:00)	José Marcos Alves de Barros E-mail zemarcos@recife.pe.gov.br, IP: 187.105.9.46 assinou.
25/05/2020 às 12:39:47 (GMT -3:00)	José Marcos Alves de Barros solicitou as assinaturas.
25/05/2020 às 12:46:54 (GMT -3:00)	Élcio Guimarães E-mail elcio.guimaraes@recife.pe.gov.br, IP: 177.135.60.150 assinou.

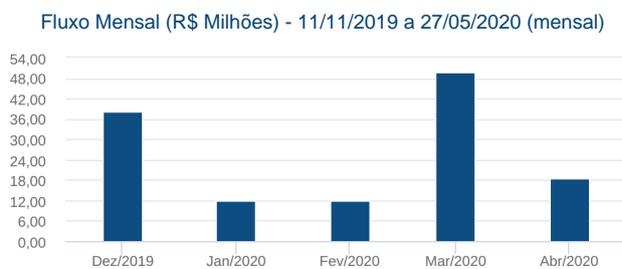
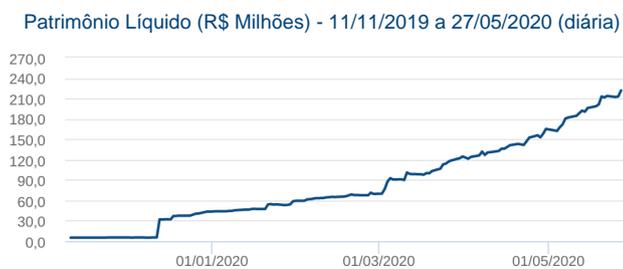
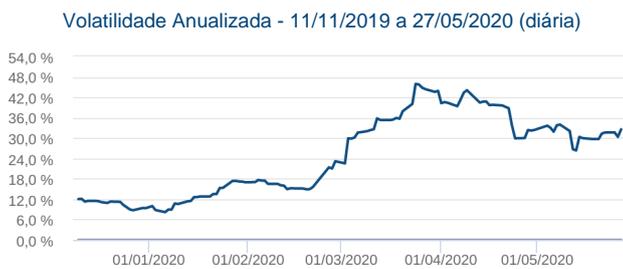
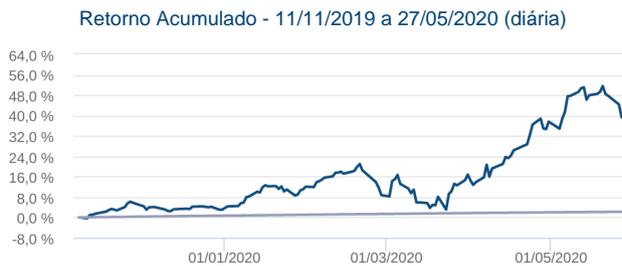
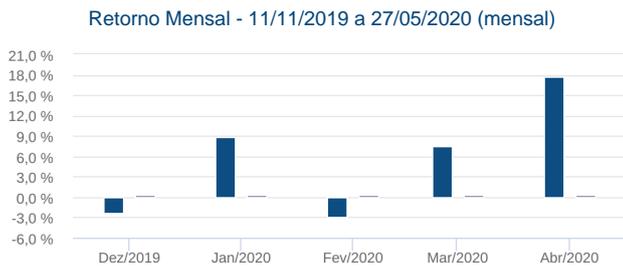
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 33.913.562/0001-85	Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00
Gestão: XP Vista Asset Management	Aplicação Adicional: Não informado
Administrador: BNP Paribas	Saldo Mínimo: Não informado
Taxa de Administração: 0,80%	Resgate Mínimo: Não informado
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Ações Investimento no Exterior	Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
Código de Referência: 522163	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+5 du
Início do Fundo: 08/11/2019	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19
Fundo	39,27	35,26	-	-	-	17,78	7,43	-2,97	8,81	-2,27	-	-	-	-	-	-	-
% do CDI	1.811,74	2.326,58	-	-	-	6.240,06	2.196,96	-1.012,52	2.340,50	-604,80	-	-	-	-	-	-	-
CDI	2,17	1,52	4,92	11,64	20,43	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54
Ibovespa	-18,29	-23,95	-8,76	9,76	42,60	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70
IBX	-17,58	-23,68	-7,52	12,76	45,33	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14
IGP-M	5,12	2,76	6,55	14,94	19,18	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45

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	139,2655377	221.676,58	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,28%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI



Composição da Carteira abr/2020

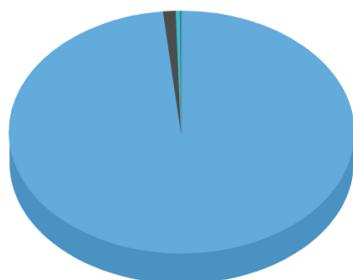
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas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

:: MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES

27/05/2020

Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início	Desde o início						
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	99,11	1,32	620,36	40,39	1.863,53	40,39	1.863,53	40,39	1.863,53	-	
BNP PARIBAS SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,18	0,19	89,90	185,41	96,57	185,41	96,57	185,41	96,57	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	
Cotas de Fundos	100,29%	100,84%	101,24%	100,27%	97,82%	100,05%	-	-	
Valores a receber	0,09%	0,03%	0,00%	0,00%	0,12%	0,00%	-	-	
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	2,09%	0,00%	-	-	
Valores a pagar	-0,38%	-0,87%	-1,25%	-0,28%	-0,03%	-0,05%	-	-	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	165.085,63	124.469,20	69.422,85	59.218,70	43.282,96	5.267,24	-	-	
Data da Divulgação	05/05/2020	06/04/2020	07/03/2020	06/02/2020	03/01/2020	02/12/2019	-	-	
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)									abr/2020



Cotas de MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIO...	99,11 %
Cotas de BNP PARIBAS SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1,18 %
Outros Valores a pagar	-0,38 %
Outros Valores a receber	0,09 %
Outras Disponibilidades	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, 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.



Datas e horários baseados no fuso horário (GMT -3:00) em Brasília, Brasil
Sincronizado com o NTP.br e Observatório Nacional (ON)
Certificado de assinatura gerado em 29/05/2020 às 11:15:58 (GMT -3:00)

APR 082 2020.pdf

ID única do documento: #8f6cc027-f05e-481e-8b3c-84ca3affe0ae

Hash do documento original (SHA256): f58d8062faeff04b400abe6bba272a5e70b50a1c23d0ca9a92d629f7231119c4

Este Log é exclusivo ao documento número #8f6cc027-f05e-481e-8b3c-84ca3affe0ae e deve ser considerado parte do mesmo, com os efeitos prescritos nos Termos de Uso.

Assinaturas (2)

- ✓ José Marcos Alves de Barros (Participante)
Assinou em 29/05/2020 às 11:17:59 (GMT -3:00)
- ✓ Andreson C G Oliveira (Participante)
Assinou em 29/05/2020 às 11:17:22 (GMT -3:00)

Histórico completo

Data e hora	Evento
29/05/2020 às 11:17:22 (GMT -3:00)	Andreson C G Oliveira E-mail andreson@recife.pe.gov.br, IP: 179.54.208.120 assinou.
29/05/2020 às 11:15:58 (GMT -3:00)	José Marcos Alves de Barros solicitou as assinaturas.
29/05/2020 às 11:17:59 (GMT -3:00)	José Marcos Alves de Barros E-mail zemarcos@recife.pe.gov.br, IP: 187.105.9.46 assinou.