

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 Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	151 /2020 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	151 /2020 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	15/10/20
CNPJ: 05.244.336/0001-13		
Valor:		
R\$ 7.388.729,94		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
Sete milhões, trezentos e oitenta e oito mil, setecentos e vinte e nove reais e noventa e quatro centavos		
Sim para todos os fundos desta APR		
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:		
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO	
CNPJ do Fundo:	PODER PÚBLICO 13.397.466/0001-14	
Segmento:	FI Renda Fixa - Geral	
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
Tipo de operação realizada:	Aplicação	
Valor da operação:	R\$ 7.388.729,94	
Quantidade de Cotas:	4.501.090,18817243	
Valor da Cota (R\$):	R\$	1,6415423000
Data da Operação:	15/10/2020	
Data de Liquidação:	15/10/2020	
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 698.342.300,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,058%	
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%	
Banco/Agência/Conta:	Banco Bradesco S.A.	0286-0 65000-5
Administrador:	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	
CNPJ do Administrador:	60.746.948/0001-12	
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	20/09/2020	
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim	
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 9.436.598.040,00	
% 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.	1,83%	
Gestor:	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	
CNPJ do Gestor:	62.375.134/0001-44	
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	20/09/2020	
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim	
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	10.529.029.197,41
% Recursos do Gestor com RPPS	2,02%	
Empresa de Rating	Fitch Ratings	
Conceito	Excelente	
Representação do conceito	Excelente	
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim	
Distribuidor:	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	
CNPJ do Distribuidor:	62.375.134/0001-44	
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	20/09/2020	

Data de Início FI:	16/02/2012	
Taxa Administração do FI (%):	3,00	
Índice de Referência do FI :	CDI	
Tx Performance do FI (%):	Não possui	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui	
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):	0	
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:	Sim	
CNPJ do Fundo:	06.081.490/0001-84	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
% Carteira do Fundo:	100,00	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é obter rentabilidade que busque acompanhar as variações das taxas de juros praticadas no mercado de depósitos interbancários (CDI) no curto prazo através da atuação no mercado de taxa de juros doméstica. A rentabilidade do FUNDO variará conforme o patamar das taxas de juros praticadas pelo mercado sendo também impactada pelos custos e despesas do FUNDO e pela taxa de administração de 3% (três por cento) ao ano.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado; Risco decorrente da concentração da carteira; Risco de Liquidez; Risco de Crédito; Risco Operacional; Risco de Derivativos; Riscos relacionados ao Órgão Regulador; Risco Sistemico; Risco Tributário.
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Baixo
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		0,48%
Retorno Médio Anual		5,92%
Retorno Total		63,85%

Maior Retorno	0,93%
Menor Retorno	-0,01%
Qtde. mês Positivo	101
Qtde. mês Negativo	2
Qtde. mês acima do Benchmark	0
Qtde. mês abaixo do Benchmark	103
Risco Mensal Período	0,25%
Risco Mensal 12 MESES	0,08%
Risco Anual do Período	0,86%
Retorno Relativo ao Benchmark	-21,63%
Sharpe	-3,53
Information Ratio	-34,64
Tracking Error	0,09%
VAR HISTÓRICO (95%)	0,89%
VAR 12 MESES (95%)	0,50%
Sharpe Modificado	46,79
Beta (12 meses)	0,75
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,24%
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 19/09/2020
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 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
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 DO FUNDOS
José Marcos Alves de Barros
Chefe de Investimentos
CPF:334.326.354-00
Entidade Certificadora: ANBIMA
CPA 20 e CEA
Validade da Certificação: 21/11/2021



ASSINADO DIGITALMENTE POR
JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
CPF: 334.326.354-00 DATA: 16/10/2020 08:31
LOCAL: RECIFE - PE

REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)



ASSINADO DIGITALMENTE POR
ANDRESON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA
CPF: 052.430.264-25 DATA: 16/10/2020 08:51
LOCAL: RECIFE - PE

REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

Recife, 15 de outubro de 2020

Ofício nº 151/2020 GI

Ilma Senhora
ROBERTA TAVARES
Gerente
Banco Bradesco S.A. - Agência Conde da Boa Vista - Recife -PE
NESTA

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 7.388.729,94 (Sete milhões, trezentos e oitenta e oito mil, setecentos e vinte e nove reais e noventa e quatro centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14; vinculado à conta 65000-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 151/2020


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

 ASSINADO DIGITALMENTE POR
JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
CPF: 334.326.354-00 DATA: 15/10/2020 11:16
LOCAL: RECIFE - PE
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

 ASSINADO DIGITALMENTE POR
ELCIO RICARDO LEITE GUIMARAES
CPF: 224.849.814-49 DATA: 15/10/2020 12:17
LOCAL: RECIFE - PE
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 13.397.466/0001-14	Aplicação Mínima: R\$ 200,00
Gestão: Bradesco Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 200,00
Administrador: Banco Bradesco	Saldo Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração: 1,75%	Resgate Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração (Máxima): 1,75%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 296953	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 16/02/2012	

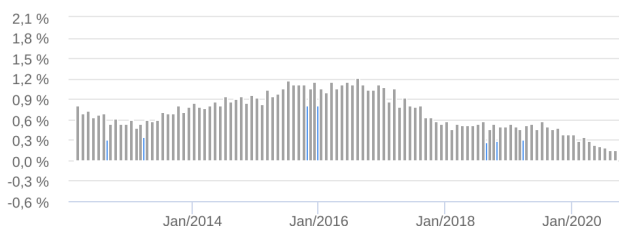
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Fundo	64,15	0,49	0,97	4,55	8,48	0,00	-0,01	0,00	0,02	0,03	0,08	0,11	0,11	0,15	0,16	0,17	0,25
% do IMA Geral ex-C	46,05	24,53	31,91	24,25	31,02	1,15	1,99	0,25	1,86	3,34	9,46	-5,91	24,80	30,23	17,83	-24,89	14,47
CDI	109,75	2,35	3,40	9,88	17,23	0,16	0,16	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48
Ibovespa	49,76	-14,35	-5,03	19,46	30,80	-4,80	-3,44	8,27	8,76	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36
IBX	92,71	-13,50	-3,81	23,57	34,08	-4,58	-3,38	8,41	8,97	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20
IGP-M	84,04	14,98	18,18	22,08	34,74	4,34	2,74	2,23	1,56	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68

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	1,6415423	698.342,30	741.429,43	0,06%	-0,02%	0,03%	0,79	0,02%	0,17%	-0,01%	0
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,38%	0,16%	0

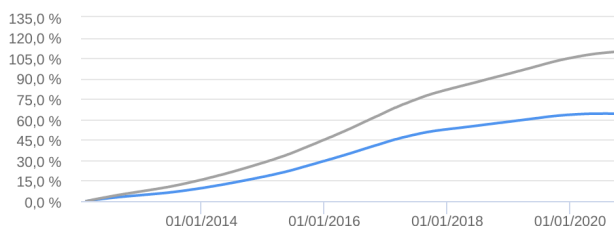
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

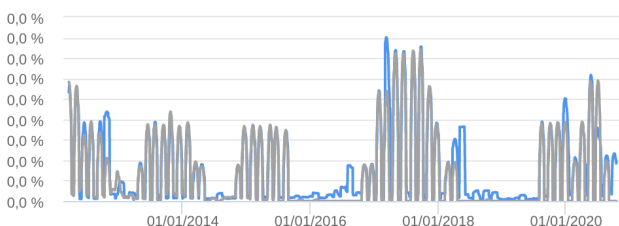
Retorno Mensal - 17/02/2012 a 15/10/2020 (mensal)



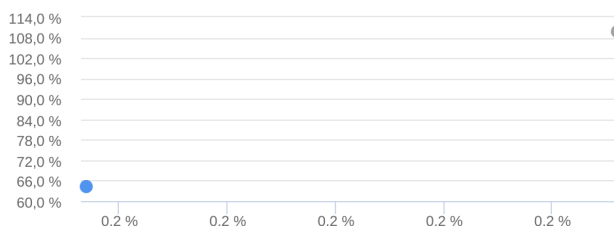
Retorno Acumulado - 17/02/2012 a 15/10/2020 (diária)



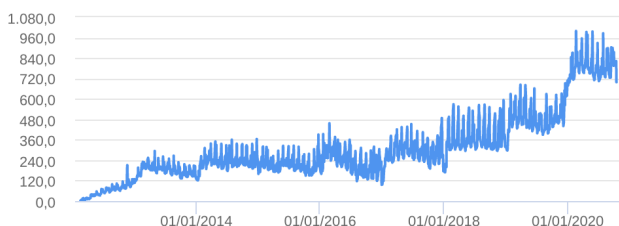
Volatilidade Anualizada - 17/02/2012 a 15/10/2020 (diária)



Risco x Retorno - 17/02/2012 a 15/10/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/02/2012 a 15/10/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/02/2012 a 15/10/2020 (mensal)



Composição da Carteira

set/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.

:: BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO

15/10/2020

Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	100,15	0,07	97,34	445,32	98,82	445,32	98,82	445,32	98,82	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	
Cotas de Fundos	100,15%	100,18%	100,19%	100,20%	100,22%	100,21%	100,24%	100,18%	
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	-0,15%	-0,18%	-0,19%	-0,20%	-0,22%	-0,22%	-0,24%	-0,18%	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	842.457,76	743.320,08	751.467,99	730.930,64	746.088,94	775.971,77	763.917,90	812.364,82	
Data da Divulgação	08/10/2020	08/09/2020	06/08/2020	06/07/2020	04/06/2020	07/05/2020	06/04/2020	05/03/2020	

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)									
									set/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.