



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDORES
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR
PORTARIA 1.467/2022

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	260 /2024- GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	260 /2024 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	23/10/2024
Valor:		
R\$ 19.995.849,64	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	
Dezenove milhões, novecentos e noventa e cinco mil, oitocentos e quarenta e nove reais e sessenta e quatro centavos		

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2029- CÓDIGO: 70430433)		
CNPJ do Fundo:	-		
Segmento:	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"		
Tipo de Ativo:	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 19.995.849,64		
Quantidade de Cotas:	4619,00		
Valor da Cota (R\$):	4329,04000000		
Data da Operação:	23/10/2024		
Data de Liquidação:	23/10/2024		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):			
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	#DIV/0!		
Limite Máximo por PL do fundo	-		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	TESOURO NACIONAL		
CNPJ do Administrador:	-		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:			
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN			
Volume de Recursos do Administrador com RPPS			
% 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			
Gestor:	TESOURO NACIONAL		
CNPJ do Gestor:	-		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:			
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	-	
% Recursos do Gestor com RPPS	0,00%		
Empresa de Rating			
Conceito			
Representação do conceito			
O fundo atende a Resolução 4.963/2021, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN			
Distribuidor:	TESOURO NACIONAL		
CNPJ do Distribuidor:	-		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:			

Data de Início FI:	17/01/2024	
Taxa Administração do FI (%):	-	
Índice de Referência do FI :	IPCA+6,82%	
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 4.963/2021	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):	Até o dia 15/05/2029	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	1	
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	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 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:	Títulos Públicos do Governo Federal
	Principais riscos do fundo:	Risco de volatilidade dos títulos (Risco: 1)
	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	Longo Prazo	

Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior	
Retorno Médio Mensal	#N/D
Retorno Médio Anual	#N/D
Retorno Total	#N/D
Maior Retorno	#N/D
Menor Retorno	#N/D
Qtde. mês Positivo	#N/D
Qtde. mês Negativo	#N/D
Qtde. mês acima do Benchmark	#N/D
Qtde. mês abaixo do Benchmark	#N/D
Risco Mensal Período	#N/D
Risco Mensal 12 MESES	#N/D
Risco Anual do Período	#N/D
Retorno Relativo ao Benchmark	#N/D
Sharpe	#N/D
Information Ratio	#N/D
Tracking Error	#N/D
VAR HISTÓRICO (95%)	#N/D
VAR 12 MESES (95%)	#N/D
Sharpe Modificado	#N/D
Beta (12 meses)	#N/D
Erro Quadrático Médio (EQM)	#N/D
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo de 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 26/08/2024
Outras Observações:	Aplicação automática em fundo de investimento. Esta operação tem por objetivo evitar que os recursos permaneçam em conta corrente sem remuneração. Os montantes aplicados no fundos de aplicação e resgates automáticos são posteriormente realocados de acordo com a estratégia de investimentos definida na Política de Investimentos para o exercício. Fundos com essas características possuem alto custo de taxa de administração, portanto não há intenção de permanecer com os recursos alocados por longo prazo. Para escolha desse tipo de produto são analisados o nível de liquidez e os custos.
Outras informações : 1	
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
Outras informações : 2	
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
Outras informações : 3	
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
Análise do regulamento e demais documentos disponibilizados pelo gestor do fundo de investimento e os riscos inerentes às operações previstas	-
Adequação das características do fundo frente às necessidades de liquidez do RPPS	-
Adequação da política de seleção, alocação e diversificação de ativos e, quando for o caso, a política de concentração de ativos	-
Avaliação dos dados comparativos no que se refere aos custos, retorno e risco de fundos de investimento similares	-
Verificação da compatibilidade entre o objetivo de retorno do fundo de investimento, a política de investimento do fundo, o limite de risco divulgado pelo gestor, quando couber, e eventual adequação do parâmetro utilizado para a cobrança da taxa de performance	-
Verificação das hipóteses de eventos de avaliação, amortização e liquidação, inclusive antecipada, quando aplicável	-

<p>Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos</p>	
<p>Em caso de fundos de investimento cujas carteiras sejam representadas, exclusivamente ou não, por cotas de outros fundos de investimento, deverá ser verificado que a carteira dos fundos investidos atende aos requisitos previstos em Resolução do CMN</p>	
<p>Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</p>	