



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:	008 /2018 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	008 /2018 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	09/01/18	
CNPJ: 05.244.336/0001-13		Dispositivo da Resolução do CMN		
Valor:		FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"		
R\$ 5.064.524,40				
Cinco milhões, sessenta e quatro mil, quinhentos e vinte e quatro reais e quarenta centavos				
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>				
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO			
CNPJ do Fundo:	15.154.220/0001-47			
Segmento:	Renda Variável			
Tipo de Ativo:	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"			
Tipo de operação realizada:	Aplicação			
Valor da operação:	R\$ 5.064.524,40			
Quantidade de Cotas:	4.087.260,43095795			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,23910000			
Data da Operação:	09/01/2018			
Data de Liquidação:	10/01/2018			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 292.828.000,00			
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,729522%			
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	0286-0	65000-5	
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	03/11/2017			
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	03/11/2017			
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	03/11/2017			
Data de Início FI:	01/11/2012			
Taxa Administração do FI (%):	1,50			
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado			
Índice de Referência do FI :	Índice Small Cap			
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			
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado			
Carência (dias):	0			
Data Listagem Bolsa:	Não listado			
Resgate (dias):	4			

Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Cód. Negociação Bolsa:	Sem código	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	R\$ 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:	O objetivo do FUNDO é superar o desempenho do Índice Small Cap (SMLL) por meio do exercício de gestão ativa, proporcionando ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por ativos de empresas de menor capitalização de mercado, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado / Risco de Crédito / Risco de Liquidez / Risco de Concentração / Risco Sistêmico e de Regulação / Risco Proveniente do uso de Derivativos. (Risco 5)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Alto
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 Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	12/12/2017
Outras Observações:		
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)		
<p style="text-align: center;"> <b>PROBANTE</b>  <b>Andreson Carlos Gomes de Oliveira</b>  Chefe de Divisão de Investimentos  CPF: 052.430.264-25  Entidade Certificadora: ANBIMA  Validade da Certificação: 04/02/2018 </p> <p style="text-align: center;"> <b>GESTOR/AUTORIZADOR</b>  <b>José Marcos Alves de Barros</b>  Gerente de Investimentos  CPF: 334.336.754-00  Entidade Certificadora: ANBIMA  Validade da Certificação: 03/05/2019 </p>		



**SAÚDE  
RECIFE**

**RECI  
PREV**

Recife, 09 de janeiro de 2018

**Ofício RECI-REV nº 008/2018 – GI**

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 5.064.524,40 (Cinco milhões, sessenta e quatro mil, quinhentos e vinte e quatro reais e quarenta centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO CNPJ: 15.154.220/0001-47, vinculado à conta 4-5.


Justificativa da aplicação ou resgate: APR 008/2018

Atenciosamente,

  
**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
**FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JUNIOR**  
DIRETOR EXECUTIVO

Ilma Senhora  
**MARIA VERÔNICA GALINDO**  
Gerente de Atendimento PJ - Público  
**Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo**  
NESTA

  
MARIA VERÔNICA GALINDO  
Gerente de Atendimento PJ - Público  
19 Caixa do Apolo/PE  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

*Recibido  
09/01/2018*

  
**PREFEITURA DO  
RECIFE**

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife  
Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000 , Boa Vista, Recife - PE  
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647

## Características

CNPJ	15154220000147
Início do Fundo	05/11/2012
Código Anbima	317594
Classificação Anbima	Ações Small Caps
Gestão	Caixa
Custodiante	Caixa Economica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	1,50
Taxa performance	-

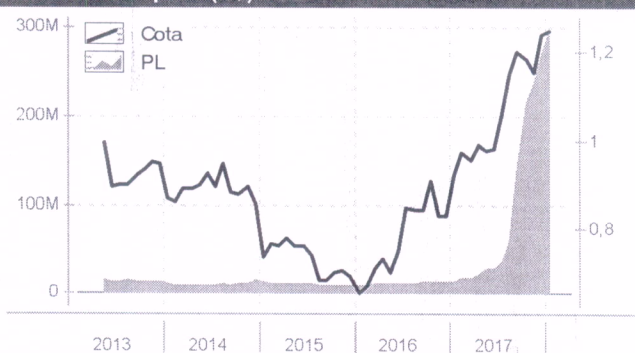
## Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	100
Aplicação adicional mínima	50
Resgate mínimo	50
Saldo mínimo	50
Prazo emissão de cotas	D+001
Prazo conversão resgate	D+001
Prazo pgto resgate	D+004

Benchmark **SMLL - SMALL CAP**

Data da Última Cotação	11/01/2018
Cota	1,2391
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	292.828
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	113.493
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	-
Resolução 3922	Sim

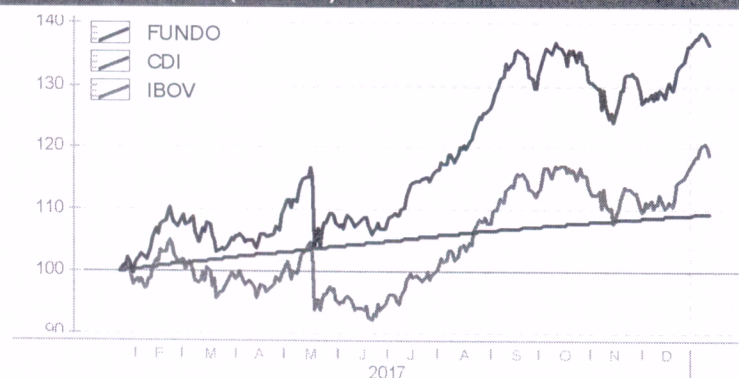
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



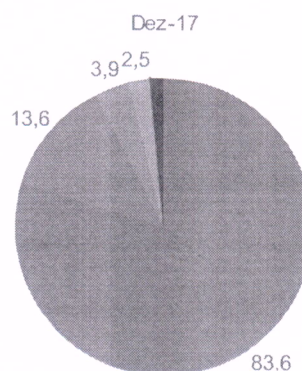
## Retornos (%) (até 10/01/2018)

	ago 2017	set 2017	out 2017	nov 2017	dez 2017	jan 2018	2016	2017	2018	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	8,78	4,39	-1,27	-2,57	7,19	0,19	19,96	49,07	0,19	43,92	90,36	58,44	23,91
● CDI	0,80	0,64	0,64	0,57	0,54	0,19	14,00	9,93	0,19	9,74	25,22	41,80	71,99
● IBOV	7,46	4,88	0,02	-3,15	6,16	2,35	38,94	26,86	2,35	25,86	92,56	60,12	34,34

## Retorno Acumulado (252 dias)



## Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



## Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	8
Meses Negativos	4
Maior Retorno Mensal (%)	8,78
Menor Retorno Mensal (%)	-2,57
Retorno Acumulado (%)	43,92
Volatilidade	18,51
Sharpe	1,85
VAR de 1 mês - 95% (%)	8,64

- Ações
- Cert ou rec de dep de val mob
- Cotas de fundos
- Valores a receber
- Opç compra - posiç titulares
- Opç compra -posiç lançadas
- Valores a pagar

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economática é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.