



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



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 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	008 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	16/01/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 16.380,12		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Dezesseis mil, trezentos e oitenta reais e doze 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 PODER PÚBLICO			
CNPJ do Fundo:	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:	Resgate			
Valor da operação:	R\$ 16.380,12			
Quantidade de Cotas:	10.337,59054240			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,58452010			
Data da Operação:	16/01/2019			
Data de Liquidação:	16/01/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	416.280.740,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,004%			
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:	25/10/2018			
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 9.351.439.880,00			
% 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.	1,57%			
Gestor:	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)			
CNPJ do Gestor:	62.375.134/0001-44			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	25/10/2018			
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	9.565.729.574,08		
% Recursos do Gestor com RPPS	1,57%			
Empresa de Rating	Standard&Poor's			
Conceito	AMP 1			
Representação do conceito	Excelente			
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Sim			
Distribuidor:	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)			
CNPJ do Distribuidor:	62.375.134/0001-44			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	25/10/2018			

Data de início FI:		16/02/2012
Taxa Administração do FI (%):		3,00
Índice de Referência do FI:		(DI
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		0,56%
Retorno Médio Anual		6,91%
Retorno Total		57,90%

Maior Retorno	0,93%
Menor Retorno	0,25%
Qtde. mês Positivo	82
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	0
Qtde. mês abaixo do Benchmark	82
Risco Mensal Período	0,21%
Risco Anual do Período	0,73%
Retorno Relativo ao Benchmark	-18,15%
Sharpe	-4,35
Information Ratio	-45,38
Tracking Error	0,07%
VAR (95%)	0,91%
Sharpe Modificado	80,53
Beta (12 meses)	0,49
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,25%
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 19/12/2018
Outras Observações:	Pagamento de folha
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 Bogues 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 Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 384.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

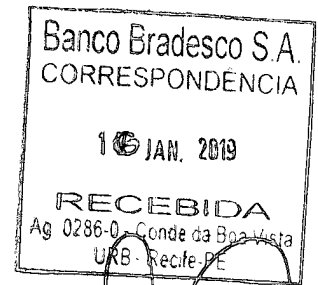
Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 16 de janeiro de 2019

Ofício RECI-REV nº 008/2019 – GI



Marcelo A. M. de Oliveira
Mat. 135379

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 16.380,12 (Dezesseis mil, trezentos e oitenta reais e doze centavos), do 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 008/2019

Atenciosamente,



JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilma Senhora
ADRIANA CRISTINA MELO FERREIRA FONSECA
Gerente
Banco Bradesco S.A. - Agência Conde da Boa Vista - Recife -PE
NESTA

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) 3355.1610 / 3355.1617

Características

CNPJ: 13.397.466/0001-14
 Gestão: Bradesco Asset Management
 Administrador: Banco Bradesco
 Taxa de Administração: 2,50%
 Taxa de Administração (Máxima): 2,50%
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento
 Código de Referência: 296953
 Início do Fundo: 16/02/2012

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 200,00
 Aplicação Adicional: R\$ 200,00
 Saldo Mínimo: R\$ 100,00
 Resgate Mínimo: R\$ 100,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

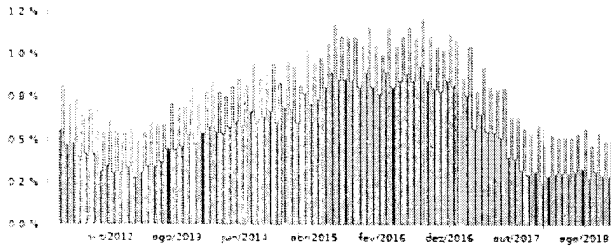
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18
Fundo	58,45	0,16	3,65	10,45	22,18	0,29	0,29	0,32	0,27	0,33	0,31	0,30	0,30	0,30	0,29	0,25	0,31
% do CDI	62,23	58,32	56,60	61,64	66,46	58,33	58,15	58,28	58,62	58,41	58,08	58,23	58,26	58,38	54,10	52,98	53,76
CDI	93,93	0,27	6,46	16,95	33,37	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58
Ibovespa	42,71	7,40	18,96	52,99	132,43	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14
IBX	79,16	7,27	19,59	54,15	130,06	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74
IGP-M	49,37	0,11	7,34	6,91	14,47	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	1,5845201	416.280,74	379.849,82	0,01%	-	0,00%	0,53	0,01%	0,33%	0,25%	0
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

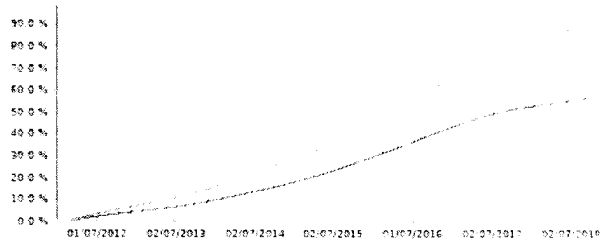
Gráficos

Fundo CDI

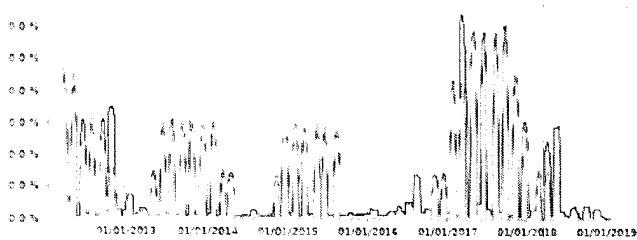
Retorno Mensal - 17/02/2012 a 16/01/2019 (mensal)



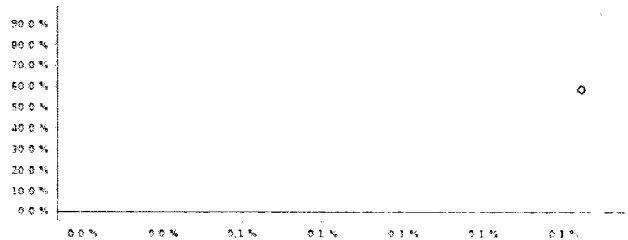
Retorno Acumulado - 17/02/2012 a 16/01/2019 (diária)



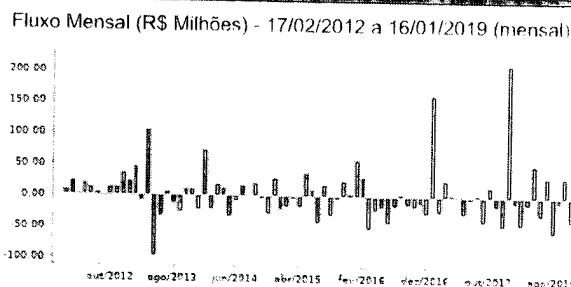
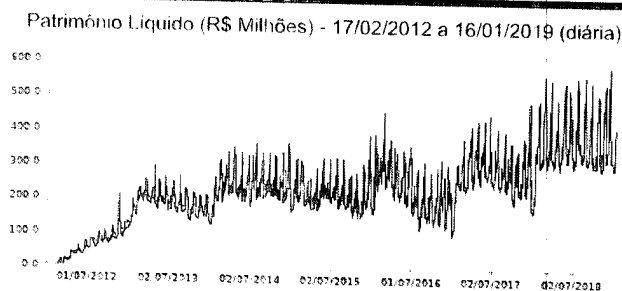
Volatilidade Anualizada - 17/02/2012 a 16/01/2019 (diária)



Risco x Retorno - 17/02/2012 a 16/01/2019 (diária)



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 Fundo deste mercado 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 fundo de Garantia de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias como derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus investidores superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do investidor de aportar em meses subsequentes o valor perdido de fundo. Ao investir, é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para aplicação de portfólios em um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações em Valor Líquido.



Composição da Carteira

dez/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

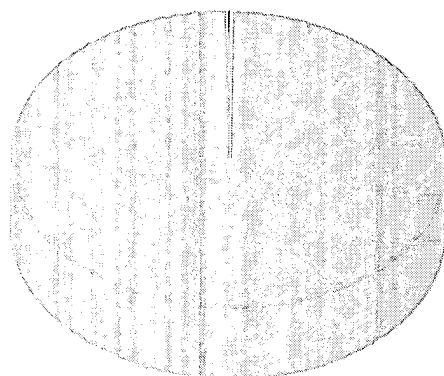
FUNDO	% do PL	Mês	Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses	
			Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo			
BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	100,26	0,27	99,21	404,54	98,88	404,54	98,88	404,54	98,88	-	PL Médio R\$ 1.568.695.230,52

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

Tipo de Aplicação	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18
Cotas de Fundos	100,26%	100,25%	100,22%	100,23%	100,27%	100,22%	100,23%	100,21%
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	-0,26%	-0,25%	-0,22%	-0,23%	-0,28%	-0,22%	-0,23%	-0,21%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	319.115,13	319.547,29	357.827,38	324.239,25	332.030,88	387.968,04	353.037,72	381.061,35
Data da Divulgação	07/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	02/10/2018	05/09/2018	03/08/2018	05/07/2018	06/06/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

dez/2018



■ Cotas de BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	100,26 %
■ Outros Valores a pagar	-0,26 %
■ Outros Valores a receber	0,00 %
■ 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 pelo QUANTUM, pelo fundo desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos do grupo investidor 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 do Selo de Garantia de Créditos - FIC. 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 extinção de cotista de aporte recorrente, com o risco de 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 informações da performance de um fundo de investimento, é recomendada a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas abreviações comuns. Fonte: Quantum Asset.

Acerto do Fundo RECIprev
CARMEM DOLORES URQUIZA DE CASTRO DE MELO
Hoje, 15:25 JOSE MARCOS ALVES DE BARROS;
José Marcos, boa tarde!

Solicitamos o resgate de aplicações financeiras da conta 65000-5 do Bradesco no valor 16.380,12 (dezesesseis mil trezentos e oitenta reais e doze centavos), referente a remessa de pagamento transmitido eletronicamente em 16/01/2019 pela EMPREL, Fundo Reciprev com data do pagamento para o dia 16/01/2019 (quarta feira).

Atenciosamente;

Carmem Dolores
3355-1645/1637