



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:	009 /2018 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	009 /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 - Geral - Art. 8º, II, "a"		
R\$ 5.100.000,00				
Cinco milhões e cem mil reais				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES			
CNPJ do Fundo:	09.087.523/0001-91			
Segmento:	Renda Variável			
Tipo de Ativo:	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"			
Tipo de operação realizada:	Aplicação			
Valor da operação:	R\$ 5.100.000,00			
Quantidade de Cotas:	3.534.793,45716662			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,44280000			
Data da Operação:	09/01/2018			
Data de Liquidação:	10/01/2018			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 115.929.000,00			
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	4,399244%			
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X	
Administrador:	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA			
CNPJ do Administrador:	07.437.241/0001-41			
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	03/11/2017			
Gestor:	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA			
CNPJ do Gestor:	07.437.241/0001-41			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	03/11/2017			
Distribuidor:	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA			
CNPJ do Distribuidor:	07.437.241/0001-41			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	03/11/2017			
Data de Início FI:	28/06/2010			
Taxa Administração do FI (%):	2,50			
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado			
Índice de Referência do FI :	Sem benchmark			
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:	Sim	
CNPJ do Fundo:	07.892.335/0001-00	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	
% Carteira do Fundo:	1,85	
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, a longo prazo, buscar a valorização dos capitais investidos pelos cotistas, observadas as regras legais e regulamentares em vigor, através da seleção de ativos financeiros que comporão a carteira do FUNDO ("CARTEIRA") sem a utilização, como referência, da carteira teórica de nenhum índice existente no mercado de renda variável brasileiro, podendo, portanto, haver maior concentração de investimentos em um menor número de emissor(es) de ativos financeiros e respectivos setores de atuação
	Principais riscos do fundo:	Renda Variável e demais riscos constantes do regulamento (Risco: 5,0)
	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 RECIпреV 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;"> PROponente Andreson Carlos Gomes de Oliveira 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;"> Gestor/Autorizador José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 334.326.854-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019 </p>		

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 09 de janeiro de 2018

Ofício RECI PREV nº 009/2018 – GI

Prezados (as) Senhores (as),


Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECI PREV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 5.100.000,00 (Cinco milhões e cem mil reais), no fundo **WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CNPJ: 09.087.523/0001-91**.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através do Banco do Brasil S.A., Agência 3234-4, conta corrente 7.909-X, com os dados a seguir:

Banco: 745 (Citibank)
Agência: 001
Conta Corrente: 29229065
Favorecido: WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
CNPJ: 09.087.523/0001-91
Valor: R\$ 5.100.000,00 (Cinco milhões e cem mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 009/2018

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR
Diretor Executivo

Prezados (as) Senhores (as)
Elder Andrade
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA
São Paulo - SP

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


PREFEITURA DO
RECIFE

Encomendado por e-mail em 09/01/2018

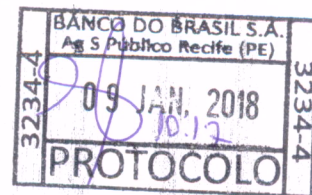
JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
Gerente de Investimentos
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Recife

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 09 de janeiro de 2018

Ofício RECIPREV nº 1A/2018 – GI



Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar as seguintes operações, vinculadas à conta 7.909-X.


a) TED conforme a seguir:

Banco: 745 (Citibank)
Agência: 001
Conta Corrente: 29229065
Favorecido: WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE
INVESTIMENTO EM AÇÕES
CNPJ: 09.087.523/0001-91
Valor: R\$ 5.100.000,00 (Cinco milhões e cem mil reais)

b) Resgatar o valor de R\$ 36.558,60 (Trinta e seis mil, quinhentos e cinquenta e oito reais e sessenta centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO: 13.077.415/0001-05.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 009/2018

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR
DIRETOR EXECUTIVO

Ilmo Senhor

PEDRO PAULO

Gerente de Relacionamento

Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE

NESTA



**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	09087523000191
Início do Fundo	25/06/2010
Código Anbima	250686
Classificação Anbima	Ações Livre
Gestão	Western Asset
Custodiante	Citibank Dtm SA
Administrador	Western Asset
Taxa máx. adm. (%)	0,00
Taxa performance	-

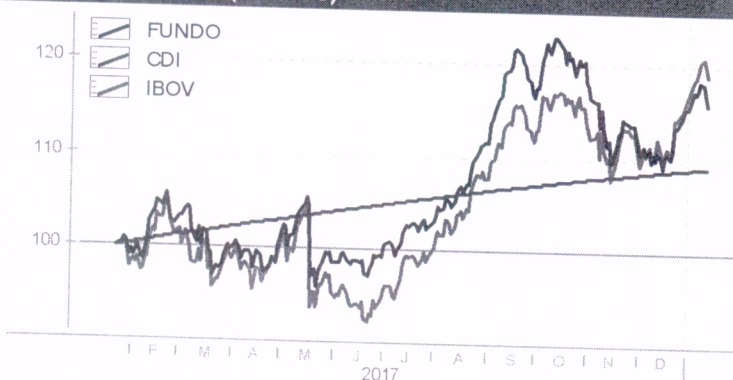
Data da Última Cotação	11/01/2018
Cota	1,4428
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	115.929
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	101.854

Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

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	8,29	5,32	0,11	-6,11	4,51	0,34	36,31	23,81	0,34	21,23	77,95	62,39	44,28
● 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	116,98
● 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	20,64

Retorno Acumulado (252 dias)



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	9
Meses Negativos	3
Maior Retorno Mensal (%)	8,29
Menor Retorno Mensal (%)	-6,11
Retorno Acumulado (%)	21,23
Volatilidade	16,20
Sharpe	0,75
VAR de 1 mês - 95% (%)	7,61

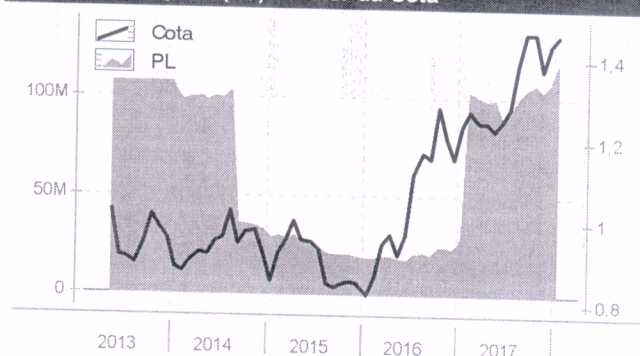
Condições de Investimentos

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

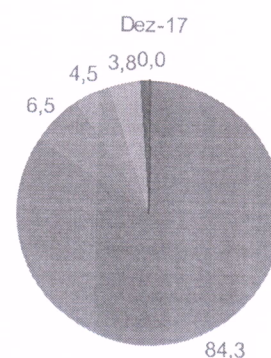
Benchmark

Não se Aplica

Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



- Ações
- Otr VM req na CVM obj of pub
- Cert ou rec de dep de val mob
- Cotas de fundos
- Títulos públicos
- Valores a receber
- Disponibilidades
- 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 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.