



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 Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 Valor: R\$ 3.500.000,00 Três milhões e quinhentos mil reais	Nº / ANO:	012 /2019 - GI
	OF. Nº:	012 /2019 - GI
	Data:	18/01/19
		FI Multimercado - Art. 8º, III

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO		
CNPJ do Fundo:	11.616.403/0001-86		
Segmento:	FI Multimercado - Aberto		
Tipo de Ativo:	FI Multimercado - Art. 8º, III		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 3.500.000,00		
Quantidade de Cotas:	#VALOR!		
Valor da Cota (R\$):	a SER DEFINIDO QUANDO DO PAGAMENTO		
Data da Operação:	18/01/2019		
Data de Liquidação:	05/02/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	a SER DEFINIDO QUANDO DO PAGAMENTO		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	#VALOR!		
Limite Máximo por PL do fundo	5,00%		
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S A		
CNPJ do Administrador:	02.201.501/0001-61		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	19/10/2018		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 1.766.417.749,96		
% 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.	1,08%		
Gestor:	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA		
CNPJ do Gestor:	07.625.200/0001-89		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	19/10/2018		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	79.069.300,42	
% Recursos do Gestor com RPPS	0,29%		
Empresa de Rating	Moody's		
Conceito	MQ2		
Representação do conceito	Muito bom		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Não		
Distribuidor:	XP INVESTIMENTOS CORRETORA DE CÂMBIO TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A		
CNPJ do Distribuidor:	02.332.886/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	31/10/2018		

Data de Início FI:	12/03/2010	
Taxa Administração do FI (%):	2,50	
Índice de Referência do FI :	CDI	
Tx Performance do FI (%):	0,20	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	CDI	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	100,00	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	SIM	
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):	15	
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:	19.418.021/0001-50;17.898.543/0001-70;18.416.618/0001-00; 18.418.894/0001-08;18.418.915/0001-87; 18.418.851/0001-14;18.418.874/0001-29;18.418.812/0001-17;18.418.825/0001-96;18.416.553/0001-95;18.428.603/0001-54	
Segmento:	Renda Variável	
Tipo de Ativo:	FI Multimercado Art. 8º, III	
% Carteira do Fundo:	98,07; 0,21 para os demais	
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:	A política de investimento do FUNDO consiste em obter retornos superiores ao rendimento do CDI, investindo primordialmente em ativos de renda variável, em posições compradas e/ou vendidas, na forma de ações e/ou de derivativos, sem exposição direcional. As estratégias relativas de renda variável do FUNDO são feitas exclusivamente por meio de análise fundamentalista. Apesar de não ser o foco principal, o FUNDO também pode assumir posições em ativos de renda fixa para remunerar o caixa que não esteja sendo utilizado. A preservação de capital é um princípio fundamental na estratégia de gestão.
	Principais riscos do fundo:	Mercado, Variações do mercado em que investe, juros e outros conforme o regulamento (Risco: 5)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Alto
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	0,97%	
Retorno Médio Anual	12,25%	
Retorno Total	151,98%	

Maior Retorno	3,62%
Menor Retorno	-2,41%
Qtde. mês Positivo	83
Qtde. mês Negativo	13
Qtde. mês acima do Benchmark	53
Qtde. mês abaixo do Benchmark	43
Risco Mensal Período	1,10%
Risco Anual do Período	3,81%
Retorno Relativo ao Benchmark	15,16%
Sharpe	0,52
Information Ratio	0,53
Tracking Error	3,68%
VAR (95%)	2,78%
Sharpe Modificado	0,64
Beta (12 meses)	2,23
Erro Quadrático Médio (EQM)	1,07%
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:	
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?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Sim
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)

PROPOSTANTE

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/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 354.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

RECI
PREV

Recife, 18 de janeiro de 2019

Ofício RECI-REV nº 012/2019 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar o resgate em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECI-REV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 3.500.000,00 (Três milhões e quinhentos mil reais), do fundo XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CNPJ: 11.616.403/0001-86.

Solicitamos encaminhar TED, conforme dados a seguir:

Banco: Caixa Econômica Federal
Agência: 50-7
Conta Corrente: 00000004-5
Favorecido: FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECI-REV
CNPJ: 07.749.668/0001-85

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 012/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilmos(as) Senhores (as)
LAUTER FERREIRA/Caroline Sampaio
XPI
São Paulo - SP

*Encaminhado para
resgate em
18/01/2019*

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
Gerente de Investimentos
CNPJ: 07.749.668/0001-85
Autarquia Municipal de Saúde e Previdência
e Assistência Social