



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE

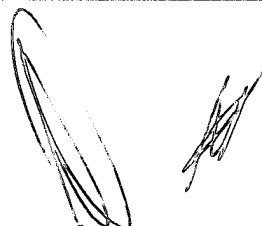


PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

ART. 3º - B DA PORTARIA MPS 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 | | Nº / ANO: | 023 /2019 - GI | |
| Unidade Gestora do RPPS | | OF. Nº: | 023 /2019 - GI | |
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores | | Data: | 06/02/19 | |
| CNPJ: 05.244.336/0001-13 | | | | |
| Valor: | | | | |
| R\$ 67.870,84 | | Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a" | | |
| Sessenta e sete mil, oitocentos e setenta reais e oitenta e quatro 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 | | | |
| CNPJ do Fundo: | PODER PÚBLICO | | | |
| Segmento: | 13.397.466/0001-14 | | | |
| Tipo de Ativo: | FI Renda Fixa - Geral | | | |
| Tipo de operação realizada: | Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a" | | | |
| Valor da operação: | Resgate | | | |
| Quantidade de Cotas: | R\$ 67.870,84 | | | |
| Valor da Cota (R\$): | 42.741,37130280 | | | |
| Data da Operação: | R\$ 1,58794 | | | |
| Data de Liquidação: | 06/02/2019 | | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ | 470.504.980,00 | | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,014% | | | |
| Limite Máximo por PL do fundo | 15,00% | | | |
| Banco/Agência/Conta: | Banco do Brasil S.A. | 3234-4 | 7.909-X | |
| 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\$ 9.087.500.610,00 | | | |
| % 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. | 1,53% | | | |
| 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\$ | 9.541.897.525,80 | | |
| % 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: | CDI | |
| 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 RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações | |
| | Data da reunião do Comitê de Investimentos | 14/01/2019 |
| 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)


PROPORLENTE

Anderson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 052.430.264-25

Entidade Certificadora: ANBIMA

CFA 20 e CFA

Validade da Certificação: 05/12/2020


GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CFA 20 e CFA

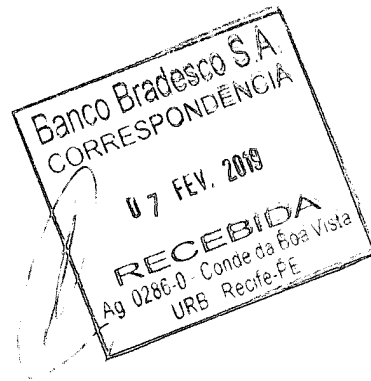
Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

RECI
PREV

Recife, 06 de fevereiro de 2019

Ofício RECIPREV nº 023/2019 – GI



Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 67.870,84 (Sessenta e sete mil, oitocentos e setenta reais e oitenta e quatro 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 023/2019

Atenciosamente,



JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA
GERENTE DE PREVIDÊNCIA

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

Associação Municipal de Previdência e Assistência Social - Fundação de Previdência Social - Saúde - Recife - PE
Av. Manoel de Barros 1488 - Cep: 50010-001 - Fone: (51) 3350-1133 - Fax: (51) 3350-1133 - 3350-1133

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 Fianço: 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

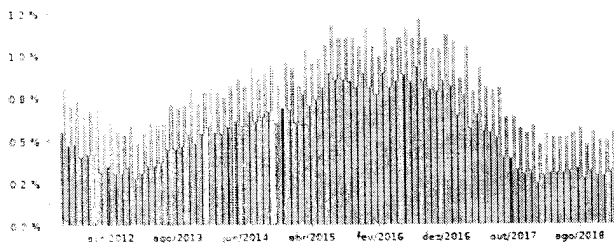
| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | jan/19 | dez/18 | nov/18 | out/18 | set/18 | ago/18 | jul/18 | jun/18 | mai/18 | abr/18 | mar/18 | fev/18 |
|-------------|--------|-------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo | 58,79 | 0,37 | 3,66 | 10,08 | 21,70 | 0,32 | 0,29 | 0,29 | 0,32 | 0,27 | 0,33 | 0,31 | 0,30 | 0,30 | 0,30 | 0,29 | 0,25 |
| % do CDI | 62,12 | 58,32 | 56,89 | 60,99 | 66,14 | 58,31 | 58,33 | 58,15 | 58,28 | 58,62 | 58,41 | 58,08 | 58,23 | 58,26 | 58,38 | 54,10 | 52,98 |
| CDI | 94,65 | 0,64 | 6,43 | 16,53 | 32,82 | 0,54 | 0,49 | 0,49 | 0,54 | 0,47 | 0,57 | 0,54 | 0,52 | 0,52 | 0,52 | 0,53 | 0,46 |
| Ibovespa | 43,08 | 7,68 | 12,61 | 47,18 | 134,22 | 10,82 | -1,81 | 2,38 | 10,19 | 3,48 | -3,21 | 8,88 | -5,20 | -10,87 | 0,88 | 0,01 | 0,52 |
| IBX | 79,95 | 7,74 | 13,42 | 48,79 | 131,28 | 10,71 | -1,29 | 2,66 | 10,42 | 3,23 | -3,13 | 8,84 | -5,19 | -10,91 | 0,82 | 0,08 | 0,42 |
| IGP-M | 49,31 | 0,08 | 6,81 | 6,41 | 13,47 | 0,01 | -1,08 | -0,49 | 0,89 | 1,52 | 0,70 | 0,51 | 1,87 | 1,38 | 0,57 | 0,64 | 0,07 |

| 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 | 1,5879425 | 470.504,98 | 387.138,29 | 0,01% | - | 0,00% | 0,55 | 0,01% | 0,33% | 0,27% | 0 |
| CDI | - | - | - | 0,01% | - | 0,00% | 1,00 | 0,00% | 0,57% | 0,47% | 0 |

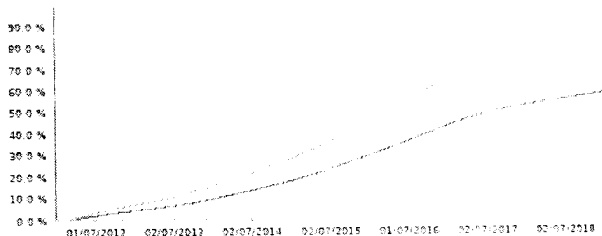
Gráficos

Fundo CDI

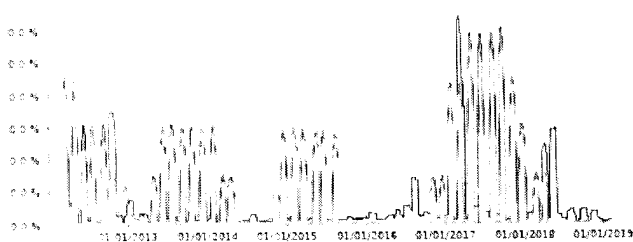
Retorno Mensal - 17/02/2012 a 06/02/2019 (mensal)



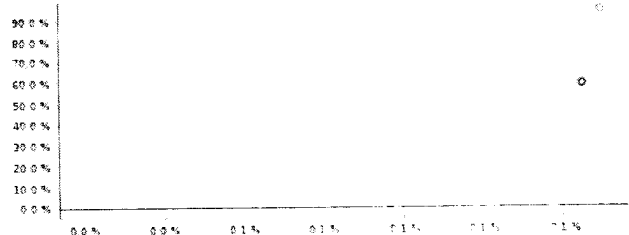
Retorno Acumulado - 17/02/2012 a 06/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 17/02/2012 a 06/02/2019 (diária)

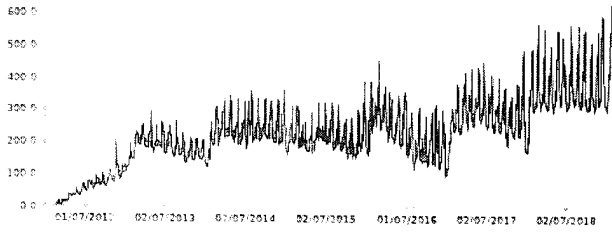


Risco x Retorno - 17/02/2012 a 06/02/2019 (diária)

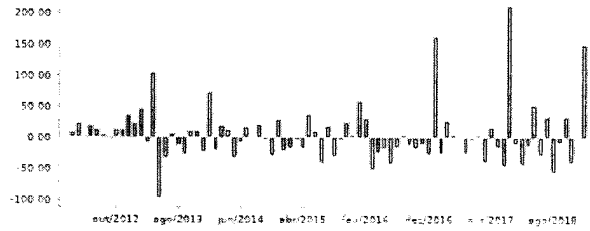


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo Administrador ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundos 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 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 obrigação de coleta de recursos financeiros adicionais para o 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 avaliação da performance de 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 as seguintes fontes: Central de Operações de Mercado de Capitais (CVM).

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/02/2012 a 06/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/02/2012 a 06/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

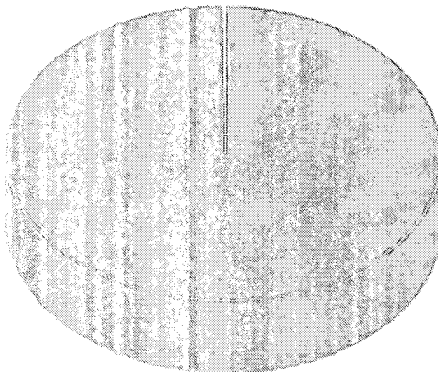
| FUNDO | % do PL | Mês | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | | Volatilidade | 12 meses PL Médio |
|--------------------------------|---------|---------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|--------------|----------------------|
| | | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | | |
| BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO | 100,20 | 0,10 | 99,21 | 406,40 | 98,88 | 406,40 | 98,88 | 406,40 | 98,88 | - | R\$ 1.632.356.461,93 |

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

| Tipo de Aplicação | jan/19 | dez/18 | nov/18 | out/18 | set/18 | ago/18 | jul/18 | jun/18 |
|------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Cotas de Fundos | 100,20% | 100,26% | 100,25% | 100,22% | 100,23% | 100,27% | 100,22% | 100,23% |
| 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 | -0,20% | -0,26% | -0,25% | -0,22% | -0,23% | -0,28% | -0,22% | -0,23% |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 469.999,47 | 319.115,13 | 319.547,29 | 357.827,38 | 324.239,25 | 332.030,88 | 387.968,04 | 353.037,72 |
| Data da Divulgação | 06/02/2019 | 07/01/2019 | 05/12/2018 | 06/11/2018 | 02/10/2018 | 05/09/2018 | 03/08/2018 | 05/07/2018 |

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2019



| | |
|---|----------|
| Cotas de BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO | 100,20 % |
| Outros Valores a pagar | -0,20 % |
| 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 índice desta marca e por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia de Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou garantia de Fidelity. Qualquer de crédito. O retorno obtido no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias empregadas pelo fundo podem não ser adequadas para todos os tipos de investidores. Os fundos de investimento podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado, e a consequente obrigação de resgate de parte ou de todos os valores aplicados para cobrir o montante do fundo. Ao investir, é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento no aplicativo ou nos sites. Para informações de performance de um fundo de investimento, recomendamos a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas as informações da página 2 do Relatório Anual.

Acertos

SANDRA MARIA GOMES GALINDO

Hoje, 15:34 JOSE MARCOS ALVES DE BARROS;

Zé Marcos, boa tarde!

Solicitamos o resgate de aplicações financeira da conta 65000-5 do Bradesco no valor de R\$ 68.868,84 (sessenta e oito mil, oitocentos e sessenta e oito reais e oitenta e quatro centavos),

uma vez que o valor anterior foi acrescentado R\$ 998,00 (novecentos e oitenta oito reais) referente ao pagamento de janeiro/2019 dos APO/PPR, transmitido eletronicamente pela EMPREL com a data de pagamento para 06/02/2019, FUNDO RECIPIREV.

Sandra Galindo

3355-1645