



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:	037 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	037 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	19/02/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 16.144.049,78		Fundos 100% Titulos Publicos - Art. 7º, I, "b"		
Dezessis milhões, cento e quarenta e quatro mil, quarenta e nove reais e setenta e oito centavos				
Sim para todos os fundos desta APR				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO			
CNPJ do Fundo:	14.386.926/0001-71			
Segmento:	FI 100% Titulos Publicos			
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Titulos Publicos - Art. 7º, I, "b"			
Tipo de operação realizada:	Aplicação			
Valor da operação:	R\$ 16.144.049,78			
Quantidade de Cotas:	7.963.706,53555613			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,02770			
Data da Operação:	19/02/2019			
Data de Liquidação:	19/02/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	7.972.429.970,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,202%			
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%			
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5	
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	30/10/2018			
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 68.942.247.010,00			
% 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.	17,22%			
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	30/10/2018			
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	67.678.890.937,25		
% Recursos do Gestor com RPPS	20,26%			
Empresa de Rating	itch Ratings			
Conceito	Forte			
Representação do conceito	Muito bom			
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim			
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018			

Data de início FI:	16/08/2012	
Taxa Administração do FI (%):	0,20	
Índice de Referência do FI:	IDKA IPCA 2A	
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:	Não	
CNPJ do Fundo:	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 proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Duração Constante ANBIMA - segmento IPCA 2A (IDKA IPCA 2A), não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.
	Principais riscos do fundo:	Risco de mercado, de crédito e diversos outros.
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
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	0,92%	
Retorno Médio Anual	11,57%	
Retorno Total	101,85%	

Maior Retorno		2,90%
Menor Retorno		-0,91%
Qtde. mês Positivo		70
Qtde. mês Negativo		7
Qtde. mês acima do Benchmark		27
Qtde. mês abaixo do Benchmark		50
Risco Mensal Período		0,77%
Risco Mensal 12 MESES		0,79%
Risco Anual do Período		2,65%
Retorno Relativo ao Benchmark		14,22%
Sharpe		0,99
Information Ratio		0,78
Tracking Error		0,62%
VAR HISTÓRICO (95%)		2,18%
VAR 12 MESES (95%)		2,03%
Sharpe Modificado		1,40
Beta (12 meses)		0,60
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,18%
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 RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/01/2019
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?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	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. 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)

PROPRIETÁRIO

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 05.7430.264-25

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 05/12/2020

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.376.354-00

Entidade Certificadora: ANRIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 19 de fevereiro de 2019

Ofício RECIPREV nº 037/2019 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 16.144.049,78 (Dezesseis milhões, cento e quarenta e quatro mil, quarenta e nove reais e setenta e oito centavos), no fundo CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71, vinculado à conta 4-5.

Informamos que encaminhamos TED via Banco do Brasil S.A., com os dados a seguir:

Banco: Caixa Econômica Federal
Agência: 50-7
Conta: 00000004-5
Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev
CNPJ: 07.749.668/0001-85
Valor: R\$ 14.500.000,00 (Quatorze milhões e quinhentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 037/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

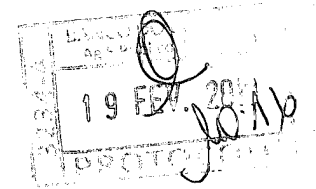
Ilma Senhora
MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ - Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA


19/02/19

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 19 de fevereiro de 2019



Ofício RECIPREV nº 1A/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos encaminhar TED, vinculado à conta 7.909-X, conforme dados a seguir:

Banco: Caixa Econômica Federal
Agência: 50-7
Conta: 00000004-5
Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev
CNPJ: 07.749.668/0001-85
Valor: R\$ 14.500.000,00 (Quatorze milhões e quinhentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 037/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilmo Senhor
PEDRO PAULO
Gerente de Relacionamento
Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE

NESTA Agência Municipal de Previdência e Assistência Social (Reciprev) – Departamento de Reciprev
Rua Manoel de Azevedo 488, Cep: 50070-000, Boa Vista, Recife - PE
Fone/Fax: (81) 3335 1650 / 3335 1647

Características

CNPJ: 14.386.926/0001-71
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 310638
 Início do Fundo: 16/08/2012

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

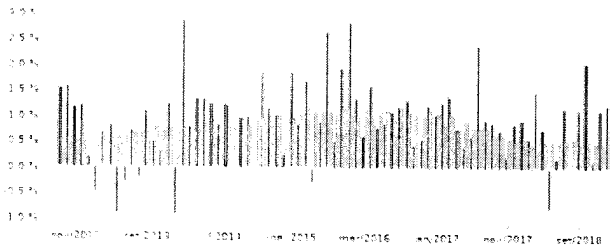
Retorno (%)	Inici.	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18
Fundo	102,72	1,58	9,86	22,55	38,08	1,27	1,16	0,13	2,08	1,15	0,01	1,19	0,21	-0,79	0,78	1,52	0,57
% do CDI	117,93	182,61	153,61	138,49	117,22	233,13	234,65	26,83	383,90	246,16	0,92	219,34	40,19	-152,36	151,38	285,19	121,82
CDI	87,11	0,87	6,42	16,28	32,48	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	64,28	11,12	15,17	47,69	143,59	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	89,91	11,04	15,99	48,94	140,65	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,06	0,42
IGPM	42,29	0,26	6,97	6,53	12,98	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	Vezezeza de Embalsak
Fundo	2.027.203	7.972.429,97	6.002.148,78	2,35%	-2,35%	1,12%	4,84	2,35%	2,08%	-0,79%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	6

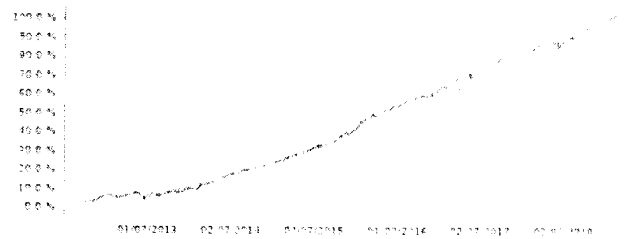
Gráficos

□ Fundo ■ CDI

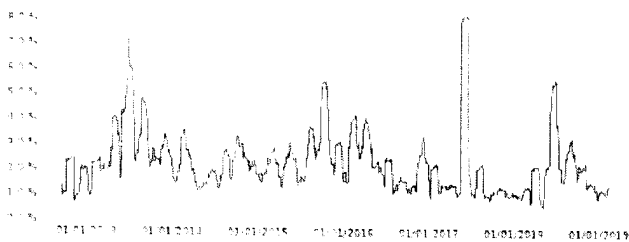
Retorno Mensal - 17/03/2012 a 19/02/2019 (mensal)



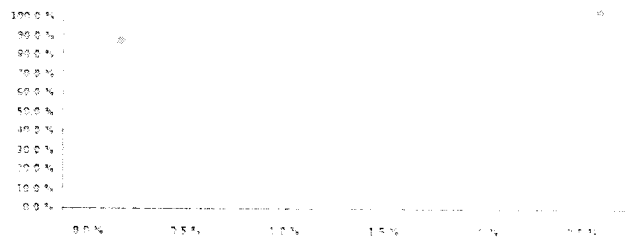
Retorno Acumulado - 17/08/2012 a 19/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 17/08/2012 a 19/02/2019 (diária)

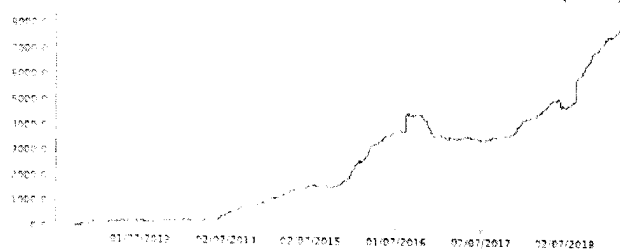


Risco x Retorno - 17/08/2012 a 19/02/2019 (diária)

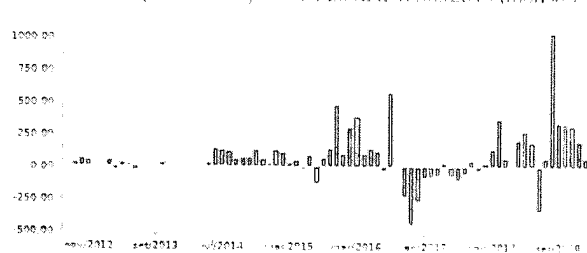


As informações aqui apresentadas são para fins informativos e não constituem recomendação de investimento. O retorno passado não representa garantia de estabilidade futura. As estratégias aqui divulgadas são aplicadas somente em condições de mercado favoráveis e não representam garantia de resultados futuros. O fundo é um veículo de investimento em títulos públicos ou privados, com elevadas correlações, cuja responsabilidade pela segurança do investimento é do investidor. O fundo é um veículo de investimento em títulos públicos ou privados, com elevadas correlações, cuja responsabilidade pela segurança do investimento é do investidor. O fundo é um veículo de investimento em títulos públicos ou privados, com elevadas correlações, cuja responsabilidade pela segurança do investimento é do investidor. O fundo é um veículo de investimento em títulos públicos ou privados, com elevadas correlações, cuja responsabilidade pela segurança do investimento é do investidor.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 19/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 19/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

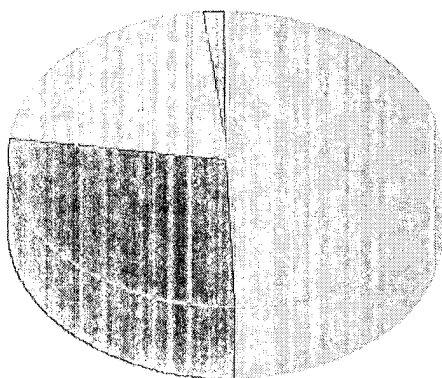
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

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
Títulos Públicos	98,29%	98,19%	97,81%	97,83%	98,10%	97,30%	98,34%	99,56%
Operações Compromissadas	1,71%	1,82%	2,19%	2,17%	1,91%	2,71%	1,67%	0,44%
Valores a receber	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	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	7.762.559,32	7.593.758,54	7.304.520,06	6.974.089,25	6.494.582,56	6.077.575,26	5.028.426,83	4.897.194,28
Data da Destinação	04/02/2019	07/01/2019	07/12/2018	07/11/2018	04/10/2018	05/09/2018	06/08/2018	09/07/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2019



NTN-B - Venc. 15/08/2020	49,2%
NTN-B - Venc. 15/05/2021	27,71%
NTN-B - Venc. 15/08/2022	21,13%
Operações Compromissadas - LTN - Venc. 01/10/2019	1,1%
NTN-B - Venc. 15/05/2019	0,13%
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00%
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00%
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00%
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00%
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00%
Valores a pagar / Taxa Celip	0,00%
Outras Disponibilidades	0,00%

Este documento contém informações de natureza confidencial e é destinado apenas para o uso exclusivo dos destinatários mencionados. Não deve ser divulgado nem utilizado para fins não autorizados. A Caixa Investimentos não se responsabiliza por danos ou prejuízos decorrentes do uso indevido das informações aqui contidas. Os dados aqui apresentados são apenas para fins informativos e não constituem recomendação de investimento. A Caixa Investimentos é uma instituição de corretagem autorizada pelo Conselho Monetário Nacional e pelo Banco Central do Brasil para a prestação de serviços de corretagem de valores mobiliários e de administração de fundos de investimento em valores mobiliários. A Caixa Investimentos é uma instituição de corretagem autorizada pelo Conselho Monetário Nacional e pelo Banco Central do Brasil para a prestação de serviços de corretagem de valores mobiliários e de administração de fundos de investimento em valores mobiliários. A Caixa Investimentos é uma instituição de corretagem autorizada pelo Conselho Monetário Nacional e pelo Banco Central do Brasil para a prestação de serviços de corretagem de valores mobiliários e de administração de fundos de investimento em valores mobiliários.