



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:	042 /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	042 /2019 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	27/02/19
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 8.340.000,00	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Oito milhões, trezentos e quarenta mil reais			
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO		
CNPJ do Fundo:	11.060.913/0001-10		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 8.340.000,00		
Quantidade de Cotas:	3.076.633,63158972		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,71076		
Data da Operação:	27/02/2019		
Data de Liquidação:	27/02/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	8.994.272.120,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,093%		
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\$ 71.908.898.780,00		
% 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.	17,75%		
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\$	70.541.460.508,25	
% Recursos do Gestor com RPPS	20,77%		
Empresa de Rating	Fitch 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:	28/05/2010	
Taxa Administração do FI (%):	0,20	
Índice de Referência do FI:	IMA-B 5	
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 subíndice do Índice de Mercado ANBIMA série B 5 - IMA-B 5, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. O prazo médio da carteira do FUNDO será superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias. É vedada ao FUNDO a aplicação de recursos em cotas de fundos de investimento, de qualquer modalidade.
	Principais riscos do fundo:	O cotista está sujeito aos seguintes riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO aplica seus recursos. Risco de mercado: variação dos preços e cotações de mercado dos ativos que compõem a carteira do FUNDO e os demais riscos constantes do regulamento do fundo (Risco 3)
	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	0,97%	
Retorno Médio Anual	12,26%	
Retorno Total	154,69%	

Maior Retorno		3,61%
Menor Retorno		-1,59%
Qtde. mês Positivo		87
Qtde. mês Negativo		10
Qtde. mês acima do Benchmark		16
Qtde. mês abaixo do Benchmark		82
Risco Mensal Período		0,85%
Risco Mensal 12 MESES		1,16%
Risco Anual do Período		2,94%
Retorno Relativo ao Benchmark		2,05%
Sharpe		0,72
Information Ratio		-1,80
Tracking Error		0,16%
VAR HISTÓRICO (95%)		2,37%
VAR 12 MESES (95%)		2,19%
Sharpe Modificado		0,96
Beta (12 meses)		0,92
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,05%
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 Prvidência 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	20/02/2019
Outras Observações:	Destinado ao pagamento da folha de fevereiro de 2019	
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)

PROPOSTANTE

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPI 052 430 264 25

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CFA

Validade da Certificação: 05/12/2020

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves do Barros

Gerente de Investimentos

CPI 334 326 454 00

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 27 de fevereiro de 2019

Ofício RECI-REV nº 042/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 8.340.000,00 (Oito milhões, trezentos e quarenta mil reais), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 11.060.913/0001-10, vinculado à conta 4-5, e efetuar a TED conforme a seguir:

Banco: Banco Bradesco S.A. (237)

Agência: 0286-0

Conta Corrente: 65.000-5

Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev

CNPJ: 07.749.668/0001-85

Valor: R\$ 8.340.000,00 (Oito milhões, trezentos e quarenta mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 042/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO


Manoel Carlos Soares Cardoso
Diretor Presidente
Instit. 100.240.933
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Serv. Públ.

Ilma Senhora

MARIA VERÔNICA GALINDO

Gerente de Atendimento PJ - Público

Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo

NESTA

NESTA



JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>

Folha de fevereiro/2019 das empresas 23, 24 e 18

1 mensagem

SANDRA MARIA GOMES GALINDO <sandra.galindo@recife.pe.gov.br>

26 de fevereiro de 2019

15:58

Para: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>

Cc: ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA <annap@recife.pe.gov.br>, SANDRA MARIA GOMES GALINDO <sandra.galindo@recife.pe.gov.br>

Zé Marcos, boa tarde!

Solicitamos o resgate de aplicações financeira da conta 65000-5 do Bradesco no valor de R\$ **8.340.919,34**(oito milhões, trezentos e quarenta mil, novecentos e dezenove reais e trinta e quatro centavos), referente ao pagamento de **fevereiro/2019 dos APO/PPR e PEN**, transmitido eletronicamente pela EMPREL com data de pagamento previsto para o dia **28/02/2019, FUNDO RECIPREV.**

Informamos o valor líquido de **R\$ 21.140.164,80**(vinte e um milhões, cento e quarenta mil, cento e sessenta e quatro reais e oitenta centavos), referente a folha de fevereiro/2019 dos APO/PPR e PEN do FUNDO RECIFIN.

AUT. PREV. MUN. RECIFE - RECIPREV

SAÚDE RECIFE - Valor líquido R\$ **51.230,98**(cinquenta e um mil, duzentos e trinta reais e noventa e oito reais)

PREVIDÊNCIA - Valor líquido R\$ **169.880,09**(cento e sessenta e nove mil, oitocentos e oitenta reais e nove centavos)

Sandra Galindo
3355-1645

Características

CNPJ: 11.060.913/0001-10
 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: 251496
 Início do Fundo: 09/07/2010

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

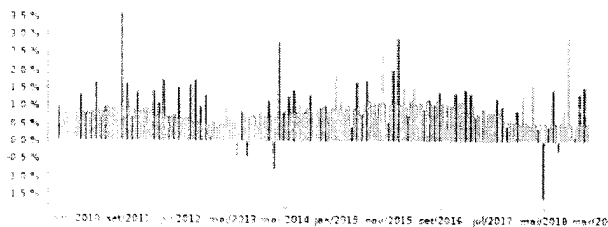
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18
Fundo	171,08	2,09	10,03	23,31	39,09	1,53	1,38	0,13	3,10	0,86	-0,27	1,46	0,42	-1,59	0,41	1,60	0,53
% do CDI	129,67	205,72	156,41	144,62	121,16	282,28	279,27	27,30	570,35	183,03	-47,67	269,61	81,30	-306,67	78,31	300,92	114,38
CDI	131,93	1,01	6,41	16,12	32,26	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	53,30	10,72	11,93	41,99	128,85	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	102,11	10,63	12,82	43,28	126,46	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	66,83	0,85	7,57	7,13	13,19	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	2.710755	8.994.272,12	8.370.858,43	3,05%	-3,09%	1,45%	-5,32	3,05%	3,10%	-1,59%	6
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

Gráficos

Fundo CDI

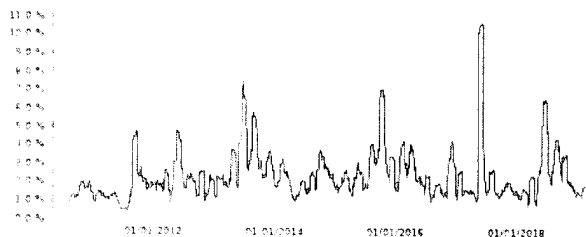
Retorno Mensal - 12/07/2010 a 27/02/2019 (mensal)



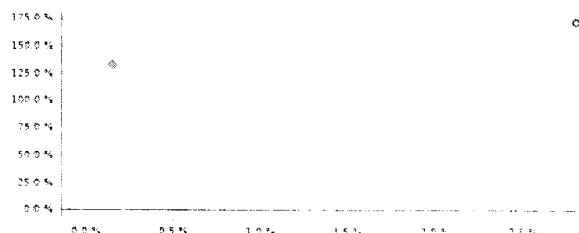
Retorno Acumulado - 12/07/2010 a 27/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 12/07/2010 a 27/02/2019 (diária)



Risco x Retorno - 12/07/2010 a 27/02/2019 (diária)



Resultado passado não é indicativo para o futuro. Títulos públicos ou privados considerados confiáveis. Não há responsabilidade pela criação e manutenção da classificação por parte do INPI. Não há garantia de que o emissor ou o titular das obrigações de seu grupo empresarial, as informações disponíveis não devam ser ordenadas como preferências dos credores em caso de liquidação do emissor ou do grupo empresarial. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. Gestão da carteira de qualquer investidor em qualquer momento. O risco de crédito do emissor do fundo e do investidor pode resultar em significativas perdas para seus colistas superiores ao capital aplicado e a consequente abitação do contrato de aplicação pode resultar em perda de principal do investidor. As informações são recomendadas a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao qual se refere. Para mais informações consulte o site do fundo de investimento. Fonte: Quantis. Ass.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 12/07/2010 a 27/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 12/07/2010 a 27/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

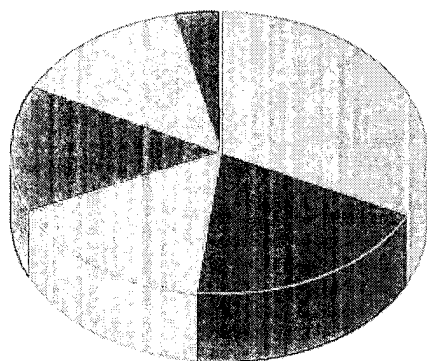
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

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	96.33%	97.51%	96.39%	89.96%	98.36%	98.42%	98.02%	98.47%
Operações Compromissadas	3.68%	2.50%	3.62%	10.05%	1.65%	1.58%	1.98%	1.53%
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	-0.00%	-0.00%	-0.00%	-0.00%	-0.00%	-0.00%	0.00%	0.00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	8 675 733,04	11 498 930,14	9 736 339,71	9 298 896,03	8 106 459,15	8 138 580,05	7 322 766,49	7 668 949,04
Data da Divulgação	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 15/08/2022	32.09%
NTN-B - Venc 15/05/2023	19.67%
NTN-B - Venc 15/05/2021	16.19%
NTN-B - Venc 15/05/2019	14.48%
NTN-B - Venc 15/08/2020	13.89%
Operações Compromissadas - LTN - Venc 01/01/2020	3.68%
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 Cetip	0.00%
Outras Disponibilidades	0.00%

Avaliação feita com base em fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela CAIXA BRASIL IMA-B. A CAIXA BRASIL IMA-B não se responsabiliza por qualquer perda decorrente da utilização das informações aqui apresentadas. As informações aqui apresentadas não devem ser entendidas como recomendação de investimento ou qualquer outra recomendação de natureza financeira. Os dados aqui apresentados não representam a garantia de Administração do fundo. O custo da carteira de qualquer investidor no fundo é a soma de todos os custos operacionais do fundo, incluindo a taxa de administração, a taxa de custódia e a taxa de auditoria. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, incluindo a utilização de opções, podem resultar em perdas significativas para seus detentores, superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de restituição ao investidor. A CAIXA BRASIL IMA-B não garante a liquidez do fundo e a recompra a futuro do fundo de investimentos ao aplicar seus recursos em valores mobiliários de prazo superior a 12 (doze) meses. Os valores colados estão em Real (R\$) e para os cálculos foram utilizados os dados disponíveis no site da CAIXA BRASIL IMA-B.