



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:	061 /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	061 /2019 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	18/03/19
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 2.355.000,00		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
Dois milhões, trezentos e cinquenta e cinco mil reais			
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	BRADESCO FI RE IRI – M 1 TP		
CNPJ do Fundo:	11.484.558/0001.06		
Segmento:	FI Renda Fixa - Geral		
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 2.355.000,00		
Quantidade de Cotas:	0,22724660		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 10.363.191,30000		
Data da Operação:	18/03/2019		
Data de Liquidação:	18/03/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	470.523.530,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,501%		
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%		
Banco/Agência/Conta:	Banco Bradesco S.A.	0286-0	65000-5
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\$ 9.571.240.390,00		
% 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.	1,60%		
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\$	10.176.401.312,23	
% Recursos do Gestor com RPPS	1,68%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Excelente		
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:	02/07/2010	
Taxa Administração do FI (%):	0,20	
Índice de Referência do FI:	IRF M1	
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 realizar 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 FUNDO tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas rentabilidade que busque superar a variação do IRF M 1, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável. A rentabilidade do FUNDO variará conforme o comportamento da variação dos preços dos ativos financeiros e modalidades operacionais em carteira, sendo também impactada pelos custos, pelas despesas e pela taxa de administração de 0,20% (vinte centésimos 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 Sistemático, Risco Tributário
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco 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	0,83%	
Retorno Médio Anual	10,44%	
Retorno Total	123,12%	

Maior Retorno	1,65%
Menor Retorno	0,17%
Qtde. mês Positivo	97
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	24
Qtde. mês abaixo do Benchmark	74
Risco Mensal Período	0,27%
Risco Mensal 12 MESES	0,17%
Risco Anual do Período	0,95%
Retorno Relativo ao Benchmark	-1,76%
Sharpe	0,32
Information Ratio	-1,29
Tracking Error	0,19%
VAR HISTÓRICO (95%)	1,28%
VAR 12 MESES (95%)	0,99%
Sharpe Modificado	1,38
Beta (12 meses)	0,96
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,06%
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 RECIPIRV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos 11/03/2019
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?	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)

PROPOSTANTE

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF 371.326.354-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF 371.326.354-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

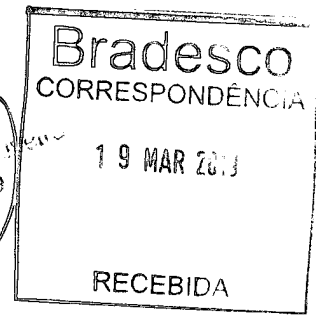
SAÚDE
RECIFE

RECI
PREV

Recife, 18 de março de 2019

Ofício RECIPREV nº 061/2019 – GI

Alvaro A. N. de Oliveira
Gerente



Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 10.363.191,30 (Dez milhões, trezentos e sessenta e três mil, cento e noventa e um reais e trinta centavos) no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14, vinculado à conta 65.000-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 061/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilmo Senhor
YURI GONDIM DE MATOS
Gerente
Banco Bradesco S.A. - Agência Conde da Boa Vista - Recife -PE
NESTA

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 Fundo: 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

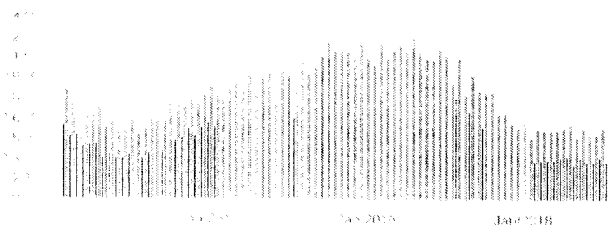
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18
Fundo	59,39	0,75	3,68	9,49	20,88	0,29	0,32	0,29	0,29	0,32	0,27	0,33	0,31	0,30	0,30	0,30	0,29
% do CDI	61,93	58,24	57,50	59,92	65,54	58,37	58,31	58,33	58,15	58,28	58,62	58,41	58,08	58,23	58,26	58,38	54,10
CDI	95,90	1,29	6,40	15,85	31,86	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53
Ibovespa	51,18	13,78	16,20	54,83	105,47	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01
IRIX	89,82	13,65	16,97	55,73	105,79	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08
IGPM	50,86	1,11	7,53	7,39	13,00	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64

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	1,5938877	470.423,53	400.448,21	0,01%	-	0,00%	0,58	0,01%	0,33%	0,27%	0
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

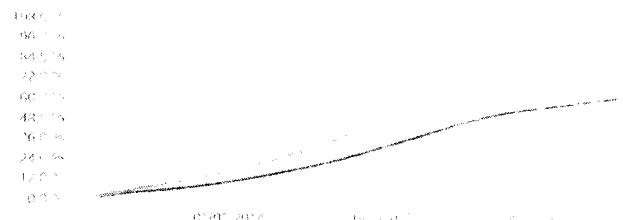
Gráficos

Fundo CDI

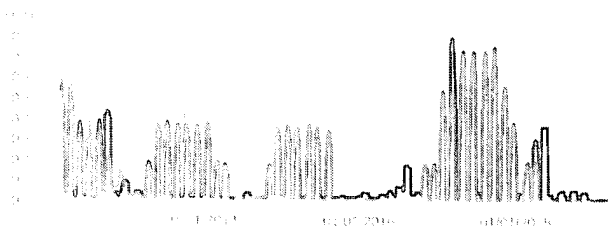
Retorno Mensal - 17/02/2012 a 18/03/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 17/02/2012 a 18/03/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 17/02/2012 a 18/03/2019 (diária)



Risco x Retorno - 17/02/2012 a 18/03/2019 (diária)

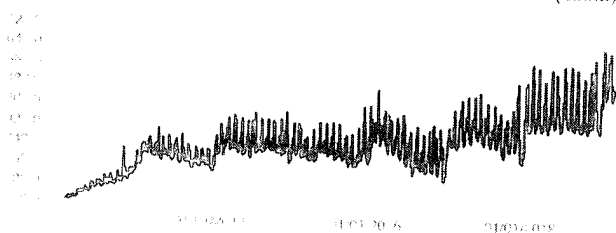


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção dos dados cabe ao emissor. Não há garantia de que as informações sejam atualizadas e corretas. As informações não devem ser entendidas como recomendação de compra ou venda de cotas de fundo de investimento. O CDI é o índice utilizado no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com destinação específica para a aplicação de recursos em renda fixa de curto prazo do fundo. As informações são fornecidas para fins informativos e não devem ser utilizadas para a tomada de decisão de investimento. Para obter mais informações, consulte o regulamento do fundo de investimento em aplicação nos sites: www.bancobradesco.com.br ou www.fundobrad.com.br. Para os clientes, consulte a tabela de honorários em www.fundobrad.com.br.

BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO

18/03/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/02/2012 a 18/03/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/02/2012 a 18/03/2019 (mensal)



Composição da Carteira

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

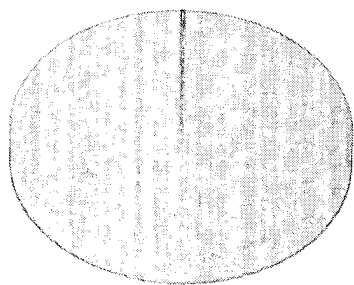
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	100,19	0,24	99,15	409,62	98,88	409,62	98,88	-	PL Médio R\$ 1.730.626.666,86

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

Tipo de Aplicação	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18
Cotas de Fundos	100,19%	100,20%	100,26%	100,25%	100,22%	100,23%	100,27%	100,22%
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	-0,19%	-0,20%	-0,26%	-0,25%	-0,22%	-0,23%	-0,28%	-0,22%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	536.574,83	469.999,47	319.115,13	319.547,29	357.827,38	324.239,25	332.030,88	387.968,04
Data da Divulgação	07/03/2019	06/02/2019	07/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	02/10/2018	05/09/2018	03/08/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

■ Cotas de BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	100,19 %
■ Outros Valores a pagar	-0,19 %
■ 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 exatidão e veracidade não é assumida pela BRAM FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO. A BRAM FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO não se responsabiliza por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendações distribuídas em favor de qualquer ativo ou instrumento financeiro. O objetivo do fundo é obter o melhor desempenho possível em conformidade com a estratégia de investimento do fundo. O retorno do fundo no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias de derivativos, utilizadas para a proteção da carteira do fundo, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado, e a consequente obrigação de cotistas de resgatar cotas, mesmo que não tenham cotado o fundo. A administração recomenda a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para a obtenção de informações detalhadas sobre o fundo, consulte a página de informações do fundo em www.bram.com.br.