



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: | 069 /2019 - GI | |
| Unidade Gestora do RPPS | OF. Nº: | 069 /2019 - GI | |
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores | Data: | 19/03/19 | |
| CNPJ: 05.244.336/0001-13 | | | |
| Valor: | Fundos 100% Titulos Publicos - Art. 7º, I, "b" | | |
| R\$ 7.648.307,61 | | | |
| Sete milhões, seiscentos e quarenta e oito mil, trezentos e sete reais e sessenta e um centavos | | | |
| Sim para todos os fundos desta APR | | | |
| HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS: | | | |
| Fundo: | SUL AMÉRICA INFLATIE FII RF LONGO PRAZO | | |
| CNPJ do Fundo: | 09.326.708/0001-01 | | |
| 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\$ 7.648.307,61 | | |
| Quantidade de Cotas: | 188.392.382,7713 | | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 40,59775 | | |
| Data da Operação: | 19/03/2019 | | |
| Data de Liquidação: | 19/03/2019 | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ | 874.267.690,00 | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,875% | | |
| Limite Máximo por PL do fundo | 15,00% | | |
| Banco/Agência/Conta: | Banco do Brasil S.A. | 3234-4 | 7.909-X |
| Administrador: | BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | | |
| CNPJ do Administrador: | 00.066.670/0001-00 | | |
| Data do Termo de Credenciamento do Administrador: | 23/10/2018 | | |
| Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN | Sim | | |
| Volume de Recursos do Administrador com RPPS | R\$ 1.958.781.430,00 | | |
| % 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. | 0,70% | | |
| Gestor: | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S/A | | |
| CNPJ do Gestor: | 21.813.291/0001-07 | | |
| Data do Termo de Credenciamento do Gestor: | 03/11/2018 | | |
| Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN | | | |
| Volume de Recursos do Gestor com RPPS | R\$ | 548.821.805,37 | |
| % Recursos do Gestor com RPPS | 1,93% | | |
| Empresa de Rating | Standard&Poor's | | |
| Conceito | AMP+3 | | |
| Representação do conceito | Excelente | | |
| O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN | Sim | | |
| Distribuidor: | PERFORME AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS FIRELI | | |
| CNPJ do Distribuidor: | 10.819.611/0001-10 | | |
| Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor: | 14/11/2018 | | |

| | | |
|--|---|---|
| Data de Início FI: | | 10/07/2008 |
| Taxa Administração do FI (%): | | 0,40 |
| Índice de Referência do FI: | | IMA-B |
| Tx Performance do FI (%): | | 0,20 |
| Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não): | | IMA-B |
| 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): | | 2 |
| 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 observa as vedações estabelecidas nas resoluções do CMN nºs 3.792 e 3.922, investindo no mínimo 80% (oitenta por cento) da carteira em ativos relacionados direta ou indiretamente a variação das taxas de juros e/ou índices de preços |
| | Principais riscos do fundo: | Inflação e diversos outros conforme o 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 | | 1,05% |
| Retorno Médio Anual | | 13,29% |
| Retorno Total | | 174,27% |

| | | |
|--|--|------------|
| Maior Retorno | | 6,85% |
| Menor Retorno | | -4,08% |
| Qtde. mês Positivo | | 73 |
| Qtde. mês Negativo | | 24 |
| Qtde. mês acima do Benchmark | | 54 |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark | | 44 |
| Risco Mensal Período | | 2,09% |
| Risco Mensal 12 MESES | | 2,45% |
| Risco Anual do Período | | 7,24% |
| Retorno Relativo ao Benchmark | | 0,89% |
| Sharpe | | 0,44 |
| Information Ratio | | 0,10 |
| Tracking Error | | 1,21% |
| VAR HISTÓRICO (95%) | | 4,50% |
| VAR 12 MESES (95%) | | 4,60% |
| Sharpe Modificado | | 0,49 |
| Beta (12 meses) | | 0,86 |
| Erro Quadrático Médio (EQM) | | 0,35% |
| 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 RFCIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações | |
| Outras Observações: | Data da reunião do Comitê de Investimentos | 11/03/2019 |
| 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 ligados 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)

PROPORONENTE

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CNPJ 374 326 354 00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CNPJ 374 326 354 00

Entidade Certificadora: ANRIMA

CPA 20 e CIA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

Recife, 19 de março de 2019

Ofício RECIPREV nº 2 A /2019 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos encaminhar TED, a débito da conta: Agência 3234-4, conta 7.909-X, conforme a seguir:

Banco: Banco Bradesco S.A. (237)

Agência: 2856-8

Conta Corrente: 19.613-4

Favorecido: SUL AMÉRICA INFLATIE FI RF LONGO PRAZO

CNPJ: 09.326.708/0001-01

Valor: R\$ 7.648.307,61 (Sete milhões, seiscentos e quarenta e oito mil, trezentos e sete reais e sessenta e um centavos)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 069/2019

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



