



**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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>		<b>Nº / ANO:</b>	<b>070 /2019 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>		<b>OF. Nº:</b>	<b>070 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	<b>19/03/19</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>			
<b>Valor:</b>			
R\$ 733,71		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Setecentos e trinta e três reais e setenta e um centavos			
Sim para todos os fundos desta APR			
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>			
<b>Fundo:</b>	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RFNDA FIXA LONGO PRAZO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	14.386.926/0001-71		
<b>Segmento:</b>	FI 100% Títulos Públicos		
<b>Tipo de Ativo:</b>	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Aplicação		
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 733,71		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	357,75077929		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,05090		
<b>Data da Operação:</b>	19/03/2019		
<b>Data de Liquidação:</b>	19/03/2019		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	8 362 730 690,00	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>		0,000%	
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>		15,00%	
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
<b>Administrador:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	30/10/2018		
<b>Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Administrador com RPPS</b>		R\$ 71 908 898 780,00	
<b>% 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.</b>		17,75%	
<b>Gestor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	30/10/2018		
<b>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	R\$	70.541.460.508,25	
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>		20,77%	
<b>Empresa de Rating</b>		Fitch Ratings	
<b>Conceito</b>		Forte	
<b>Representação do conceito</b>		Muito bom	
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN</b>		Sim	
<b>Distribuidor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	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)	<p>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.</p> <p>Principais riscos do fundo: Risco de mercado, de crédito e diversos outros</p> <p>Risco do Fundo atribuído pelo Administrador: Risco Médio</p>
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
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>	
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		28
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		1,03
Information Ratio		0,78
Tracking Error		0,62%
VAR HISTÓRICO (95%)		2,18%
VAR 12 MESES (95%)		2,03%
Sharpe Modificado		1,46
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 RFCIPRI V através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	11/03/2019
Outras Observações:		
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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 oficial(s)

PROponente

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF 834.326.354-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CEA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

Gestor/Autorizador

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF 834.326.354-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CEA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE  
RECIFE

Recife, 19 de março de 2019

RECI  
PREV

Ofício RECIPREV nº 070/2019 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 733,71 (Setecentos e trinta e três reais e setenta e um 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.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 070/2019

Atenciosamente,

  
JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

RECEBIDO  
MAR/19

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

**CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP**

19/03/2019

**Características**

CNPJ: 14.386.926/0001-71  
 Gestor: 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 (%)	Inicio	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	105,09	2,77	9,98	22,48	38,19	0,56	1,27	1,16	0,13	2,08	1,15	0,01	1,19	0,21	-0,79	0,78	1,52
% do CDI	119,51	210,73	155,95	142,04	120,03	112,92	233,13	234,65	26,83	383,90	246,16	0,92	219,34	40,19	-152,36	151,38	285,19
CDI	87,94	1,31	6,40	15,82	31,82	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	67,53	13,31	17,26	53,98	100,90	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01
IBX	93,69	13,25	17,99	54,92	101,62	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08
IIP-M	43,54	1,14	7,52	7,42	13,00	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,61

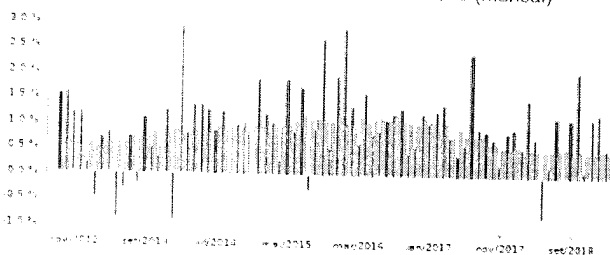
  

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze-s. Acima do Benchmark
Fundo	2,050897	8.362.730,69	6.263.908,58	2,37%	-2,35%	1,12%	3,40	2,37%	2,08%	-0,79%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

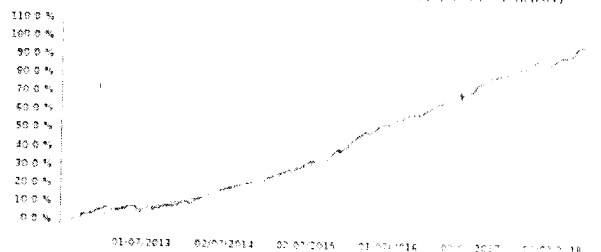
**Gráficos:**

■ Fundo ■ CDI

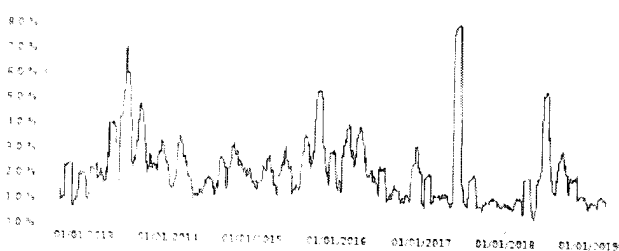
**Retorno Mensal - 17/08/2012 a 19/03/2019 (mensal)**



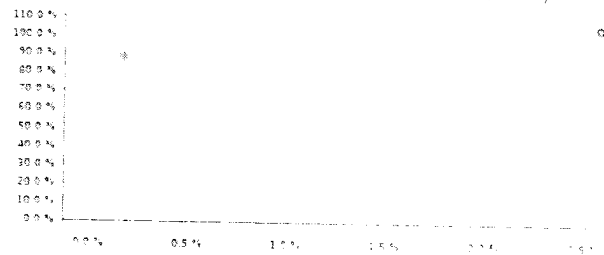
**Retorno Acumulado - 17/08/2012 a 19/03/2019 (diária)**



**Volatilidade Anualizada - 17/08/2012 a 19/03/2019 (diária)**



**Risco x Retorno - 17/08/2012 a 19/03/2019 (diária)**

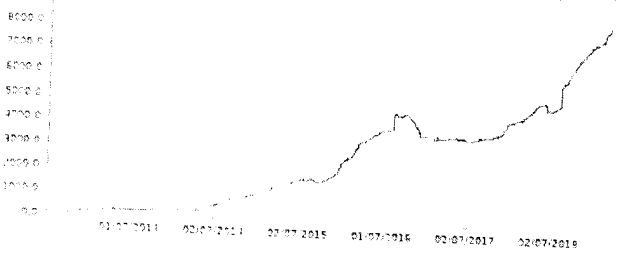


As informações contidas neste relatório pertencem a fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade das mesmas é de responsabilidade exclusiva do emissor. O emissor não se responsabiliza por danos decorrentes do uso indevido das informações contidas neste relatório. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de investimento ou qualquer outra recomendação de natureza financeira. O investidor deve realizar sua própria análise de risco e tomar suas próprias decisões de investimento. O emissor não garante a liquidez ou a rentabilidade das aplicações de investimento. O emissor não garante a segurança das aplicações de investimento. O emissor não garante a preservação do valor das aplicações de investimento. O emissor não garante a realização dos objetivos de investimento. O emissor não garante a obtenção de resultados positivos. O emissor não garante a ausência de riscos. O emissor não garante a ausência de incertezas. O emissor não garante a ausência de volatilidade. O emissor não garante a ausência de riscos de crédito. O emissor não garante a ausência de riscos de liquidez. O emissor não garante a ausência de riscos de mercado. O emissor não garante a ausência de riscos de taxa de juros. O emissor não garante a ausência de riscos de inflação. O emissor não garante a ausência de riscos de câmbio. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos políticos. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos econômicos. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos sociais. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos ambientais. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos tecnológicos. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos legais. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos regulatórios. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de força maior. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de guerra. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de terrorismo. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de pandemia. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise financeira. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise econômica. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise política. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise social. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise ambiental. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise tecnológica. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise legal. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise regulatória. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise de força maior. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise de guerra. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise de terrorismo. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise de pandemia. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise financeira. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise econômica. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise política. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise social. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise ambiental. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise tecnológica. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise legal. O emissor não garante a ausência de riscos de eventos de crise regulatória.

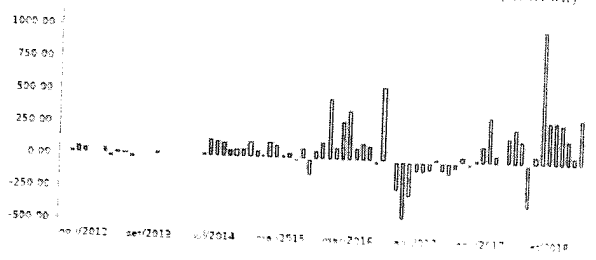
**CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP**

19/03/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 19/03/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 19/03/2019 (mensal)



Composição da Carteira

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											

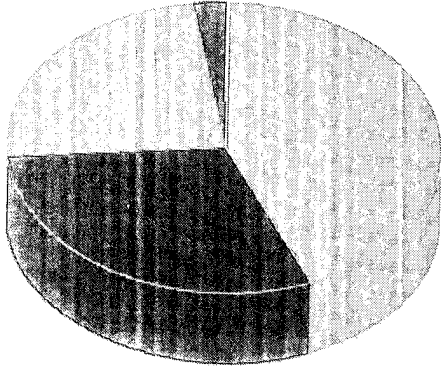
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18
Títulos Públicos	97,37%	98,29%	98,19%	97,81%	97,83%	98,10%	97,30%	98,34%
Operações Compromissadas	2,63%	1,71%	1,82%	2,19%	2,17%	1,91%	2,71%	1,67%
Valores 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)	8.185.770,17	7.762.559,32	7.593.758,54	7.304.520,06	6.974.089,25	6.494.582,56	6.077.575,26	5.028.426,81
Data da Publicação	07/03/2019	04/02/2019	07/01/2019	07/12/2018	07/11/2018	04/10/2018	05/09/2018	06/08/2018

As informações contidas neste relatório referem-se apenas a títulos públicos ou privados considerados confiáveis, cuja responsabilidade pela entrega do valor contratado cabe integralmente ao emissor, não devendo ser entendidas como garantia de retorno ou de liquidez. As informações disponíveis não devem ser utilizadas como base para decisões de investimento. A administração do fundo não garante a liquidez dos valores em qualquer momento e os valores de resgate podem não coincidir com o valor nominal devido a custos de liquidação. A administração do fundo não garante a liquidez dos valores em qualquer momento e os valores de resgate podem não coincidir com o valor nominal devido a custos de liquidação. A administração do fundo não garante a liquidez dos valores em qualquer momento e os valores de resgate podem não coincidir com o valor nominal devido a custos de liquidação.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

f. 019



■ NTN-B - Venc. 15/08/2020	43.26 %
■ NTN-B - Venc. 15/05/2021	30.05 %
■ NTN-B - Venc. 15/08/2022	24.05 %
■ Operações Compromissadas - LTN - Venc. 01/04/2019	2.63 %
■ 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 pagar / Taxa de Auditoria	0.00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0.00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0.00 %
■ Outras Disponibilidades	0.00 %
■ Outros Valores a receber	0.00 %
■ NTN-B - Venc. 15/05/2019	0.00 %

Atividades e investimentos realizados a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela obtenção e verificação dos dados cabe ao investidor. O FII não se responsabiliza por danos decorrentes de utilização indevida ou incorreta dos dados disponibilizados. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de compra ou venda de qualquer ativo financeiro. Fundos de investimento que constam com a garantia de Arredatado do fundo, Gestor da carteira, do quitante ou do investidor, não são garantidos pelo FII. Resultados obtidos no passado não representam garantia de rentabilidade futura. As estratégias de investimento adotadas pelo FII podem sofrer alterações sem aviso prévio. O FII não garante o retorno ou a preservação do valor aplicado, podendo ocorrer perdas para seus investidores, superiores ao capital aplicado e a consequente redução de seu patrimônio líquido. O FII não garante a liquidez dos investimentos, podendo ocorrer a necessidade de venda antecipada de ativos, sob pena de prejuízo para o investidor. Os dados exibidos estão em R\$ mil. Para obter mais informações, consulte o site do FII.