

PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDORES
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR
PORTARIA 1.467/2022

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Nº / ANO:	77 /2023 - GI
	OF. Nº:	77 /2023 - GI
	Data:	19/05/23
Valor:		
R\$ 10.800.000,00	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V, "b"	
Dez milhões e oitocentos mil reais		
Sim para todos os fundos desta APR		
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:		
Fundo:	MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	
CNPJ do Fundo:	19.488.768/0001-84	
Segmento:	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V, "b"	
Tipo de Ativo:	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V, "b"	
Tipo de operação realizada:	Resgate	
Valor da operação:	R\$ 10.800.000,00	
Quantidade de Cotas:	5323620,42	
Valor da Cota (R\$):	R\$	2,02869460
Data da Operação:	19/05/2023	
Data de Liquidação:	22/05/2023	
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 429.832.730,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	2,513%	
Limite Máximo por PL do fundo	5,00%	
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:	06/09/2021	
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim	
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 7.901.968.040,00	
% 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.	1,53%	
Gestor:	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	
CNPJ do Gestor:	16.500.294/0001-50	
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	27/08/2021	
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não	
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	416.961.102,05
% Recursos do Gestor com RPPS	3,90%	
Empresa de Rating	Moody's	
Conceito	MQ2	
Representação do conceito	Muito bom	
O fundo atende a Resolução 4.963/2021, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Sim	
Distribuidor:	MAGNA – AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA	
CNPJ do Distribuidor:	13.426.885/0001-37	
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	27/08/2021	

Data de Início FI:	30/09/2014	
Taxa Administração do FI (%):	0,40	
Índice de Referência do FI :	CDI	
Tx Performance do FI (%):	0,20	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	CDI	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve realizar para haver a cobrança de tx performance):	100,00	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 4.963/2021	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):	1	
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 superior à variação verificada pelo CDI (Certificados de Depósitos Interfinanceiros) a médio/longo prazo, calculado e divulgado pela CETIP S.A. - Mercados Organizados ("CETIP"), por meio de uma gestão ativa nos mercados de juros doméstica e/ou índices de preço. Os fundos de renda fixa tem como principal fator de risco de sua carteira a variação da taxa de juros doméstica ou de índice de preços, ou ambos. Eles devem possuir, no mínimo, 80% da carteira em ativos relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, ao fator de risco que dá nome à classe.
	Principais riscos do fundo:	Riscos de crédito privado, ao risco de juros do mercado doméstico ou risco de índices de preço. (Risco 2)
	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	0,59%
Retorno Médio Anual	7,34%
Retorno Total	83,65%
Maior Retorno	1,27%
Menor Retorno	-5,02%
Qtde. mês Positivo	97
Qtde. mês Negativo	6
Qtde. mês acima do Benchmark	87
Qtde. mês abaixo do Benchmark	24
Risco Mensal Período	0,82%
Risco Mensal 12 MESES	0,58%
Risco Anual do Período	2,84%
Retorno Relativo ao Benchmark	50,96%
Sharpe	1,83
Information Ratio	2,05
Tracking Error	2,45%
VAR HISTÓRICO (95%)	1,94%
VAR 12 MESES (95%)	2,15%
Sharpe Modificado	-2,10
Beta (12 meses)	-0,09
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,71%
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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos: 18/05/2023
Outras Observações:	Para comprar NTN-B 2040 direto.
Outras informações : 1	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Sim
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
Outras informações : 2	
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
Outras informações : 3	
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
Análise do regulamento e demais documentos disponibilizados pelo gestor do fundo de investimento e os riscos inerentes às operações previstas	Foram analisados os documentos disponibilizados no site da CVM, tais como: Balancete, Balanço, Composição da Carteira, Dados Diários, Informações complementares, Lâmina, Perfil mensal, Prospecto, Regulamento e também o Questionário Due Dilligence do fundo encaminhado pelo Gestor, objetivando verificar a adequação à resolução CMN 4.963/21 e a compatibilidade do fundo com a Política de investimentos, os parâmetros de rentabilidade e riscos perseguidos por este RPPS.
Adequação das características do fundo frente às necessidades de liquidez do RPPS	O Fundo Previdenciário RECIPIREV utiliza-se de estudo de ALM para equilíbrio de ativos e passivos. Atualmente o fundo tem baixa necessidade de liquidez permitindo maior volume de recursos em fundos de maior volatilidade e/ou maior prazo de resgate.
Adequação da política de seleção, alocação e diversificação de ativos e, quando for o caso, a política de concentração de ativos	Foi verificada a Política de Investimentos do Fundo para análise de conformidade com seu segmento de atuação e com os limites e vedações da resolução CMN 4.963/21, ICVM 555 e demais instruções CVM quando se tratar de fundos estruturados.
Avaliação dos dados comparativos no que se refere aos custos, retorno e risco de fundos de investimento similares	As taxas de administração dos fundos de investimentos são comparadas entre fundos do mesmo segmento (Renda Fixa, Renda Variável, Exterior, Estruturados) e modelo de gestão (Ativo ou Passivo) observando-se sempre a coerência de taxas entre os ativos comparáveis. O risco e retorno dos fundos similares são analisados em gráficos de dispersão e comparados de acordo com outras métricas estatísticas amplamente utilizadas no mercado financeiro para avaliação de risco e performance de ativos.
Verificação da compatibilidade entre o objetivo de retorno do fundo de investimento, a política de investimento do fundo, o limite de risco divulgado pelo gestor, quando couber, e eventual adequação do parâmetro utilizado para a cobrança da taxa de performance	É verificada a adequação dos ativos e percentuais permitidos na política de investimentos do fundo com seu objetivo de retorno e nível de risco atribuído pelo gestor. Quando há taxa de performance, é verificada sua adequação a resolução CMN 4.963/21 e ICVM 555.
Verificação das hipóteses de eventos de avaliação, amortização e liquidação, inclusive antecipada, quando aplicável	Este RPPS mantém o cadastro atualizado junto aos gestores/administradores dos fundos de investimentos sendo imediatamente informando por meio eletrônico quando há Assembleia Geral de Cotistas ou Fato Relevante. Os eventos de avaliação, amortização e liquidação são levados para o Comitê de Investimentos e deliberados nos casos de decisão dos cotistas.
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos	Para avaliação de performance do gestor é verificada a aderência dos fundos de investimentos sob sua gestão em relação a seus respectivos benchmarks. Também é avaliada a performance absoluta no longo prazo.
Em caso de fundos de investimento cujas carteiras sejam representadas, exclusivamente ou não, por cotas de outros fundos de investimento, deverá ser verificado que a carteira dos fundos investidos atende aos requisitos previstos em Resolução do CMN	Nos fundos que aplicam em outros fundos é verificada a declaração nos regulamentos dos fundos de que atendem a resolução CMN 4.963/21 e quando possível analisada a carteira dos fundos investidos para comprovação do atendimento dos limites e vedações da legislação.
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)	

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 19.488.768/0001-84	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: Mongeral Aegon Investimentos	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BEM DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,45%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,45%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 378615	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du
Início do Fundo: 30/09/2014	

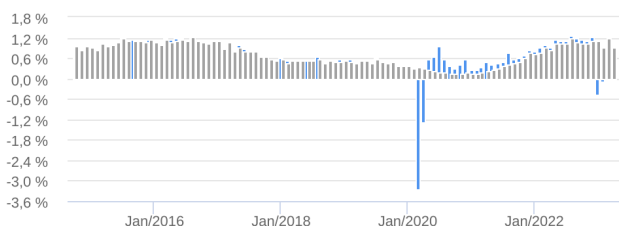
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/23	mar/23	fev/23	jan/23	dez/22	nov/22	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22	mai/22
Fundo	102,87	0,91	9,89	19,99	27,08	0,33	0,62	-0,09	-0,48	1,22	1,09	1,15	1,19	1,27	1,10	1,09	1,14
% do CDI	95,17	18,48	73,29	90,53	109,48	36,32	52,83	-9,34	-43,07	108,55	106,50	112,46	111,32	108,70	105,83	107,23	110,72
CDI	108,09	4,94	13,50	22,08	24,73	0,92	1,17	0,92	1,12	1,12	1,02	1,02	1,07	1,17	1,03	1,01	1,03
Ibovespa	104,65	0,92	4,23	-9,95	42,79	2,50	-2,91	-7,49	3,37	-2,45	-3,06	5,45	0,47	6,16	4,69	-11,50	3,22
IBX	109,06	0,10	2,46	-12,39	42,61	1,93	-3,07	-7,59	3,51	-2,63	-3,11	5,57	-0,05	6,15	4,40	-11,56	3,23
IGP-M	110,25	-0,79	-2,51	9,59	47,82	-0,95	0,05	-0,06	0,21	0,45	-0,56	-0,97	-0,95	-0,70	0,21	0,59	0,52

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,0286946	429.832,73	1.044.460,93	1,19%	-1,51%	0,56%	0,00	21,31%	1,27%	-0,48%	6
Ibovespa	-	-	-	21,33%	-18,35%	10,13%	1,00	0,00%	6,16%	-11,50%	0

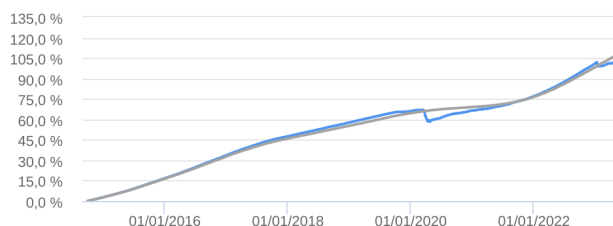
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/10/2014 a 19/05/2023 (mensal)



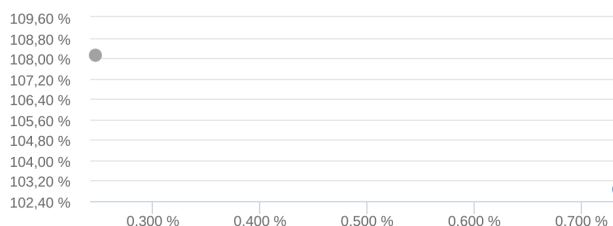
Retorno Acumulado - 01/10/2014 a 19/05/2023 (diária)



Volatilidade Anualizada - 01/10/2014 a 19/05/2023 (diária)



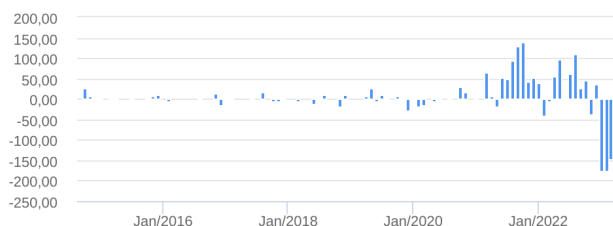
Risco x Retorno - 01/10/2014 a 19/05/2023 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 01/10/2014 a 19/05/2023 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/10/2014 a 19/05/2023 (mensal)



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

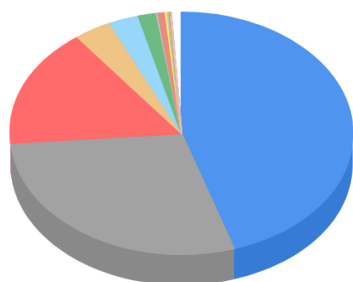
abr/2023

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Tipo de Aplicação	abr/23	mar/23	fev/23	jan/23	dez/22	nov/22	out/22	set/22
Debêntures	45,48%	41,39%	44,57%	42,04%	49,58%	48,02%	45,83%	46,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	28,96%	31,49%	28,40%	24,73%	21,34%	21,30%	21,91%	22,68%
Operações Compromissadas	16,06%	12,64%	11,85%	19,59%	17,65%	19,41%	20,41%	18,42%
Cotas de Fundos	6,73%	13,17%	13,78%	11,78%	10,07%	10,59%	10,48%	10,94%
Títulos de Crédito Privado	3,56%	2,55%	2,14%	1,90%	1,61%	1,66%	1,61%	1,67%
Valores a receber	0,17%	0,12%	0,11%	0,68%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Títulos Públicos	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	0,00%	0,00%	0,00%	-0,00%	0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Valores a pagar	-0,98%	-1,36%	-0,84%	-1,00%	-0,25%	-0,99%	-0,25%	-0,28%
Obrigações por compra a termo a pagar	-	-	-	0,27%	-	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	575.168,51	795.596,83	936.050,29	1.114.553,19	1.295.296,13	1.245.028,04	1.267.842,10	1.207.515,75
Data da Divulgação	05/05/2023	10/04/2023	09/03/2023	07/02/2023	10/01/2023	09/12/2022	09/11/2022	07/10/2022

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

abr/2023



Debêntures (omitidas)	45,48 %
Depósitos a prazo e outros títulos de IF (omitidos)	28,96 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/08/2026	16,06 %
Títulos de Crédito Privado (omitidos)	3,56 %
Direitos Creditórios	2,85 %
Cotas de TRAMONTINA I FIDC SÊNIOR 1 (sem carteira nesta data)	1,74 %
Cotas de SIMPAR FIDC SÊNIOR 1 (sem carteira nesta data)	1,10 %
Outros Valores a pagar	-0,98 %
Direitos Creditórios - Crédito Pessoal	0,71 %
Outros Valores a receber	0,17 %
Operações Compromissadas	0,13 %
Cotas de Fundos de Investimento da ICVM 555	0,10 %
Títulos Públicos Federais	0,04 %
Diferencial de SWAP a Pagar	0,03 %
Direitos Creditórios - Prestação de Serviço Público	0,01 %
LFT - Venc.: 01/03/2025	0,01 %
Valores a pagar - Curto Prazo (em até 12 meses)	0,01 %
Disponibilidades	0,00 %
Lançamentos positivos menores que 0,00%	0,01 %

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Ampass

Av. Manoel Borba 488 - Boa Vista, Recife-PE, CEP:50070-000
Telefone: (81) 3355-1601 / 1650 - www.reciprev.recife.pe.gov.br

Recife, 19 de maio de 2023
Ofício nº 77/2023 DI

Magna
Ilmo Senhor(a)
Denise

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 10.800.000,00 (Dez milhões e oitocentos mil reais), do fundo MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP CNPJ: 19.488.768/0001-84.

O resgate decorre do fato do mesmo estar acima do % do PL do fundo, conforme definido pela RECIPREV

Efetuar TED conforme dados a seguir:

Banco: Banco do Brasil S.A.
Agência: 3234-4
Conta: 7.909-X
Favorecido: FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV
CNPJ: 07.749.668/0001-85
Valores: Conforme acima.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 077/2023

ASSINADO DIGITALMENTE POR
JOSE MARCÓS ALVES DE BARROS
CPF: ***.326.354-00 DATA: 18/05/2023 14:29
LOCAL: RECIFE - PE
CÓDIGO: d8f4f9bd-af42-4398-9f72-5d9b2e952476
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

ASSINADO DIGITALMENTE POR
ELCIO RICARDO LEITE GUIMARAES
CPF: ***.849.814-49 DATA: 18/05/2023 15:21
LOCAL: RECIFE - PE
CÓDIGO: d485c700-b96c-4025-ab2d-42fb971e7cc4
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)