



**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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>	<b>Nº / ANO:</b>	<b>079 /2019 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>	<b>OF. Nº:</b>	<b>079 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	<b>Data:</b>	<b>26/03/19</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>		
<b>Valor:</b>		
<b>R\$ 2.143.371,32</b>		<b>Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"</b>
Dois milhões, cento e quarenta e três mil, trezentos e setenta e um reais e trinta e dois centavos		

Sim para todos os fundos desta APR

**HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:**

<b>Fundo:</b>	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	PODER PUBLICO		
<b>Segmento:</b>	13.397.466/0001-14		
<b>Tipo de Ativo:</b>	FI Renda Fixa - Geral		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
<b>Valor da operação:</b>	Aplicação		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	R\$ 2.143.371,32		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	1.343.587,9581717		
<b>Data da Operação:</b>	R\$ 1,59526		
<b>Data de Liquidação:</b>	26/03/2019		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	26/03/2019	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>		537.018.140,00	
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>		0,399%	
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Banco Bradesco S.A.	0286-0	65000-5
<b>Administrador:</b>	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	60.746.948/0001-12		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	25/10/2018		
<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\$ 9.244.904.610,00		
<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>	1,59%		
<b>Gestor:</b>	BRAM - D'FVM (GRUPO BRADESCO)		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	62.375.134/0001-44		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	25/10/2018		
<b>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>			
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	R\$	9.974.104.980,02	
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>	1,68%		
<b>Empresa de Rating</b>	Fitch Ratings		
<b>Conceito</b>	Excelente		
<b>Representação do conceito</b>	Excelente		
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN</b>	Sim		
<b>Distribuidor:</b>	BRAM - D'FVM (GRUPO BRADESCO)		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	62.375.134/0001-44		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	25/10/2018		

Data de Início FI:	16/07/2012	
Taxa Administração do FI (%):	3,00	
Índice de Referência do FI:	CDI	
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:	Sim	
CNPJ do Fundo:	06.081.490/0001-84	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
% Carteira do Fundo:	100,00	
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 obter rentabilidade que busque acompanhar as variações das taxas de juros praticadas no mercado de depósitos interbancários (CDI) no curto prazo através da atuação no mercado de taxa de juros doméstica. A rentabilidade do FUNDO variará conforme o patamar das taxas de juros praticadas pelo mercado sendo também impactada pelos custos e despesas do FUNDO e pela taxa de administração de 3% (três 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 Muito 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	
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal	0,55%	
Retorno Médio Anual	6,84%	
Retorno Total	58,86%	

Maior Retorno	0,93%
Menor Retorno	0,25%
Qtde. mês Positivo	84
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	0
Qtde. mês abaixo do Benchmark	84
Risco Mensal Período	0,21%
Risco Mensal 12 MESES	0,02%
Risco Anual do Período	0,73%
Retorno Relativo ao Benchmark	-18,50%
Sharpe	4,31
Information Ratio	44,46
Tracking Error	0,07%
VAR HISTÓRICO (95%)	0,90%
VAR 12 MESES (95%)	0,65%
Sharpe Modificado	76,52
Beta (12 meses)	0,50
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,25%
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:	
<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?	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
<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 ofício(s)

**PROponente**

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 333.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

**Gestor/Autorizador**

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 333.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE  
RECIFE

Recife, 26 de março de 2019

RECI  
PREV

Ofício RECIPREV nº 079/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 2.143.371,32 (Dois milhões, cento e quarenta e três mil, trezentos e setenta e um reais e trinta e dois 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 65000-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 079/2019

Atenciosamente,

  
JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR  
DIRETOR VICE PRESIDENTE

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

Arquivo Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Senhores - Recife - PE  
Rua Manoel Florba 488, Cep: 51010-000 - Boa Vista, Recife - PE  
Fone/Fax: (51) 3355-1030 / 3355-1047

REC-206-101-270319-10-51-25



