



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



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:	083 /2018 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	083 /2018 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	03/04/18	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 18.000.000,00		FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Dezoito milhões de reais				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA			
CNPJ do Fundo:	17.517.577/0001-78			
Segmento:	Renda Fixa			
Tipo de Ativo:	FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"			
Tipo de operação realizada:	Aplicação			
Valor da operação:	R\$ 18.000.000,00			
Quantidade de Cotas:	10.040.720,70061920			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,79270000			
Data da Operação:	03/04/2018			
Data de Liquidação:	03/04/2018			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 205.989.000,00			
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	8,738331%			
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X	
Administrador:	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA			
CNPJ do Administrador:	07.437.241/0001-41			
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	03/11/2017			
Gestor:	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA			
CNPJ do Gestor:	07.437.241/0001-41			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	03/11/2017			
Distribuidor:	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA			
CNPJ do Distribuidor:	07.437.241/0001-41			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	03/11/2017			
Data de Início FI:	27/08/2013			
Taxa Administração do FI (%):	0,40			
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado			
Índice de Referência do FI :	IMA-B 5			
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			
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado			
Carência (dias):	0			
Data Listagem Bolsa:	Não listado			
Resgate (dias):	1			

Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Cód. Negociação Bolsa:	Sem código	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	R\$ 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 busca atingir o seu objetivo por meio da aplicação de parte relevante de seus recursos em títulos atrelados a índices de preços, além de posicionamentos ativos nas curvas de juros prefixados e de juros reais.
	Principais riscos do fundo:	Taxa de Juros e demais riscos constantes do regulamento (Risco: 3,0)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
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 Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	20/03/2018
Outras Observações:		
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s) <div style="display: flex; justify-content: space-between; margin-top: 20px;"> <div style="text-align: center;"> <p>PROponente</p> <p>Andreson Carlos Gomes de Oliveira</p> <p>Chefe de Divisão de Investimentos</p> <p>CPF: 052.430.264-25</p> <p>Entidade Certificadora: ANBIMA</p> <p>Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </div> <div style="text-align: center;"> <p>Gestor/Autorizador</p> <p>Jose Marcos Alves de Barros</p> <p>Gestor de Investimentos</p> <p>CPF: 394.326.354-00</p> <p>Entidade Certificadora: ANBIMA</p> <p>Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div>		

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 03 de abril de 2018

Ofício RECI-REV nº 083/2018 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECI-REV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 18.000.000,00 (Dezoito milhões de reais), no fundo **WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CNPJ: 17.517.577/0001-78**.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através do Banco do Brasil S.A., Agência 3234-4, conta corrente 7.909-X, com os dados a seguir:

Banco: Banco Citibank S.A. (745)
Agência: 1
Conta Corrente: 34848878
Favorecido: WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
CNPJ: 17.517.577/0001-78
Valor: R\$ 18.000.000,00 (Dezoito milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 083/2018

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Prezados (as) Senhores (as)
Elder Andrade
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA
São Paulo - SP

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife
Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000 , Boa Vista, Recife - PE
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647


**PREFEITURA DO
RECIFE**

*Encaminhado de
03/04/2018
por [signature]*

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 03 de abril de 2018



Ofício RECI PREV nº 13A/2018 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar a TED a seguir vinculado à conta 7.909-X:

Banco: Banco Citibank S.A. (745)

Agência: 1

Conta Corrente: 34848878

Favorecido: WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

CNPJ: 17.517.577/0001-78

Valor: R\$ 18.000.000,00 (Dezoito milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 083/2018

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


PREFEITURA DO
RECIFE

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife
Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000 , Boa Vista, Recife - PE
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647

Características

CNPJ	17517577000178
Início do Fundo	27/08/2013
Código Anbima	348430
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Livre Soberano
Gestão	Western Asset
Custodiante	Citibank Dtm SA
Administrador	Western Asset

Taxa máx. adm. (%)	0,40
Taxa performance	-

Data da Última Cotação	03/04/2018
Cota	1,7927
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	205.989
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	132.530

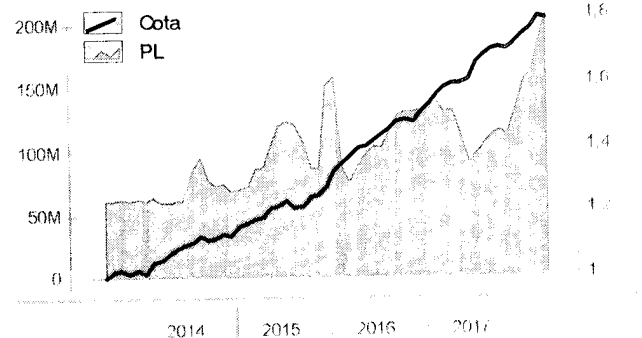
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	25.000
Aplicação adicional mínima	0
Resgate mínimo	0
Saldo mínimo	0
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+000
Prazo pgto resgate	D+001

Benchmark IMA-B 5+

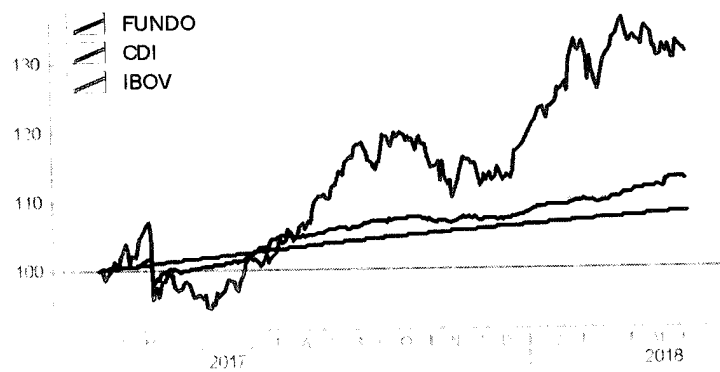
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



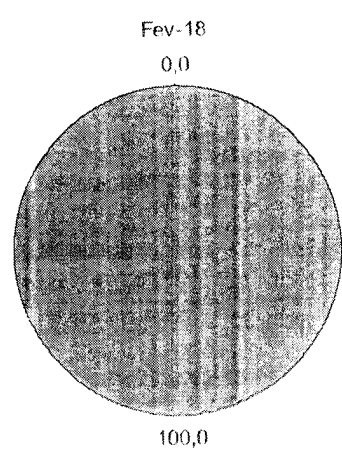
Retornos (%) (até 03/04/2018)

	nov 2017	dez 2017	jan 2018	fev 2018	mar 2018	abr 2018	2016	2017	2018	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	-0,24	1,17	1,60	0,94	2,08	-0,25	18,27	14,12	4,42	13,12	30,86	52,12	79,27
● CDI	0,57	0,54	0,58	0,46	0,53	0,05	14,00	9,93	1,64	8,39	23,29	40,16	64,83
● IBOV	-3,15	6,16	11,14	0,52	0,01	-0,87	38,94	26,86	10,76	29,77	67,37	59,30	68,94

Retorno Acumulado (252 dias)



Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



- Títulos públicos
- Merc Futuro - posic compr
- Disponibilidades
- Valores a receber
- Merc Futuro - posic vend
- Valores a pagar

Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	9
Meses Negativos	3
Maior Retorno Mensal (%)	3,45
Menor Retorno Mensal (%)	-0,25
Retorno Acumulado (%)	13,12
Volatilidade	4,97
Sharpe	0,93
VAR de 1 mês - 95% (%)	2,32

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economática é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.