



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

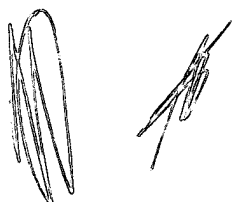
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	103 /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	103 /2019 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	23/04/19
CNPJ: 05.244.336/0001-13		
Valor:		
R\$ 12.414,71		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
Doze mil, quatrocentos e quatorze reais e setenta e um centavos		

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO		
CNPJ do Fundo:	PODER PUBLICO 13.397.466/0001 14		
Segmento:	FI Renda Fixa - Geral		
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 12.414,71		
Quantidade de Cotas:	7.761,03360003		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,59962		
Data da Operação:	23/04/2019		
Data de Liquidação:	23/04/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	551.197.650,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		0,002%	
Limite Máximo por PL do fundo		15,00%	
Banco/Agência/Conta:	Banco Bradesco S.A.	0286-0	65000-5
Administrador:	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)		
CNPJ do Administrador:	60.746.948/0001 12		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	25/10/2018		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN		Sim	
Volume de Recursos do Administrador com RPPS		R\$ 9.308.551.180,00	
% 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.		1,61%	
Gestor:	BRAM DTVM (GRUPO BRADESCO)		
CNPJ do Gestor:	62.375.134/0001 44		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	25/10/2018		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	10.048.413.658,84	
% Recursos do Gestor com RPPS		1,71%	
Empresa de Rating		Fitch Ratings	
Conceito		Excelente	
Representação do conceito		Excelente	
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN		Sim	
Distribuidor:	BRAM DTVM (GRUPO BRADESCO)		
CNPJ do Distribuidor:	62.375.134/0001 44		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	25/10/2018		

Data de Início FI:	16/02/2012
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)	<p>Objetivos:</p> <p>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.</p> <p>Principais riscos do fundo:</p> <p>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 Sistêmico; Risco Tributário.</p> <p>Risco do Fundo atribuído pelo Administrador</p> <p>Risco Muito Baixo</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
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior	
Retorno Médio Mensal	0,55%
Retorno Médio Anual	6,79%
Retorno Total	59,29%



Maior Retorno	0,93%
Menor Retorno	0,25%
Qtde. mês Positivo	85
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	0
Qtde. mês abaixo do Benchmark	85
Risco Mensal Período	0,21%
Risco Mensal 12 MESES	0,02%
Risco Anual do Período	0,74%
Retorno Relativo ao Benchmark	18,66%
Sharpe	-4,28
Information Ratio	-43,14
Tracking Error	0,07%
VAR HISTÓRICO (95%)	0,90%
VAR 12 MESES (95%)	0,65%
Sharpe Modificado	72,65
Beta (12 meses)	0,53
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 Providência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos: 23/04/2019
Outras Observações:	Pagamento de folha
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?	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
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 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

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 0743026425

Entidade certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da certificação: 05/12/2020

Gestor Autorizador

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimento

CPF: 33432635400

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

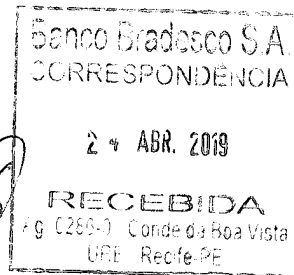
**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 23 de março de 2019

Ofício RECI-REV nº 103/2019 – GI

Fabio Magno Ferreira Veiga
78140



Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 12.414,71 (Doze mil, quatrocentos e quatorze reais e setenta e um centavos), do 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 103/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARGOS 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



JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>

Acertos

SANDRA MARIA GOMES GALINDO <sandra.galindo@recife.pe.gov.br>

22 de abril de 2019

11:49

Para: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>

Cc: ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA <annap@recife.pe.gov.br>, SANDRA MARIA GOMES GALINDO <sandra.galindo@recife.pe.gov.br>

Zé Marcos, bom dia!

Solicitamos o resgate de aplicações financeira da conta 65000-5 do Bradesco no valor de R\$ 10.538,57(dez mil, quinhentos e trinta e oito reais e cinquenta e sete centavos), referente acertos (CENSO) dos APO/PPR, transmitido eletronicamente pela EMPREL com a data de pagamento para 23/04/2019, Fundo Reciprev.

Sandra Galindo
3355-1645

Características

CNPJ: 13.397.466/0001-14
 Gestor: Bradesco Asset Management
 Administrador: Banco Bradesco
 Taxa de Administração: 2,50%
 Taxa de Administração (Máxima): 2,50%
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento
 Código de Referência: 296953
 Início do Fundo: 16/02/2012

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 200,00
 Aplicação Adicional: R\$ 200,00
 Saldo Mínimo: R\$ 100,00
 Resgate Mínimo: R\$ 100,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

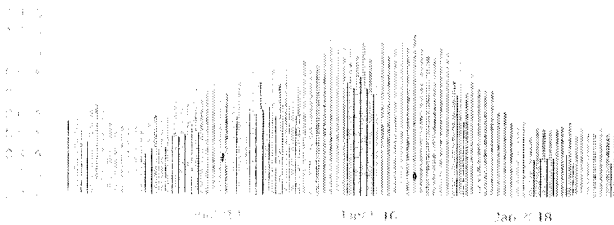
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18
Fundo	59,96	1,11	3,68	8,98	20,09	0,27	0,29	0,32	0,29	0,29	0,32	0,27	0,33	0,31	0,30	0,30	0,30
% do CDI	61,75	58,14	57,61	58,86	64,93	58,26	58,37	58,31	58,33	58,15	58,28	58,62	58,41	58,08	58,23	58,26	58,38
CDI	97,11	1,91	6,40	15,25	30,94	0,47	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52
Ibovespa	45,03	9,14	11,77	52,68	83,02	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88
IRX	82,42	9,22	12,73	53,45	85,00	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82
IGP-M	53,23	2,70	8,44	9,67	14,18	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57

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	1.596.207	551.197,65	416.463,82	0,00%	-	0,00%	0,58	0,00%	0,33%	0,27%	0
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

Gráficos

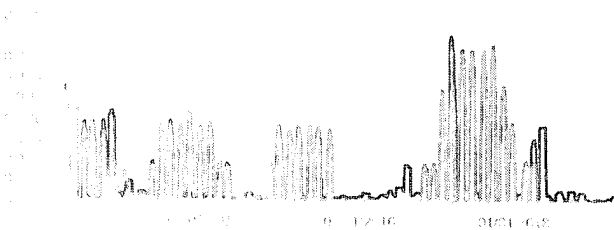
Retorno Mensal - 17/02/2012 a 23/04/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 17/02/2012 a 23/04/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 17/02/2012 a 23/04/2019 (diária)



Risco x Retorno - 17/02/2012 a 23/04/2019 (diária)



As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas, consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualização cabe exclusivamente ao CENFIN/BBF. Não há garantia de que os dados aqui apresentados sejam precisos e completos. O administrador não se responsabiliza por danos decorrentes do uso das informações aqui apresentadas. O fundo é um investimento de risco e pode sofrer perdas significativas. Os valores aqui apresentados são apenas para fins informativos e não devem ser utilizados como base para decisões de investimento. Para mais informações, consulte o regulamento do fundo e o prospecto de investimento.

