



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:	113A /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	113A /2019 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	06/05/19
CNPJ: 05.244.336/0001-13		
Valor:		
R\$ 39.918.992,30		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
Trinta e nove milhões, novecentos e dezoito mil, novecentos e noventa e dois reais e trinta centavos		

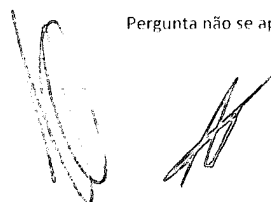
Sim para todos os fundos desta APR

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:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 39.918.992,30		
Quantidade de Cotas:	24.926.540,59213520		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,60147		
Data da Operação:	06/05/2019		
Data de Liquidação:	06/05/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	474.365.020,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		8,415%	
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 BACEN	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 Sistemico; 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 Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RUCIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos 23/04/2019
Outras Observações:	Aplicação e pagamento de folha no valor de R\$ 81.007,70
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)

PROPORLENTE

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

(PE 052 430 264-25)

Entidade Certificadora: ANBIMA

CFA 20 e CEA

Validade da Certificação: 05/12/2020

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

(PE 324 526 354 00)

Entidade Certificadora: ANBIMA

CFA 20 e CEA

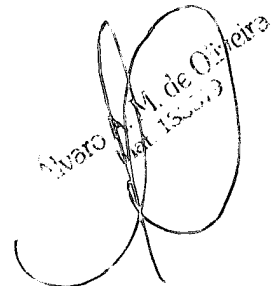
Validade da Certificação: 21/11, 2021

**SAÚDE
RECIFE**

Recife, 06 de maio de 2019

**RECI
PREV**

Ofício RECI PREV nº 113A/2019 – GI




Alvaro M. de Oliveira
06/05/2019

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 39.918.992,30 (Trinta e nove milhões), 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 113A/2019

Atenciosamente,



JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

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>

6 de maio de 2019 14:31

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>

Zê Marcos, boa tarde!

Solicitamos o resgate de aplicações financeira da conta 65000-5 do Bradesco no valor de R\$ 83.923,76(oitenta e três mil, novecentos e vinte e três reais e setenta e seis centavos) , referente ao pagamento de abril/2019(CENSO)APO/PPR, transmitido eletronicamente pela EMPREL com a data de pagamento para 07/05/2019, FUNDO RECIPREV.

Sandra Galindo
3355-1645

BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO

06/05/2019

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 Anômala: Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento
 Código de Referência: 296953
 Início do Fundo: 16/02/2012

Informações Operacionais

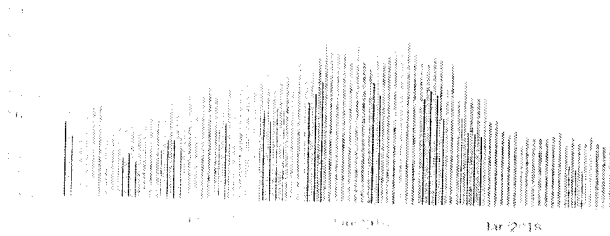
Aplicação Mínima: R\$ 200,00
 Aplicação Adicional: R\$ 200,00
 Saldo Mínimo: R\$ 100,00
 Resgate Mínimo: R\$ 100,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	maio/18
Fundo	60,15	1,23	3,68	8,84	19,84	0,30	0,27	0,29	0,32	0,29	0,29	0,32	0,27	0,33	0,31	0,30	0,30
% do CDI	61,69	58,13	57,56	58,60	64,73	58,35	58,26	58,37	58,31	58,33	58,15	58,28	58,62	58,41	58,08	58,23	58,26
CDI	97,50	2,11	6,40	15,09	30,65	0,52	0,47	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52
Ibovespa	43,65	8,10	12,37	46,90	74,40	0,98	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87
IBX	81,12	8,44	13,58	48,09	76,86	1,06	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91
IGP-M	53,91	3,15	8,64	10,70	14,54	0,92	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38

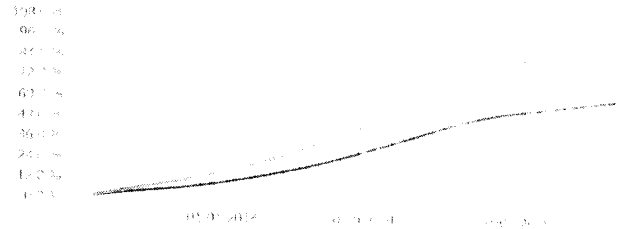
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	1.6014654	474.365,02	420.780,09	0,00%	-	0,00%	0,58	0,00%	0,33%	0,27%	0
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

■ Fundo ■ CDI

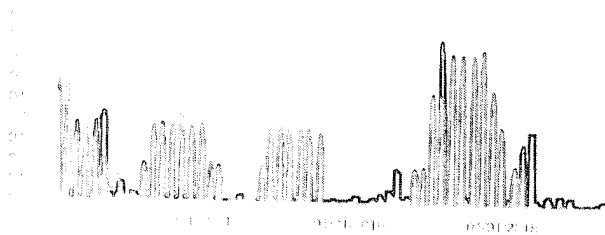
Retorno Mensal - 17/02/2012 a 06/05/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 17/02/2012 a 06/05/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 17/02/2012 a 06/05/2019 (diária)



Risco x Retorno - 17/02/2012 a 06/05/2019 (diária)

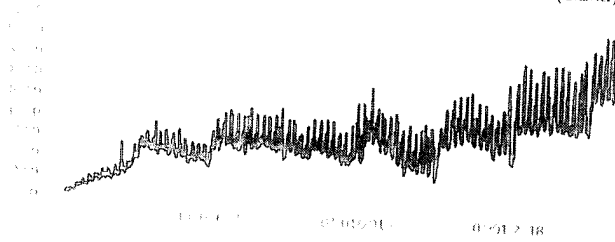


A administração tem a obrigação de prestar contas às fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela atuação e veracidade das informações é do FUNDISTRA. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de distribuição de valores mobiliários. O presente é um produto de capitalização de renda fixa, portanto, os valores podem não representar garantia de estabilidade futura. As estratégias de alocação de ativos podem sofrer alterações sem aviso prévio. A administração não se responsabiliza por danos materiais ou morais decorrentes da utilização do presente e regulamento do fundo de investimento, bem como por danos decorrentes da utilização de informações de caráter privilegiado. Para obter mais informações, consulte o regulamento do fundo de investimento disponível em www.bradesco.com.br. Para obter mais informações, consulte o regulamento do fundo de investimento disponível em www.bradesco.com.br. Para obter mais informações, consulte o regulamento do fundo de investimento disponível em www.bradesco.com.br. Para obter mais informações, consulte o regulamento do fundo de investimento disponível em www.bradesco.com.br.

BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO

06/05/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/02/2012 a 06/05/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/02/2012 a 06/05/2019 (mensal)



Composição da Carteira

abr/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

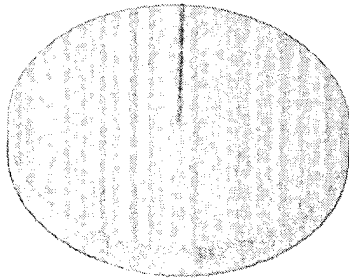
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses	PL Médio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo			
BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	100,23	0,07	99,25	413,74	98,87	413,74	98,87	413,74	98,87			R\$ 1.643.792.608,40

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

Tipo de Aplicação	Mês								
	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18
Cotas de Fundos	100,23%	100,21%	100,19%	100,20%	100,26%	100,25%	100,22%	100,23%	100,23%
Valores a receber	0,00%	0,00%	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%	0,00%
Valores a pagar	-0,23%	-0,21%	-0,19%	-0,20%	-0,26%	-0,25%	-0,22%	-0,23%	-0,23%
Patrimônio líquido (R\$ mil)	487.714,64	491.725,56	536.574,83	469.999,47	319.115,13	319.547,29	357.827,38	324.239,25	324.239,25
Data da Divulgação	03/05/2019	02/04/2019	07/03/2019	06/02/2019	07/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	02/10/2018	02/10/2018

abr/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)



- Cotas de BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO
- Outros Valores a pagar
- Outros Valores a receber
- Outras Disponibilidades

100,23 %
-0,23 %
0,00 %
0,00 %

As informações contidas neste relatório são de natureza pública ou privada, consideradas confidenciais, cuja responsabilidade pela correção e atualização cabe exclusivamente à BRAMFI. Não se garante a veracidade ou a atualidade das informações aqui contidas, nem a sua exatidão ou a sua integridade. O investidor deve realizar sua própria análise e não se responsabilizar por qualquer prejuízo decorrente do uso das informações aqui contidas. As informações aqui contidas não representam uma recomendação de compra ou venda de qualquer ativo financeiro. A BRAMFI não se responsabiliza por qualquer prejuízo decorrente do uso das informações aqui contidas. O investidor deve realizar sua própria análise e não se responsabilizar por qualquer prejuízo decorrente do uso das informações aqui contidas. O investidor deve realizar sua própria análise e não se responsabilizar por qualquer prejuízo decorrente do uso das informações aqui contidas.