



**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. 2 º 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>136 /2019 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>	<b>OF. Nº:</b>	<b>136 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	<b>Data:</b>	21/05/19
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>		
<b>Valor:</b>		
R\$ 4.000.000,00		Fundos Renda fixa - Crédito Privado - Art. 7º, VII, "b"
Quatro milhões de reais		
Sim para todos os fundos desta APR		
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>		
<b>Fundo:</b>	MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	
<b>CNPJ do Fundo:</b>	19.488.768/0001-84	
<b>Segmento:</b>	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	
<b>Tipo de Ativo:</b>	Fundos Renda fixa - Crédito Privado - Art. 7º, VII, "b"	
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Aplicação	
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 4.000.000,00	
<b>Quantidade de Cotas:</b>	2.475.235,88379164	
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 1,61601	
<b>Data da Operação:</b>	21/05/2019	
<b>Data de Liquidação:</b>	21/05/2019	
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	134.635.770,00
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>		2,971%
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>		5,00%
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Banco do Brasil S.A.	3234-4 7.909-X
<b>Administrador:</b>	REM - DTVM LTDA (GRUPO BRADFSCO)	
<b>CNPJ do Administrador:</b>	00.066.670/0001-00	
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	23/10/2018	
<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\$ 2.715.393.590,00
<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>		0,94%
<b>Gestor:</b>	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	
<b>CNPJ do Gestor:</b>	16.500.294/0001-50	
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	11/04/2019	
<b>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Não	
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	R\$	40.354.949,82
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>		1,03%
<b>Empresa de Rating</b>	Moody's	
<b>Conceito</b>	MQ2	
<b>Representação do conceito</b>	Muito bom	
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN</b>	Sim	
<b>Distribuidor:</b>	ETERNUM AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS EIRELI	
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	12.049.428/0001-08	
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	17/04/2019	

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 performar para haver a cobrança de tx performance):		100,00
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010		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:		
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		R\$ 0,00
		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
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal		0,87%
Retorno Médio Anual		10,95%
Retorno Total		61,04%

Maior Retorno	
Menor Retorno	1,26%
Qtde. mês Positivo	0,47%
Qtde. mês Negativo	55
Qtde. mês acima do Benchmark	0
Qtde. mês abaixo do Benchmark	50
Risco Mensal Período	5
Risco Mensal 12 MESES	0,26%
Risco Anual do Período	0,05%
Retorno Relativo ao Benchmark	0,89%
Sharpe	1,68%
Information Ratio	0,45
Tracking Error	4,75
VAR HISTÓRICO (95%)	0,08%
VAR 12 MESES (95%)	1,29%
Sharpe Modificado	0,97%
Beta (12 meses)	73,67
Erro Quadrático Médio (EQM)	1,12
	0,04%
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 Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RFCIPRI V através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos: 23/04/2019 e 14/05/2019
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?	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
<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)

**PROPOSTANTE**

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 05.7430.264-25

Entidade certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da certificação: 05/12/2020

**GESTOR AUTORIZADOR**

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 05.726.354-00

Entidade certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da certificação: 21/11/2021

SAÚDE  
RECIFE

RECI  
PREV

Recife, 21 de maio de 2019

Ofício RECI-REV nº 136/2019 – 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\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais), no fundo MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 19.488.768/0001-84.

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:

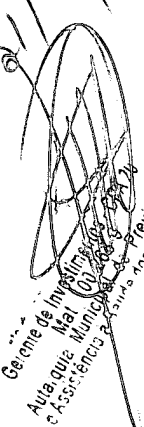
Banco: Banco Bradesco (237)  
Agência: 2856  
Conta Corrente: 22.946-6  
Favorecido: MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO  
CNPJ: 19.488.768/0001-84  
Valor: R\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 136/2019

Atenciosamente,

  
JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

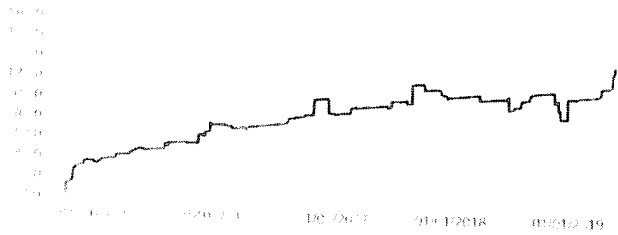
*Encaminhado por email em 21/05/2019*  
  
Gerente de Investimentos  
Ata que Município de Recife e Assistência Social do Recife

Ilmos(as) Senhor(as)  
Denise Nassar da Silva/Claudio Menezes W Pires/Arthur Mattos  
Pinto Basto dos Santos  
Mongeral Aegon Investimentos Ltda  
Rio de Janeiro - RJ

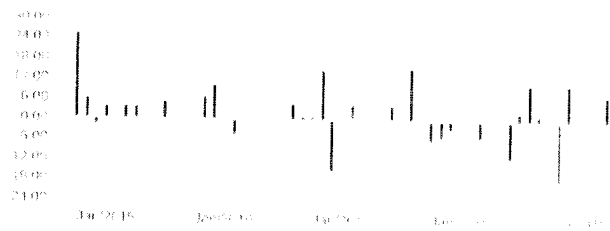
Ata que Município de Recife e Assistência Social do Recife  
Ata que Município de Recife e Assistência Social do Recife  
Ata que Município de Recife e Assistência Social do Recife



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 01/10/2014 a 21/05/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/10/2014 a 21/05/2019 (mensal)



**Composição da Carteira**

abr/2019

**Performance dos Fundos em Carteira**

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

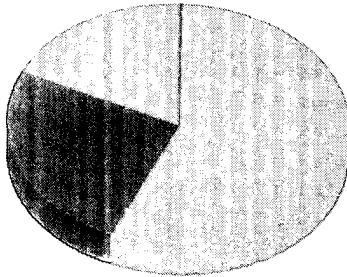
**Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)**

Tipo de Aplicação	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18
Dívidas	56,35%	59,87%	61,69%	51,88%	47,16%	54,47%	54,08%	52,75%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	25,38%	24,99%	25,10%	20,42%	20,84%	18,77%	29,60%	28,64%
Operações Compromissadas	18,34%	15,21%	10,76%	25,22%	29,52%	23,99%	13,90%	1,97%
Valores a receber	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,00%	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,07%	-0,07%	-0,06%	-0,05%	-0,08%	-0,11%	-0,06%	-0,09%
Cotas de Fundos	-	-	2,51%	2,52%	2,55%	2,87%	2,48%	14,48%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	114.332,85	105.871,76	104.863,88	104.263,64	102.941,87	91.373,14	109.058,73	108.486,26
Data da Desoneração	08/05/2019	04/04/2019	27/03/2019	06/02/2019	07/01/2019	21/01/2019	06/11/2018	10/10/2018

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela exatidão é atribuída às fontes. A WONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP não se responsabiliza por qualquer erro ou omissão das informações de seu grupo empresarial. As informações disponibilizadas não devem ser consideradas como recomendação de investimento ou qualquer outro ato financeiro. Fundos de investimento não costumam ter a garantia da Administração do fundo, Gestor do Carteira ou qualquer outro membro do grupo. Os dados relativos ao Patrimônio Líquido e Rentabilidade obtidos no passado não representam garantia de estabilidade futura. As estratégias para investimentos em títulos de crédito de risco podem sofrer alterações, podendo resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente redução de valor de seu patrimônio líquido. A avaliação é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento de aplicação em ações. Para maiores informações, consulte o site da WONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP ou a análise de crédito mensal. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para mais informações, consulte o site da WONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

abr/2019



■ Debêntures (omitidas)	56,35 %
■ Depósitos a prazo e outros títulos de IF (omitidos)	25,38 %
■ Operações Compromissadas - LTN - Venc. 01/04/2020	18,34 %
■ Outros Valores a pagar	-0,07 %
■ Outros Valores a receber	0,01 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção é compartilhada entre a Mongeral Aegon e a Fundação de Amparo à Pesquisa do Estado de São Paulo (FAPESP). A Mongeral Aegon não se responsabiliza por eventuais erros ou omissões, nem por qualquer prejuízo ou perda decorrente do uso das informações aqui apresentadas. O fundo de investimento não contém com a garantia da Administração do fundo. Gestor de carteira não se responsabiliza por qualquer prejuízo decorrente do uso das informações aqui apresentadas. O fundo de investimento não garante a manutenção do valor aplicado e não oferece qualquer garantia de retorno. O fundo de investimento pode sofrer perdas significativas para seus investidores, superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação dos investidores de fornecer recursos adicionais para a manutenção do fundo de investimento. O fundo de investimento não é adequado para investidores que não tenham experiência com investimentos em aplicações de renda fixa. Para mais informações, consulte o Regulamento do fundo de investimento disponível em [www.fundofundacao.org.br](http://www.fundofundacao.org.br). Para os cálculos foram utilizadas as informações disponíveis no site do Fundo de Investimento.