



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

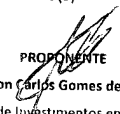
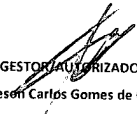
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 Valor: R\$ 107.055,90 Cento e sete mil, cinquenta e cinco reais e noventa centavos.	Nº / ANO:	156 /2018 - GI 1
	OF. Nº:	156 /2018 - GI
	Data:	04/07/2018
FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"		

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 PODER PÚBLICO		
CNPJ do Fundo:	13.397.466/0001-14		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 107.055,90		
Quantidade de Cotas:	5.132,56139		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 20,85818207		
Data da Operação:	04/07/2018		
Data de Liquidação:	04/07/2018		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 16.768.680.550,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,000638%		
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:	25/10/2017		
Gestor:	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)		
CNPJ do Gestor:	62.375.134/0001-44		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	25/10/2017		
Distribuidor:	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)		
CNPJ do Distribuidor:	60.746.948/0001-12		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	25/10/2017		
Data de Início FI:	16/02/2012		
Taxa Administração do FI (%):	3,00		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado		
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		
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado		
Carência (dias):	0		
Data Listagem Bolsa:	Não listado		
Resgate (dias):	0		

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:	Sim	
CNPJ do Fundo:	06.081.490/0001-84	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	FI Renda Fixa - 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 Sistêmico; Risco Tributário.
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Baixo
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	18/06/2018
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 laude 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 determino 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)	
 PROPRIETÁRIO Anderson Carlos Gomes de Oliveira Gerente de Investimentos em Exercício CPF 052.430.264-25 Entidade certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 05/12/2020	 GESTOR(A) AUTORIZADOR Anderson Carlos Gomes de Oliveira Gerente de Investimentos em Exercício CPF 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 05/12/2020

**SAÚDE
RECIFE**

Recife, 04 de julho de 2018

**RECI
PREV**

Ofício RECIPREV nº 156/2018 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 107.055,90 (Cento e sete mil, cinquenta e cinco reais e noventa 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 156/2018

Atenciosamente,


04/07/2018


ANDRESON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA
GERENTE DE INVESTIMENTOS EM EXERCÍCIO


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilmo Senhor
JOSÉ FERREIRA DE MENDONÇA NETO
Gerente
Banco Bradesco S.A. - Agência Conde da Boa Vista - 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: 13.397.466/0001-14
 Gestão: 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\$ 500,00
 Aplicação Adicional: R\$ 500,00
 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

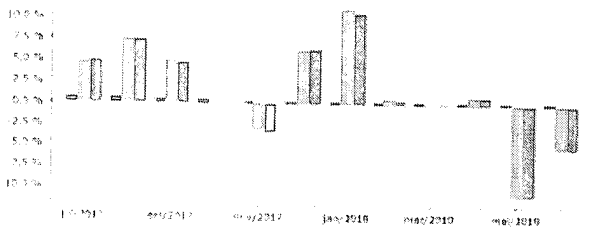
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17	out/17	set/17	ago/17	jul/17
Fundo	55,43	1,81	4,34	14,27	26,49	0,30	0,30	0,30	0,29	0,25	0,31	0,29	0,32	0,39	0,40	0,52	0,54
Excesso do Ibovespa	42,43	3,98	-14,49	-32,29	-14,50	5,50	11,17	-0,58	0,27	-0,27	-10,83	-5,86	3,47	0,37	-4,49	-6,94	-4,26
CDI	87,64	3,25	7,43	21,30	38,39	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57	0,64	0,64	0,80	0,80
Ibovespa	13,01	-2,17	18,83	46,55	40,99	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16	-3,15	0,02	4,88	7,46	4,80
IBX	40,71	-2,76	17,65	45,46	39,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35	-3,38	-0,13	4,69	7,35	4,91
IGP-M	46,33	5,48	7,02	6,26	19,20	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89	0,52	0,20	0,47	0,10	-0,72

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	1.5543256	319.844,79	325.765,63	0,06%	-	0,03%	-0,00	18,45%	0,54%	0,25%	5
Ibovespa	-	-	-	18,46%	-20,35%	8,77%	1,00	0,00%	11,14%	-10,87%	0

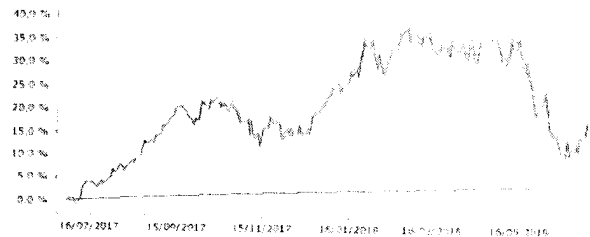
Gráficos

■ Fundo ■ Ibovespa ■ IBX

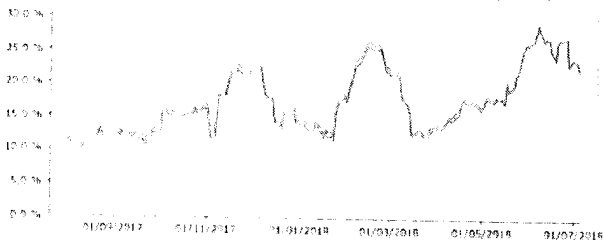
Retorno Mensal - 01/07/2017 a 04/07/2018 (mensal)



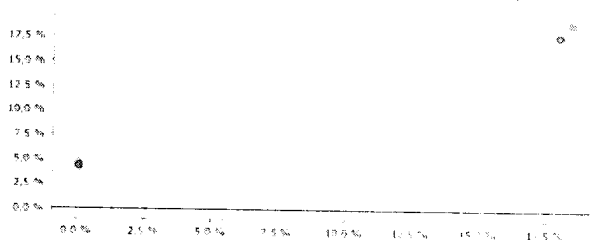
Retorno Acumulado - 03/07/2017 a 04/07/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 03/07/2017 a 04/07/2018 (diária)

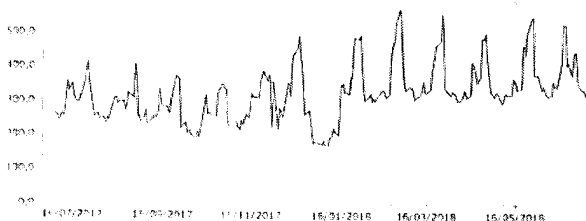


Risco x Retorno - 03/07/2017 a 04/07/2018 (diária)

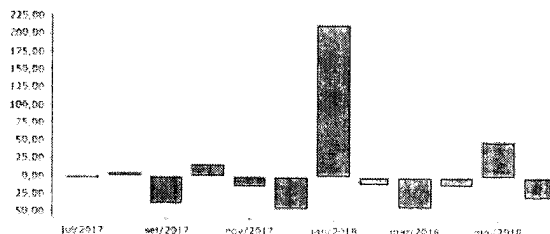


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo FUNDIUM, pelo titular desta manobra ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como indicação, distribuição ou oferta do fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer investidor ou seguradora. A renda é variável e os Creditos FIC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como hedge de risco, não podem, em alguns casos, proporcionar proteção suficiente para evitar perdas significativas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir as perdas com recursos próprios para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance do fundo de investimento é recomendada a análise de no mínimo 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações diárias contínuas (Quantum Axis).

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 03/07/2017 a 04/07/2018 (diária)



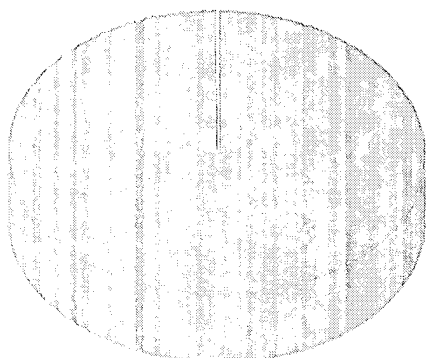
Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/07/2017 a 04/07/2018 (mensal)



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

Tipo de Aplicação	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17
Cotas de Fundos	100,23%	100,21%	100,24%	100,27%	100,22%	100,20%	100,43%	100,32%
Valores a receber	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%
Valores a pagar	-0,23%	-0,21%	-0,24%	-0,27%	-0,22%	-0,20%	-0,43%	0,32%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	353.037,72	381.061,35	328.765,81	340.160,11	382.901,55	392.144,73	178.305,60	223.966,34
Data da Divulgação	05/07/2018	06/06/2018	04/05/2018	04/04/2018	02/03/2018	02/02/2018	04/01/2018	04/12/2017

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)



Cotas de BRAM FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	100,23 %
Outros Valores a pagar	-0,23 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM AXIOM, pois trata-se de uma marca ou parte de qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundo de investimento em qualquer ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer instituição de seguro ou fundo de garantia do creditor. FIC - Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do investidor de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Assim, é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para a avaliação do desempenho de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações financeiras.