



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 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:	214 /2018 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	214 /2018 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	19/09/18
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 11.769.699,68		FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Onze milhões, setecentos e sessenta e nove mil, seiscentos e noventa e nove reais e sessenta e oito centavos			
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		
CNPJ do Fundo:	10.740.670/0001-06		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 11.769.699,68		
Quantidade de Cotas:	5.085.272,15757574		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,31446800		
Data da Operação:	19/09/2018		
Data de Liquidação:	19/09/2018		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 19.586.001.140,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,060092%		
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	03/11/2017		
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	03/11/2017		
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00 360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	03/11/2017		
Data de Início FI:	28/05/2010		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado		
Índice de Referência do FI :	IRFM-1		
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:	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 objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Renda Fixa de Mercado 1 - IRF-M 1, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.
	Principais riscos do fundo:	O Cotista está sujeito aos riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO aplica seus recursos. Existe a possibilidade de ocorrer redução da rentabilidade ou mesmo perda do capital investido no FUNDO, em decorrência dos riscos constantes no regulamento do fundo. (Risco: 2)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco 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	11/09/2018
Outras Observações:		
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?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	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. 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 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
<p>Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</p> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">PROponente</p> <p style="text-align: center;">Andreson Carlos Gomes de Oliveira Gerente de Investimentos em Exercício CPF: 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </div> <div style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">Gestor/Autorizador</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div>	

Recife, 19 de setembro de 2018

Ofício RECIPREV nº 214/2018 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 11.769.699,68 (Onze milhões, setecentos e sessenta e nove mil, seiscentos e noventa e nove reais e sessenta e oito centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 10.740.670/0001-06.

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:

Agência: 50-7

Conta Corrente: 00000004-5

Favorecido: FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

CNPJ: 07.749.668/0001-85

Valor: R\$ R\$ 11.769.699,68 (Onze milhões, setecentos e sessenta e nove mil, seiscentos e noventa e nove reais e sessenta e oito centavos).

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 214/2018

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ Público
CNPJ: 07.749.668/0001-85
Caixa Econômica Federal

RECEBIDO
EM 19/09/18

Ilma Senhora
MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ - Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA

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

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 19 de setembro de 2018

Ofício RECIPREV nº 24A/2018 – GI



Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar TED conforme a seguir, vinculado à conta 7.909-X.

Banco: Caixa Econômica Federal

Agência: 50-7

Conta Corrente: 00000004-5

Favorecido: FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

CNPJ: 07.749.668/0001-85

Valor: R\$ R\$ 11.769.699,68 (Onze milhões, setecentos e sessenta e nove mil, seiscentos e noventa e nove reais e sessenta e oito centavos).

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 214/2018

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: 10.740.670/0001-06
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 248975
 Início do Fundo: 28/05/2010

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

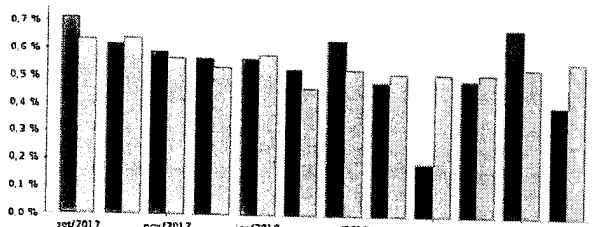
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17	out/17	set/17
Fundo	131,45	4,46	6,68	20,40	38,25	0,41	0,68	0,50	0,19	0,49	0,64	0,53	0,57	0,57	0,59	0,62	0,71
% do CDI	102,52	96,36	98,29	104,64	105,14	71,69	126,06	95,92	37,07	94,28	120,24	114,81	97,68	105,61	104,40	96,37	112,06
CDI	128,22	4,63	6,80	19,49	36,38	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57	0,64	0,64
Ibovespa	26,19	2,31	3,18	37,00	65,33	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16	-3,15	0,02	4,88
IBX	64,45	1,66	2,19	35,56	62,98	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35	-3,38	-0,13	4,69
IGP-M	66,32	7,11	9,10	7,37	19,35	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89	0,52	0,20	0,47

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	2,314468	19.586.001,14	16.647.291,32	0,52%	-0,34%	0,24%	0,96	0,51%	0,68%	0,19%	5
CDI	-	-	-	0,03%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,64%	0,46%	0

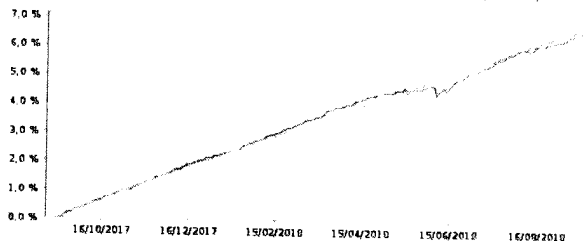
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

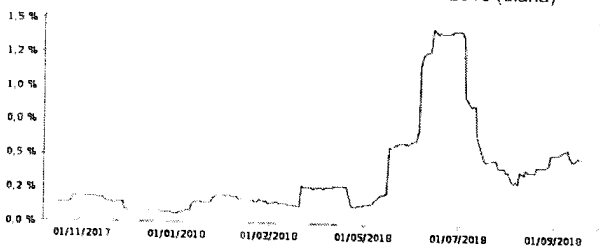
Retorno Mensal - 01/09/2017 a 19/09/2018 (mensal)



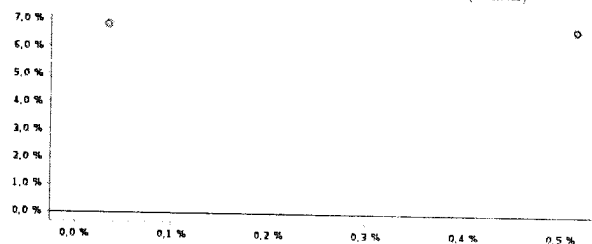
Retorno Acumulado - 18/09/2017 a 19/09/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 18/09/2017 a 19/09/2018 (diária)

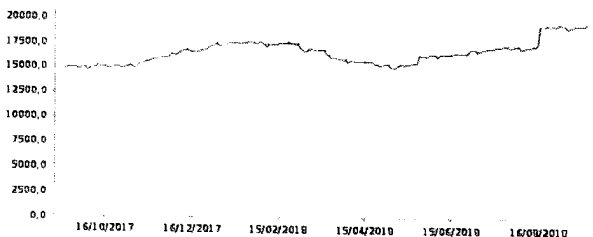


Risco x Retorno - 18/09/2017 a 19/09/2018 (diária)

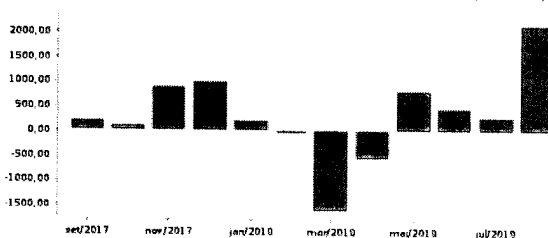


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM AXIS, sendo esta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de 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 mecanismo de seguro ou, ainda, do fundo de Garantia de Créditos - FGC. 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 cotista de aportar recursos adicionais 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 recomendável a análise de no mínimo 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
 Fonte: Quantum Axis

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 18/09/2017 a 19/09/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/09/2017 a 19/09/2018 (mensal)



Composição da Carteira

ago/2018

Performance dos Fundos em Carteira

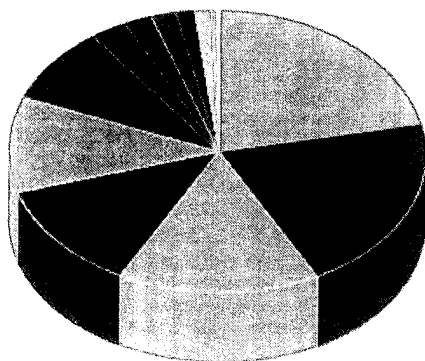
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(FI) na carteira													

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

Tipo de Aplicação	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18
Operações Compromissadas	55,90%	74,02%	60,09%	70,31%	83,27%	59,95%	78,33%	85,72%
Títulos Públicos	44,07%	25,97%	39,91%	29,71%	16,75%	40,04%	21,67%	14,28%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,03%	0,01%	0,00%	-0,01%	-0,01%	0,01%	0,01%	0,00%
Valores a receber	0,03%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,01%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	-	-	-0,00%	-	-	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	19.599.360,38	17.362.996,88	16.953.571,24	16.399.454,49	15.543.447,91	16.025.812,13	17.525.487,47	17.470.086,69
Data da Divulgação	05/09/2018	06/08/2018	09/07/2018	05/06/2018	07/05/2018	06/04/2018	09/03/2018	08/02/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

ago/2018



LTN - Venc. 01/10/2018	21,51 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2021	20,52 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc. 01/07/2019	15,67 %
LFT - Venc.: 01/09/2018	12,39 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2019	10,85 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	8,87 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2019	2,82 %
LTN - Venc.: 01/07/2019	2,19 %
LTN - Venc.: 01/01/2019	1,91 %
LTN - Venc.: 01/04/2019	1,43 %
LFT - Venc.: 01/03/2020	1,38 %
LFT - Venc.: 01/03/2019	0,36 %
LFT - Venc.: 01/03/2021	0,05 %
LFT - Venc.: 01/09/2020	0,03 %
Outros Valores a receber	0,03 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ19	0,01 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN19	0,01 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF19	0,00 %
Lançamentos positivos menores que 0,00%	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 AX. O titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de 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 mecanismo de seguro ou oferta do Fidejussor de Créditos - FGC. 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 colistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do colista de aportar recursos adicionais 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 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 Diárias. Fonte: Quantum Axis.