



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: | 220 /2018 - GI |
| Unidade Gestora do RPPS | | OF. Nº: | 220 /2018 - GI |
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores | | Data: | 27/09/18 |
| CNPJ: 05.244.336/0001-13 | | | |
| Valor: | | | |
| R\$ 8.198.279,20 | | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a" | |
| Oito milhões, cento e noventa e oito mil, duzentos e setenta e nove reais e vinte centavos | | | |
| Sim para todos os fundos desta APR | | | |
| HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS: | | | |
| Fundo: | BRADESCO FI RF IRF – M 1 TP | | |
| CNPJ do Fundo: | 11.484.558/0001-06 | | |
| Segmento: | Renda Fixa | | |
| Tipo de Ativo: | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a" | | |
| Tipo de operação realizada: | Resgate | | |
| Valor da operação: | R\$ 8.198.279,20 | | |
| Quantidade de Cotas: | 3.576.560,05857401 | | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 2,29222467 | | |
| Data da Operação: | 27/09/2018 | | |
| Data de Liquidação: | 28/09/2018 | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 1.529.875.360,00 | | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,535879% | | |
| 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: | 02/07/2010 | | |
| Taxa Administração do FI (%): | 0,20 | | |
| Agência de Classificação de Risco que classificou o FI: | Dispensado | | |
| Índice de Referência do FI : | IRF-M1 | | |
| 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 realizar 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 FUNDO tem por objetivo proporcionar aos seus Cotistas rentabilidade que busque superar a variação do IRF-M 1, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável. A rentabilidade do FUNDO variará conforme o comportamento da variação dos preços dos ativos financeiros e modalidades operacionais em carteira, sendo também impactada pelos custos, pelas despesas e pela taxa de administração de 0,20% (vinte centésimos 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 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: | Destinado ao pagamento da 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 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, mantém 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="text-align: center;"> <p>PROPOSTANTE</p> <p>Andreson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </div> <div style="text-align: center;"> <p>GESTOR/AUTORIZADOR</p> <p>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> | |

**SAÚDE
RECIFE**

Recife, 27 de setembro de 2018

**RECI
PREV**

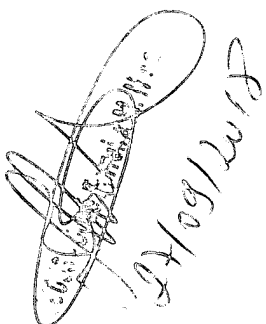
Ofício RECIPREV nº 220/2018 – GI

Senhor Gerente,

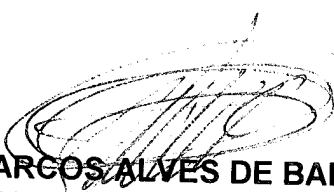
Solicitamos resgatar o valor de R\$ 8.198.279,20 (Oito milhões, cento e noventa e oito mil, duzentos e setenta e nove reais e vinte centavos), do fundo BRADESCO FI RF IRF – M 1 TP CNPJ: 11.484.558/0001-06, vinculado à conta 65000-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 220/2018

Atenciosamente,



Handwritten signature and date: 27/09/2018



JOSÉ MARGOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



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 MUNICIPAL DE RECIFE

Atarquia Municipal de Prevenção e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev - Recife - PE
Av. Manoel Borbe 488 - Cep: 50070-000 - Boa Vista, Recife - PE
Fone/Fax: (51) 3355 1650 - 3355 1641

Resgate

SANDRA MARIA GOMES GALINDO

Hoje, 09:05 25/09/2018 JOSE MARCOS ALVES DE BARROS;ANNA PAULA
ALMEIDA NUNES E SILVA;

Zé Marcos, bom dia!

Solicitamos o resgate de aplicações financeira da conta 65000-5 do Bradesco no valor de R\$ 8.198.279,20(oito milhões, cento e noventa e oito mil, duzentos e setenta e nove reais e vinte centavos), referente ao pagamento de **setembro/2018** dos **APO/PPR e PEN**, transmitido eletronicamente pela EMPREL com a data de pagamento para **28/09/2018, FUNDO RECIPREV.**

Informamos o valor líquido de R\$ 19.957.033,18(dezenove milhões, novecentos e cinquenta e sete mil, trinta e três reais e dezoito centavos), referente a folha de setembro/2018 dos **APO/PPR e PEN** do **FUNDO RECIFIN.**

AUT. PREV. MUN. RECIFE - RECIPREV

SAÚDE RECIFE - Valor Líquido R\$ 49.189,01(quarenta e nove mil, cento e oitenta e nove reais e um centavos)

PREVIDÊNCIA - Valor Líquido R\$ 188.474,43(cento e oitenta e oito mil, quatrocentos e setenta e quatro reais e quarenta e três centavos)

Sandra Galindo

3355-1645

Características

CNPJ: 11.484.558/0001-06
 Gestão: Bradesco Asset Management
 Administrador: Banco Bradesco
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): 0,20%
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano
 Código de Referência: 251267
 Início do Fundo: 02/07/2010

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00
 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+1 du

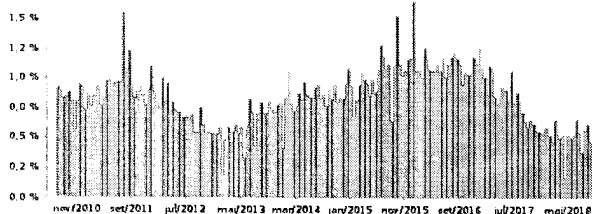
| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | set/18 | ago/18 | jul/18 | jun/18 | mai/18 | abr/18 | mar/18 | fev/18 | jan/18 | dez/17 | nov/17 | out/17 |
|-------------|--------|-------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo | 129,22 | 4,65 | 6,60 | 20,09 | 38,20 | 0,62 | 0,38 | 0,66 | 0,50 | 0,17 | 0,50 | 0,65 | 0,52 | 0,57 | 0,55 | 0,61 | 0,60 |
| % do CDI | 102,10 | 96,71 | 97,79 | 104,31 | 105,78 | 131,43 | 67,02 | 121,00 | 97,37 | 32,24 | 95,68 | 122,08 | 111,60 | 98,35 | 103,15 | 108,19 | 92,64 |
| CDI | 126,56 | 4,81 | 6,75 | 19,26 | 36,11 | 0,47 | 0,57 | 0,54 | 0,52 | 0,52 | 0,52 | 0,53 | 0,46 | 0,58 | 0,54 | 0,57 | 0,64 |
| Ibovespa | 29,16 | 3,85 | 6,76 | 35,17 | 74,99 | 3,48 | -3,21 | 8,88 | -5,20 | -10,87 | 0,88 | 0,01 | 0,52 | 11,14 | 6,16 | -3,15 | 0,02 |
| IBX | 69,11 | 3,15 | 5,81 | 34,04 | 71,71 | 3,23 | -3,13 | 8,84 | -5,19 | -10,91 | 0,82 | 0,08 | 0,42 | 10,74 | 6,35 | -3,38 | -0,13 |
| IGP-M | 66,64 | 8,30 | 10,13 | 8,50 | 20,29 | 1,52 | 0,70 | 0,51 | 1,87 | 1,38 | 0,57 | 0,64 | 0,07 | 0,76 | 0,89 | 0,52 | 0,20 |

| 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 Arima do Benchmark |
|----------------------------|-----------|--------------|--------------------|--------------|--------------|-------|------|----------------|----------------|----------------|-------------------------|
| Fundo | 2.2922467 | 1.529.875,36 | 1.072.516,99 | 0,53% | -0,34% | 0,25% | 0,94 | 0,52% | 0,66% | 0,17% | 6 |
| CDI | - | - | - | 0,03% | - | 0,01% | 1,00 | 0,00% | 0,64% | 0,46% | 0 |

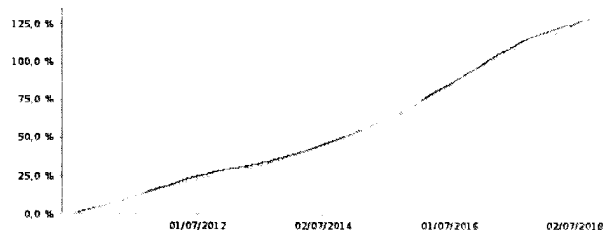
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

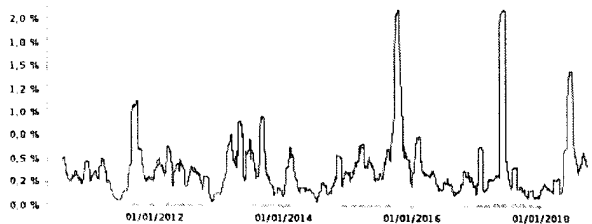
Retorno Mensal - 05/07/2010 a 28/09/2018 (mensal)



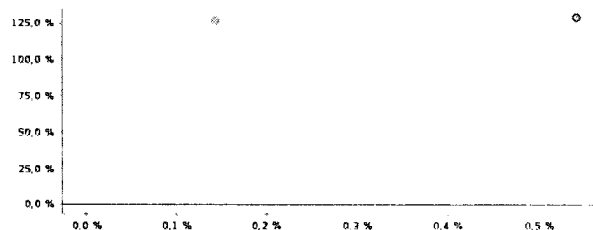
Retorno Acumulado - 05/07/2010 a 28/09/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 05/07/2010 a 28/09/2018 (diária)

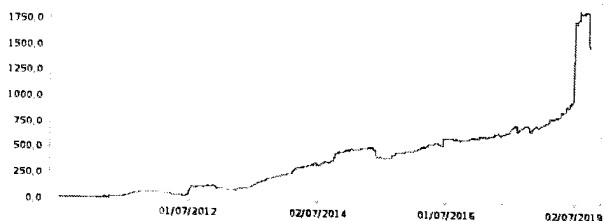


Risco x Retorno - 05/07/2010 a 28/09/2018 (diária)



As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo criador desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, 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 Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento do fundo 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 (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
 Fonte: Quantum Avis.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/07/2010 a 28/09/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 05/07/2010 a 28/09/2018 (mensal)



Composição da Carteira

ago/2018

Performance dos Fundos em Carteira

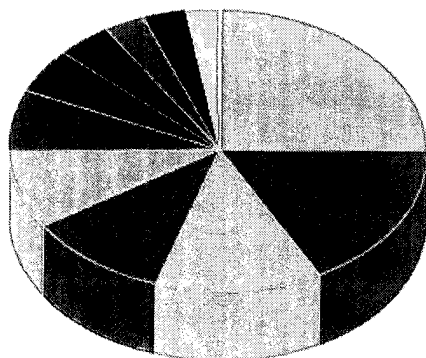
| Fundo | % do PL | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Volatilidade | PL Médio |
|-------------------------------|---------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|----------|--------------|----------|
| 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 |
|-------------------------------------|--------------|--------------|--------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Títulos Públicos | 89,09% | 88,05% | 89,17% | 89,89% | 95,28% | 91,12% | 91,46% | 95,09% |
| Operações Compromissadas | 10,95% | 11,97% | 10,85% | 10,12% | 4,74% | 8,91% | 8,57% | 4,94% |
| Mercado Futuro - Posições compradas | 0,02% | 0,01% | 0,00% | -0,00% | -0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Valores a receber | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,01% | 0,01% | 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 | -0,05% | -0,03% | -0,02% | -0,02% | -0,02% | -0,03% | -0,03% | -0,03% |
| Mercado Futuro - Posições vendidas | - | - | - | - | -0,00% | -0,00% | - | - |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 1.878.352,29 | 1.792.119,36 | 1.019.417,39 | 939.732,78 | 889.222,36 | 842.415,88 | 827.876,57 | 788.290,98 |
| Data da Divulgação | 05/09/2018 | 03/08/2018 | 05/07/2018 | 06/06/2018 | 04/05/2018 | 04/04/2018 | 02/03/2018 | 02/02/2018 |

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

ago/2018



| | |
|--|---------|
| LTN - Venc.: 01/01/2019 | 24,81 % |
| LTN - Venc.: 01/10/2018 | 17,19 % |
| LTN - Venc.: 01/04/2019 | 12,78 % |
| Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 10,95 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2023 | 8,72 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2021 | 7,22 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2021 | 5,16 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2020 | 4,13 % |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2019 | 3,28 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2023 | 3,23 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2018 | 2,58 % |
| Outros Valores a pagar | -0,05 % |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUT19 | 0,01 % |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUT19 | 0,01 % |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUT19 | 0,00 % |
| Outros Valores a receber | 0,00 % |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUT18 | 0,00 % |
| Outras Disponibilidades | 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 AXIS, nem pela esta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. Gestão da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda de qualquer 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 inv. sitor 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 (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis