



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE

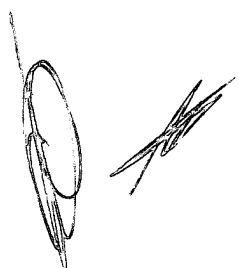




PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

ART. 3º - B DA PORTARIA MPS Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR		Nº / ANO:	241 /2018 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	241 /2018 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	29/10/18
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 8.404.144,89		FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"	
Oito milhões, quatrocentos e quatro mil, cento e quarenta e quatro reais e oitenta e nove 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\$ 8.404.144,89		
Quantidade de Cotas:	3.636.057,70485040		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,31133430		
Data da Operação:	29/10/2018		
Data de Liquidação:	30/10/2018		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.712.786.010,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,490671%		
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		
Gestor:	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)		
CNPJ do Gestor:	62.375.134/0001-44		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	25/10/2018		
Distribuidor:	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)		
CNPJ do Distribuidor:	60.746.948/0001-12		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	25/10/2018		
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 do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco de Mercado; Risco decorrente da concentração da carteira; Risco de Liquidez; Risco de Crédito; Risco 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 RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	10/10/2018
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, 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="text-align: center;">  PROPRIETÁRIO Andreson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF 052 430 264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 05/12/2020 </div> <div style="text-align: center;">  GESTOR AUTORIZADOR José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334 326 354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019 </div> </div>	

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 29 de outubro de 2018

Ofício RECIPREV nº 241/2018 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 8.404.144,89 (Oito milhões, quatrocentos e quatro mil, cento e quarenta e quatro reais e oitenta e nove 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 241/2018

Atenciosamente,

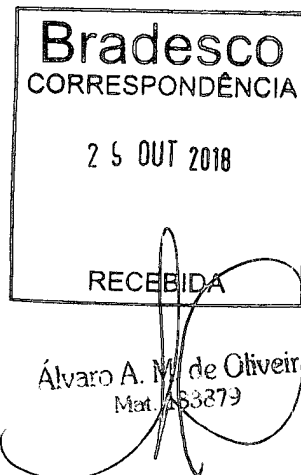

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilma Senhora
ADRIANA CRISTINA MELO FERREIRA FONSECA
Gerente
Banco Bradesco S.A. - Agência Conde da Boa Vista - Recife -PE
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


**PREFEITURA DO
RECIFE**



Resgate

SANDRA MARIA GOMES GALINDO

Ontem, 17:41 24/10/2018 JOSE MARCOS ALVES DE BARROS;ELCIO RICARDO
LEITE GUIMARAES;

Zé Marcos, boa tarde!

Solicitamos o resgate de aplicações financeira da conta 65000-5 do Bradesco no valor de **R\$ 8.404.144,89**(oito milhões, quatrocentos e quatro mil, cento e quarenta e quatro reais e oitenta e nove centavos), referente ao pagamento de **outubro/2018** dos APO/PPR e PEN, transmitido eletronicamente pela EMPREL com a data de pagamento prevista para 31/10/2018, **FUNDO RECIPREV**.

Informamos o valor líquido de **R\$ 20.916.089,72**(vinte milhões, novecentos e dezesseis mil, e oitenta e nove reais e setenta e dois centavos), referente a folha de **outubro/2018** dos APO/PPR e PEN do **FUNDO RECIFIN**.

AUT. PREV. MUN. RECIFE - RECIPREV

SAÚDE RECIFE - Valor Líquido **R\$ 50.967,07**(cinquenta mil, novecentos e sessenta e sete reais e sete centavos)

PREVIDÊNCIA - Valor Líquido **R\$ 176.661,95**(cento e setenta e seis mil, seiscentos e sessenta e um reais e noventa e cinco 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

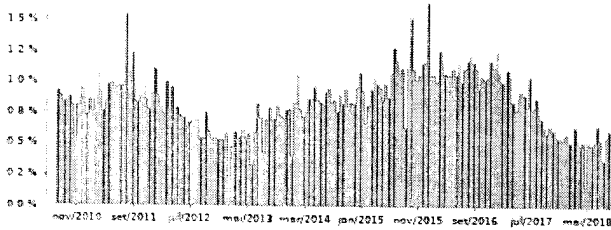
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17	out/17
Fundo	131,13	5,52	6,86	19,90	37,48	0,62	0,38	0,66	0,50	0,17	0,50	0,65	0,52	0,57	0,55	0,61	0,60
% do CDI	102,71	103,68	103,71	107,00	106,02	131,43	67,02	121,00	97,37	32,24	95,68	122,08	111,60	98,35	103,15	108,19	92,64
CDI	127,68	5,33	6,61	18,60	35,36	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	36,41	9,68	9,29	30,81	75,41	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	79,06	9,21	8,78	30,55	72,64	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	67,99	9,17	10,76	9,19	19,39	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	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,3113343	1.712.786,01	1.143.377,23	0,55%	-0,34%	0,26%	0,50	0,55%	0,66%	0,17%	6
CDI	-	-	-	0,02%	-	0,01%	1,00	0,00%	0,58%	0,46%	0

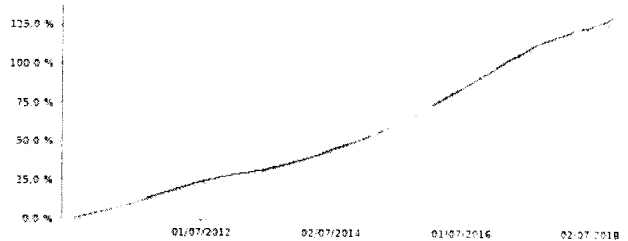
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

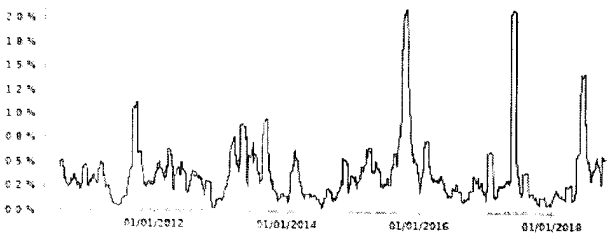
Retorno Mensal - 05/07/2010 a 29/10/2018 (mensal)



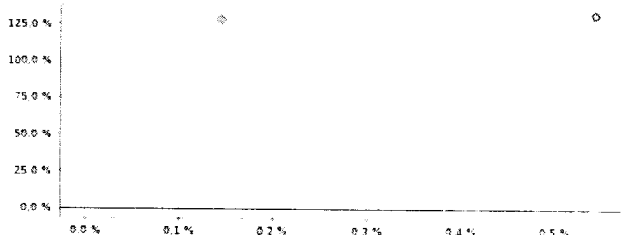
Retorno Acumulado - 05/07/2010 a 29/10/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 05/07/2010 a 29/10/2018 (diária)

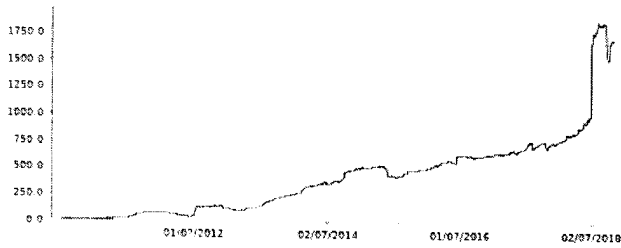


Risco x Retorno - 05/07/2010 a 29/10/2018 (diária)



As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo QUANTUM, pelo 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 do Fidejussor (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 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 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

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/07/2010 a 29/10/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 05/07/2010 a 29/10/2018 (mensal)



Composição da Carteira

set/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

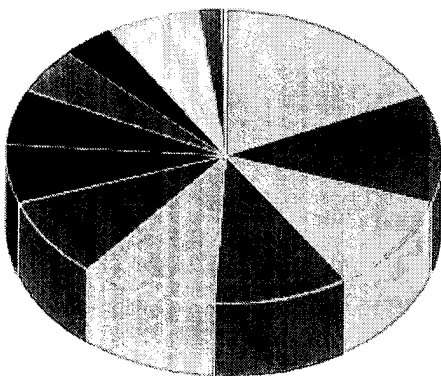
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18
Títulos Públicos	88,41%	89,09%	88,05%	89,17%	89,89%	95,28%	91,12%	91,46%
Operações Compromissadas	11,86%	10,95%	11,97%	10,85%	10,12%	4,74%	8,91%	8,57%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,01%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	0,00%	-	-	-	-	-0,00%	-0,00%	-
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,01%	0,02%	0,01%	0,00%	-0,00%	-0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,27%	-0,05%	-0,03%	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,03%	-0,03%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.529.875,36	1.878.352,29	1.792.119,36	1.019.417,39	939.732,78	889.222,36	842.415,88	827.876,57
Data da Divulgação	02/10/2018	05/09/2018	03/08/2018	05/07/2018	06/06/2018	04/05/2018	04/04/2018	02/03/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

set/2018



LTN - Venc.: 01/04/2019	18,01%
LTN - Venc.: 01/10/2019	12,11%
LFT - Venc.: 01/09/2023	10,76%
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2019	10,08%
LTN - Venc.: 01/01/2019	10,04%
LFT - Venc.: 01/03/2021	8,90%
LFT - Venc.: 01/09/2021	6,36%
LTN - Venc.: 01/07/2019	6,20%
LFT - Venc.: 01/03/2020	5,09%
NTN-F - Venc.: 01/01/2019	4,05%
LFT - Venc.: 01/03/2023	3,98%
LTN - Venc.: 01/10/2018	2,91%
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2023	1,78%
Outros Valores a pagar	-0,27%
Mercado Futuro - Posições vendidas - D11FUTV19	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTN19	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTJ19	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTF19	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 pelo Fundos 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 fundo de Garantia do Crédito - 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 avaliações 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