

RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE

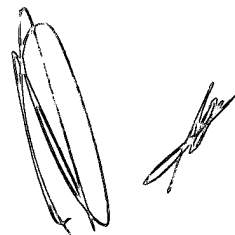


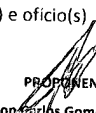

PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

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:	259 /2018 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	259 /2018 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13		Data:	19/11/18	
Valor:		FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"		
R\$ 14.284.079,60				
Quatorze milhões, duzentos e oitenta e quatro mil, setenta e nove reais e sessenta centavos				
Sim para todos os fundos desta APR				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO			
CNPJ do Fundo:	15.154.220/0001-47			
Segmento:	Renda Variável			
Tipo de Ativo:	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"			
Tipo de operação realizada:	Resgate			
Valor da operação:	R\$ 14.284.079,60			
Quantidade de Cotas:	11.464.712,01532690			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,24591700			
Data da Operação:	19/11/2018			
Data de Liquidação:	26/11/2018			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 208.208.440,00			
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	6,860471%			
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:	30/10/2018			
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	30/10/2018			
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL			
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018			
Data de Início FI:	01/11/2012			
Taxa Administração do FI (%):	1,50			
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado			
Índice de Referência do FI :	Índice Small Cap			
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):	4			

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 superar o desempenho do Índice Small Cap (SMLL) por meio do exercício de gestão ativa, proporcionando ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por ativos de empresas de menor capitalização de mercado, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.
	Principais riscos do fundo: Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco de Mercado / Risco de Crédito / Risco de Liquidez / Risco de Concentração / Risco Sistemático e de Regulação / Risco Muito Alto
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	14/11/2018
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?	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="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">PROPORLENTE  Anderson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF 052 430 264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </div> <div style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">GESTOR/AUTORIZADOR  José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 434 326 354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div>	

**SAÚDE
RECIFE**

Recife, 19 de novembro de 2018

**RECI
PREV**

Ofício RECIPREV nº 259/2018 – GI

Senhora Gerente,


Solicitamos o resgate total do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO CNPJ: 15.154.220/0001-47, vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 259/2018

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO


MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento
Av. Manoel Borba 488 - Boa Vista
Recife - PE

19/11/18

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


PREFEITURADO
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: 15.154.220/0001-47
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 1,50%
 Taxa de Administração (Máxima): 1,50%
 Classificação Anbima: Ações Small Caps
 Código de Referência: 317594
 Início do Fundo: 01/11/2012

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 100,00
 Aplicação Adicional: R\$ 50,00
 Saldo Mínimo: R\$ 50,00
 Resgate Mínimo: R\$ 50,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
 Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+4 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17
Fundo	24,59	0,74	6,15	52,14	69,97	12,00	-2,16	-3,94	5,55	-4,39	-11,08	1,86	-0,52	-0,31	4,57	7,19	-2,57
% do CDI	30,18	12,98	93,78	287,73	201,11	2.209,69	-460,84	-694,86	1.023,35	-848,29	-2.141,53	358,90	-96,98	-67,24	783,47	1.337,03	-452,86
CDI	81,49	5,72	6,56	18,12	34,79	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57
Ibovespa	49,92	14,22	18,83	43,63	87,61	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16	-3,15
IBX	70,46	14,00	18,67	44,22	85,74	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35	-3,38
IGP-M	41,67	9,16	10,38	9,14	17,93	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89	0,52

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	1,245917	208.208,44	255.045,33	19,65%	-19,20%	9,33%	-27,48	19,65%	12,00%	-11,08%	5
CDI	-	-	-	0,02%	-	0,01%	1,00	0,00%	0,58%	0,46%	0

Gráficos

■ Fundo □ CDI

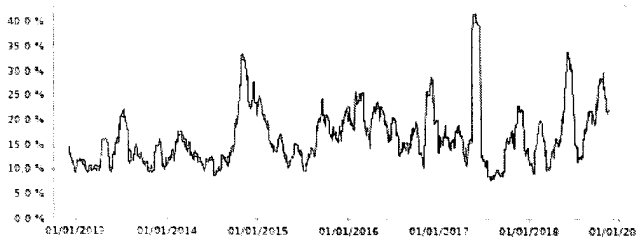
Retorno Mensal - 06/11/2012 a 21/11/2018 (mensal)



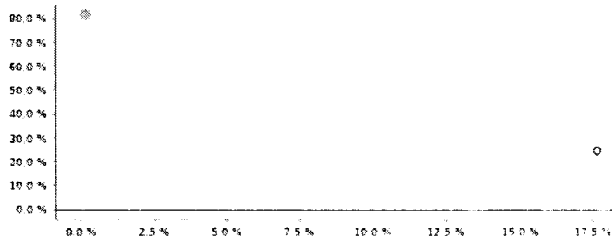
Retorno Acumulado - 06/11/2012 a 21/11/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 06/11/2012 a 21/11/2018 (diária)

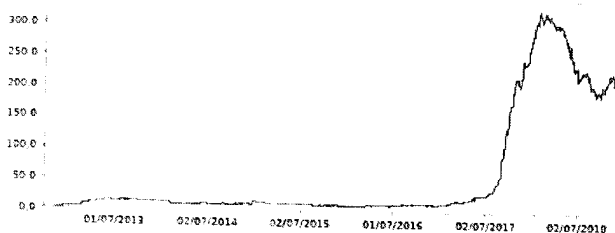


Risco x Retorno - 06/11/2012 a 21/11/2018 (diária)

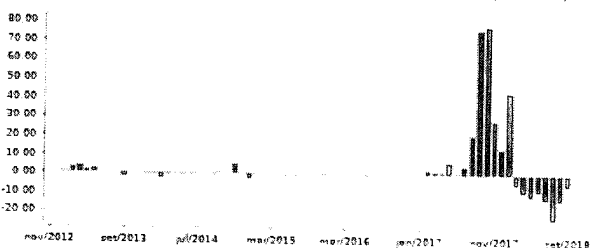


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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 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 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 Axi

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 06/11/2012 a 21/11/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 06/11/2012 a 21/11/2018 (mensal)



Composição da Carteira

out/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses PL Medio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,36	0,31	98,12	445,00	99,71	445,00	99,71	445,00	99,71	-	R\$ 4.370.259.000,36

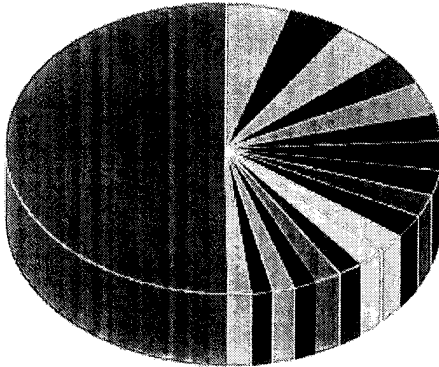
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18
Ações	85,26%	84,52%	84,66%	85,62%	86,53%	86,51%	84,67%	84,18%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	14,12%	14,63%	14,31%	13,28%	12,73%	12,58%	14,44%	15,07%
Cotas de Fundos	1,36%	0,42%	0,59%	1,22%	0,77%	0,35%	0,35%	0,45%
Valores a receber	0,61%	2,01%	0,76%	0,68%	0,52%	1,48%	0,79%	0,73%
Outras Aplicações	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	-0,29%	-1,52%	-0,31%	-0,83%	-0,54%	-0,94%	-0,31%	-0,48%
Opções - Posições lançadas	-	0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,01%	-0,02%	-0,05%	-0,06%
Opções - Posições titulares	-	0,00%	0,01%	0,02%	0,02%	0,04%	0,11%	0,11%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	217.543,55	193.296,29	203.474,70	225.937,52	236.275,10	260.366,99	302.060,84	307.477,97
Data da Divulgação	08/11/2018	08/10/2018	06/09/2018	08/08/2018	09/07/2018	05/06/2018	07/05/2018	06/04/2018

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 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 de Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, 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.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2018



BR MALLS PAR ON NM - BRML3	4,89 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - VVAR11	4,51 %
AZUL PN N2 - AZUL4	4,39 %
CVC BRASIL ON NM - CVCB3	3,74 %
BRADESPAR PN N1 - BRAP4	3,49 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - SULA11	3,24 %
ESTACIO PART ON NM - ESTC3	3,22 %
FLEURY ON NM - FLRY3	2,93 %
BANRISUL PNB N1 - BRSR6	2,56 %
CYRELA REALT ON NM - CYRE3	2,47 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - TAE11	2,21 %
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	2,05 %
ENEVA ON NM - ENEV3	1,97 %
ENERGIAS BR ON NM - ENBR3	1,88 %
DOMMO ON - DMMO3	1,84 %
MRV ON NM - MRVE3	1,68 %
CESP PNB N1 - CESP6	1,64 %
BK BRASIL ON NM - BKBR3	1,62 %
Lançamentos positivos menores que 1,62%	51,03 %

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 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 ajuda 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 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 (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Aés.