



**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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>		<b>Nº / ANO:</b>	<b>285 /2018 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>		<b>OF. Nº:</b>	<b>285 /2018 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	<b>13/12/18</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>			
<b>Valor:</b>			
R\$ 75.152,17		FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Setenta e cinco mil, cento e cinquenta e dois reais e dezessete centavos			
Sim para todos os fundos desta APR			
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>			
<b>Fundo:</b>	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	14.386.926/0001-71		
<b>Segmento:</b>	Renda Fixa		
<b>Tipo de Ativo:</b>	FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Aplicação		
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 75.152,17		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	37.868,4483553		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 1,98455900		
<b>Data da Operação:</b>	13/12/2018		
<b>Data de Liquidação:</b>	13/12/2018		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 7.415.652.210,00		
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	0,001013%		
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
<b>Administrador:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	30/10/2018		
<b>Gestor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	30/10/2018		
<b>Distribuidor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	30/10/2018		
<b>Data de Início FI:</b>	16/08/2017		
<b>Taxa Administração do FI (%):</b>	0,20		
<b>Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:</b>	D dispensado		
<b>Índice de Referência do FI:</b>	IDKA IPCA 2A		
<b>Tx Performance do FI (%):</b>	Não possui		
<b>Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):</b>	Não possui		
<b>Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:</b>	Dispensado		
<b>Carência (dias):</b>	0		
<b>Data Listagem Bolsa:</b>	Não listado		
<b>Resgate (dias):</b>	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 em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Duração Constante ANBIMA - segmento IPCA 2A (IDKa IPCA 2A), 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, de crédito e diversos outros  Risco Médio
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:		
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b> <b>Art. 8º, IV, "a"</b>	
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;"><b>PROPOSTANTE</b></p> <p style="text-align: center;">Andreson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPI - 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;"><b>GESTOR/AUTORIZADOR</b></p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 384.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</p> </div> </div>	

**SAÚDE  
RECIFE**

Recife, 13 de dezembro de 2018

**RECI  
PREV**

**Ofício RECIPREV nº 285/2018 – GI**

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 75.152,17 (Setenta e cinco mil, cento e cinquenta e dois reais e dezessete centavos), no fundo CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ:14.386.926/0001-71, vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 285/2018

Atenciosamente,

  
**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
**ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES**  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

*13/12/2018*

Ilma Senhora  
**MARIA VERÔNICA GALINDO**  
Gerente de Atendimento PJ - Público  
**Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo**  
**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: 14.386.926/0001-71  
 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: 310638  
 Início do Fundo: 16/08/2012

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	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17
Fundo	98,46	8,69	9,42	22,94	42,26	0,13	2,08	1,15	0,01	1,19	0,21	-0,79	0,78	1,52	0,57	0,95	0,87
% do CDI	115,83	141,75	144,94	130,19	123,59	26,83	383,90	246,16	0,92	219,34	40,19	-152,36	151,38	285,19	121,83	163,46	161,89
CDI	85,00	6,13	6,50	17,62	34,19	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54
Ibovespa	47,76	14,97	20,66	44,76	94,24	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16
IBX	70,53	15,08	20,90	46,10	92,23	2,86	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35
IGP-M	43,42	8,68	9,31	8,53	16,32	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89

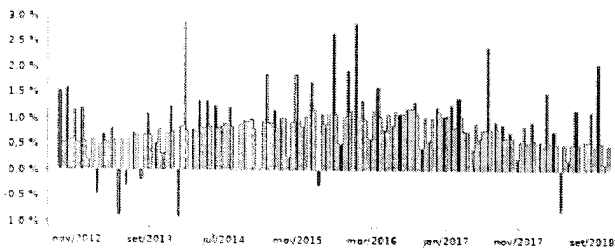
  

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	1,984559	7.415.652,21	5.392.888,40	2,34%	-2,35%	1,11%	5,19	2,34%	2,08%	-0,79%	7
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,01%	1,00	0,00%	0,58%	0,46%	0

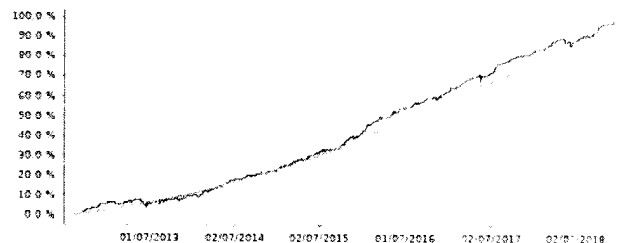
Gráficos

■ Fundo □ CDI

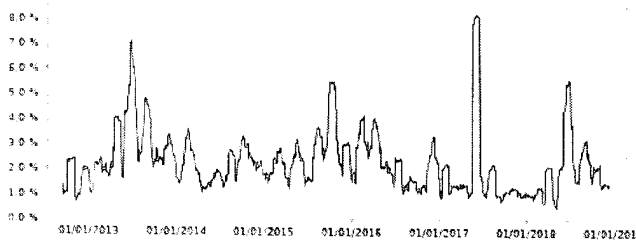
Retorno Mensal - 17/08/2012 a 13/12/2018 (mensal)



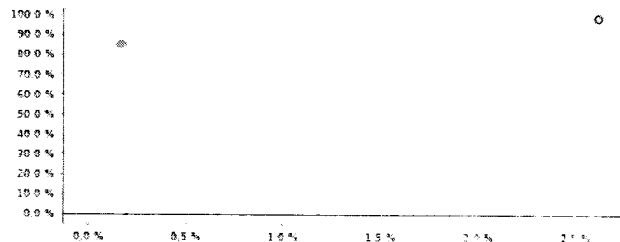
Retorno Acumulado - 17/08/2012 a 13/12/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 17/08/2012 a 13/12/2018 (diária)

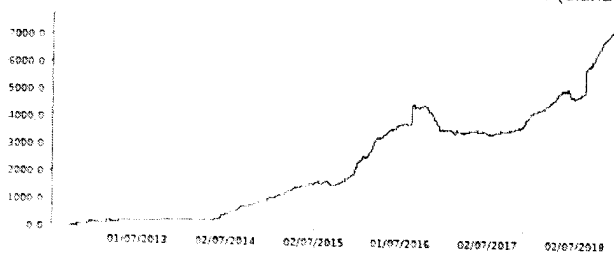


Risco x Retorno - 17/08/2012 a 13/12/2018 (diária)

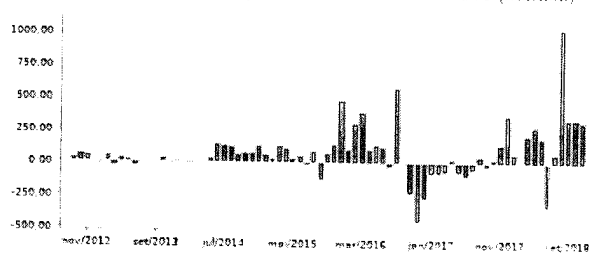


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM IPCA pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas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

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 13/12/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 13/12/2018 (mensal)



Composição da Carteira

nov/2018

Performance dos Fundos em Carteira

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

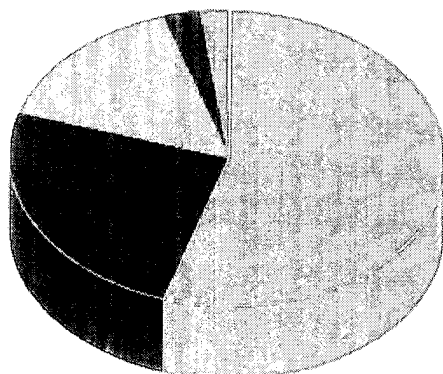
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18
Titulos Públicos	97,81%	97,83%	98,10%	97,30%	98,34%	99,56%	96,92%	98,20%
Operações Compromissadas	2,19%	2,17%	1,91%	2,71%	1,67%	0,44%	3,09%	1,81%
Valores a receber	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	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	7.304.520,06	6.974.089,25	6.494.582,56	6.077.575,26	5.028.426,83	4.897.194,28	5.226.472,50	5.077.089,80
Data da Divulgação	07/12/2018	07/11/2018	04/10/2018	05/09/2018	06/08/2018	09/07/2018	05/06/2018	07/05/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

nov/2018



NTN-B - Venc.: 15/08/2020	54,65 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	24,96 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	15,34 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2019	2,86 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2021	2,19 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	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 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 fundos 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 seguro 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 do 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 (último