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

ART. 3 º - B DA PORTARIA MPS N º 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2 º DA PORTARIA MPS N º 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	**Nº / ANO:**	**64** /2022 - GI
Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	**OF. Nº:**	**64** /2022 - GI
	Data:	25/04/22
Valor:		
R$ 19.000.000,00	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	
Dezenove milhões de reais		

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		
CNPJ do Fundo:	11.108.013/0001-03		
Segmento:	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"		
Tipo de Ativo:	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R$ 7.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	R$ 20.562,41094407		
Valor da Cota (R$):	340,42700630		
Data da Operação:	23/05/2022		
Data de Liquidação:	25/05/2022		
Patrimônio Líquido do Fundo (R$):	R$ 371.465.430,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,884%		
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%		
Banco/Agência/Conta:	Banco BNP	1	82866001
Administrador:	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)		
CNPJ do Administrador:	01.522.368/0001-82		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	21/03/2022		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R$ 227.304.723,17		
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	0,38%		
Gestor:	BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)		
CNPJ do Gestor:	02.562.663/0001-25		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	31/08/2021		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R$ 227.304.723,17		
% Recursos do Gestor com RPPS	0,38%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Excelente		
Representação do conceito	Excelente		
O fundo atende a Resolução 4.963/2021, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Sim		
Distribuidor:	MAGNA – AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA		
CNPJ do Distribuidor:	13.426.885/0001-37		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	31/08/2021		

Data de Início FI:	30/10/2009	
Taxa Administração do FI (%):	2,00	
Índíce de Referência do FI :	SMLL	
Tx Performance do FI (%):	0,20	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	SMALL CAP	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	100,00	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 4.963/2021	SIM	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	2 dias	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	7	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	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:	Superar a variação do Índice BM&FBOVESPA Small Cap ("SMLL"), investindo preponderantemente em ações de empresas que não estejam incluídas entre as maiores participações do IBrX - Índice Brasil, ou seja, ações de empresas com relativa baixa e média capitalização de mercado, através de uma estratégia ativa de investimento a partir de análises fundamentalistas.
	Principais riscos do fundo:	Ações e Derivativos (Risco 4)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	

Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior	
Retorno Médio Mensal	0,85%
Retorno Médio Anual	10,63%
Retorno Total	214,14%
Maior Retorno	15,39%
Menor Retorno	-39,40%
Qtde. mês Positivo	79
Qtde. mês Negativo	57
Qtde. mês acima do Benchmark	73
Qtde. mês abaixo do Benchmark	63
Risco Mensal Período	6,41%
Risco Mensal 12 MESES	4,98%
Risco Anual do Período	22,22%
Retorno Relativo ao Benchmark	188,68%
Sharpe	0,46
Information Ratio	1,09
Tracking Error	9,02%
VAR HISTÓRICO (95%)	11,62%
VAR 12 MESES (95%)	11,73%
Sharpe Modificado	0,53
Beta (12 meses)	-0,20
Erro Quadrático Médio (EQM)	2,64%
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 Conselho Municipal de Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos: 18/05/2022
Outras Observações:	

Outras informações : 1	
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

Outras informações : 2	
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

Outras informações : 3	
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 laudo 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
Análise do regulamento e demais documentos disponibilizados pelo gestor do fundo de investimento e os riscos inerentes às operações previstas	Foram analisados os documentos disponibilizados no site da CVM, tais como: Balancete, Balanço, Composição da Carteira, Dados Diários, Informações complementares, Lâmina, Perfil mensal, Prospecto, Regulamento e também o Questionário Due Dilligence do fundo encaminhado pelo Gestor, objetivando verificar a adequação à resolução CMN 4.963/21 e a compatibilidade do fundo com a Política de investimentos, os parâmetros de rentabilidade e riscos perseguidos por este RPPS.
Adequação das características do fundo frente às necessidades de liquidez do RPPS	O Fundo Previdenciário RECIPREV utiliza-se de estudo de ALM para equilíbrio de ativos e passivos. Atualmente o fundo tem baixa necessidade de liquidez permitindo maior volume de recursos em fundos de maior volatilidade e/ou maior prazo de resgate.
Adequação da política de seleção, alocação e diversificação de ativos e, quando for o caso, a política de concentração de ativos	Foi verificada a Política de Investimentos do Fundo para análise de conformidade com seu segmento de atuação e com os limites e vedações da resolução CMN 4.963/21, ICVM 555 e demais instruções CVM quando se tratar de fundos estruturados.
Avaliação dos dados comparativos no que se refere aos custos, retorno e risco de fundos de investimento similares	As taxas de administração dos fundos de investimentos são comparadas entre fundos do mesmo segmento (Renda Fixa, Renda Variável, Exterior, Estruturados) e modelo de gestão (Ativo ou Passivo) observando-se sempre a coerência de taxas entre os ativos comparáveis. O risco e retorno dos fundos similares são analisados em gráficos de dispersão e comparados de acordo com outras métricas estatísticas amplamente utilizadas no mercado financeiro para avaliação de risco e performance de ativos.
Verificação da compatibilidade entre o objetivo de retorno do fundo de investimento, a política de investimento do fundo, o limite de risco divulgado pelo gestor, quando couber, e eventual adequação do parâmetro utilizado para a cobrança da taxa de performance	É verificada a adequação dos ativos e percentuais permitidos na política de investimentos do fundo com seu objetivo de retorno e nível de risco atribuído pelo gestor. Quando há taxa de performance, é verificada sua adequação a resolução CMN 4.963/21 e ICVM 555.
Verificação das hipóteses de eventos de avaliação, amortização e liquidação, inclusive antecipada, quando aplicável	Este RPPS mantém o cadastro atualizado junto aos gestores/administradores dos fundos de investimentos sendo imediatamente informando por meio eletrônico quando há Assembleia Geral de Cotistas ou Fato Relevante. Os eventos de avaliação, amortização e liquidação são levados para o Comitê de Investimentos e deliberados nos casos de decisão dos cotistas.
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos	Para avaliação de performance do gestor é verificada a aderência dos fundos de investimentos sob sua gestão em relação a seus respectivos benchmarks. Também é avaliada a performance absoluta no longo prazo.
Em caso de fundos de investimento cujas carteiras sejam representadas, exclusivamente ou não, por cotas de outros fundos de investimento, deverá ser verificado que a carteira dos fundos investidos atende aos requisitos previstos em Resolução do CMN	Nos fundos que aplicam em outros fundos é verificada a declaração nos regulamentos dos fundos de que atendem a resolução CMN 4.963/21 e quando possível analisada a carteira dos fundos investidos para comprovação do atendimento dos limites e vedações da legislação.

Fundo:	BNP PARIBAS ACTION FIC FI AÇÕES
CNPJ do Fundo:	12.239.939/0001-92
Segmento:	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"
Tipo de Ativo:	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"
Tipo de operação realizada:	Resgate
Valor da operação:	R$ 12.000.000,00 ~~R$ 7.002.000,00~~ XXXXXXXXX
Quantidade de Cotas:	R$ 20.032,44231711
Valor da Cota (R$):	349,43317890
Data da Operação:	02/05/2022

Data de Liquidação:			04/05/2022
Patrimônio Líquido do Fundo (R$):	R$		202.604.040,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:			3,455%
Limite Máximo por PL do fundo			15,00%
Banco/Agência/Conta:	Banco BNP	1	82866001
Administrador:			BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)
CNPJ do Administrador:			01.522.368/0001-82
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:			21/03/2022
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN			Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS			R$ 227.304.723,17
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.			0,38%
Gestor:			BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)
CNPJ do Gestor:			02.562.663/0001-25
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:			31/08/2021
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN			Não
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R$		227.304.723,17
% Recursos do Gestor com RPPS			0,38%
Empresa de Rating			Fitch Ratings
Conceito			Excelente
Representação do conceito			Excelente
O fundo atende a Resolução 4.963/2021, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN			Sim
Distribuidor:			MAGNA – AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA
CNPJ do Distribuidor:			13.426.885/0001-37
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:			31/08/2021
Data de Início FI:			22/09/2011
Taxa Administração do FI (%):			2,00
Índíce de Referência do FI :			IBOVESPA
Tx Performance do FI (%):			0,20
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):			IBOVESPA
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):			100,00
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 4.963/2021			SIM
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:			Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:			Dispensado
Carência (dias):			1 dias
Data Listagem Bolsa:			Não listado
Resgate (dias):			29
Cód. Negociação Bolsa:			Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:			INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:			Sim
CNPJ do Fundo:			12.241.282/0001-06
Segmento:			Renda Variável
Tipo de Ativo:			Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"
% Carteira do Fundo:			100,00%
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:	Buscar elevados retornos absolutos no longo prazo, investindo no mínimo 95% de sua carteira em cotas do BNP Paribas Action Master FI Ações que possui uma gestão ativa de investimentos concentrada em ações de companhias abertas e que apresentem sólidos modelos de negócio e geração de caixa positiva, governança corporativa e qualidade na gestão, selecionadas a partir de análises fundamentalistas.	
	Principais riscos do fundo:	Ações e Derivativos (Risco 4)	
	Risco do Fundo atribuido pelo Administrador	Risco Alto	
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos =	Curto Prazo		

Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior	
Retorno Médio Mensal	1,13%
Retorno Médio Anual	14,49%
Retorno Total	318,85%
Maior Retorno	14,68%
Menor Retorno	-29,79%
Qtde. mês Positivo	86
Qtde. mês Negativo	41
Qtde. mês acima do Benchmark	72
Qtde. mês abaixo do Benchmark	55
Risco Mensal Período	4,84%
Risco Mensal 12 MESES	4,20%
Risco Anual do Período	16,78%
Retorno Relativo ao Benchmark	322,22%
Sharpe	0,84
Information Ratio	1,03
Tracking Error	14,16%
VAR HISTÓRICO (95%)	9,22%
VAR 12 MESES (95%)	9,33%
Sharpe Modificado	0,91
Beta (12 meses)	0,96
Erro Quadrático Médio (EQM)	4,10%
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 Conselho Municipal de Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos: 18/05/2022
Outras Observações:	

Outras informações : 1	
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

Outras informações : 2	
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

Outras informações : 3	
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 laudo 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
Análise do regulamento e demais documentos disponibilizados pelo gestor do fundo de investimento e os riscos inerentes às operações previstas	Foram analisados os documentos disponibilizados no site da CVM, tais como: Balancete, Balanço, Composição da Carteira, Dados Diários, Informações complementares, Lâmina, Perfil mensal, Prospecto, Regulamento e também o Questionário Due Dilligence do fundo encaminhado pelo Gestor, objetivando verificar a adequação à resolução CMN 4.963/21 e a compatibilidade do fundo com a Política de investimentos, os parâmetros de rentabilidade e riscos perseguidos por este RPPS.
Adequação das características do fundo frente às necessidades de liquidez do RPPS	O Fundo Previdenciário RECIPREV utiliza-se de estudo de ALM para equilíbrio de ativos e passivos. Atualmente o fundo tem baixa necessidade de liquidez permitindo maior volume de recursos em fundos de maior volatilidade e/ou maior prazo de resgate.
Adequação da política de seleção, alocação e diversificação de ativos e, quando for o caso, a política de concentração de ativos	Foi verificada a Política de Investimentos do Fundo para análise de conformidade com seu segmento de atuação e com os limites e vedações da resolução CMN 4.963/21, ICVM 555 e demais instruções CVM quando se tratar de fundos estruturados.
Avaliação dos dados comparativos no que se refere aos custos, retorno e risco de fundos de investimento similares	As taxas de administração dos fundos de investimentos são comparadas entre fundos do mesmo segmento (Renda Fixa, Renda Variável, Exterior, Estruturados) e modelo de gestão (Ativo ou Passivo) observando-se sempre a coerência de taxas entre os ativos comparáveis. O risco e retorno dos fundos similares são analisados em gráficos de dispersão e comparados de acordo com outras métricas estatísticas amplamente utilizadas no mercado financeiro para avaliação de risco e performance de ativos.
Verificação da compatibilidade entre o objetivo de retorno do fundo de investimento, a política de investimento do fundo, o limite de risco divulgado pelo gestor, quando couber, e eventual adequação do parâmetro utilizado para a cobrança da taxa de performance	É verificada a adequação dos ativos e percentuais permitidos na política de investimentos do fundo com seu objetivo de retorno e nível de risco atribuído pelo gestor. Quando há taxa de performance, é verificada sua adequação a resolução CMN 4.963/21 e ICVM 555.
Verificação das hipóteses de eventos de avaliação, amortização e liquidação, inclusive antecipada, quando aplicável	Este RPPS mantém o cadastro atualizado junto aos gestores/administradores dos fundos de investimentos sendo imediatamente informando por meio eletrônico quando há Assembleia Geral de Cotistas ou Fato Relevante. Os eventos de avaliação, amortização e liquidação são levados para o Comitê de Investimentos e deliberados nos casos de decisão dos cotistas.
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos	Para avaliação de performance do gestor é verificada a aderência dos fundos de investimentos sob sua gestão em relação a seus respectivos benchmarks. Também é avaliada a performance absoluta no longo prazo.

Em caso de fundos de investimento cujas carteiras sejam representadas, exclusivamente ou não, por cotas de outros fundos de investimento, deverá ser verificado que a carteira dos fundos investidos atende aos requisitos previstos em Resolução do CMN	Nos fundos que aplicam em outros fundos é verificada a declaração nos regulamentos dos fundos de que atendem a resolução CMN 4.963/21 e quando possível analisada a carteira dos fundos investidos para comprovação do atendimento dos limites e vedações da legislação.

Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)

ASSINADO DIGITALMENTE POR
JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
CPF: ***.326.354-00 **DATA:** 03/06/2022 18:02
LOCAL: RECIFE - PE
CODIGO: 39131bea-8a01-49e3-a2a9-70ebcbe8572d
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

ASSINADO DIGITALMENTE POR
MARCO AURÉLIO CORREIA PINHEIRO
CPF: ***.174.444-72 **DATA:** 04/06/2022 06:56
LOCAL: RECIFE - PE
CODIGO: 95a08540-1385-4528-8027-293afa21e123
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

Recife, 25 de abril de 2022
Oficio nº 064/2022 DP

Ilmo Senhor
MIGUEL
MAGNA – AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA

Solicitamos efetuar as seguintes operações;

a) Resgatar o valor de R$ 7.000.000,00 (Sete milhões de reais), do fundo BNP PARIBAS ACTION FIC FI AÇÕES CNPJ: 12.239.939/0001-92;
b) Resgatar o valor de R$ 12.000.000,00 (Doze milhões de reais), do fundo BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CNPJ: 11.108.013/0001-03.

Os resgates visam adequar a participação percentual máximo por fundo de investimentos, conforme diretrizes de risco da RECIPREV, e evitar o desenquadramento.

Na oportunidade, pedimos encaminhar TED conforme dados abaixo:

Banco: Banco do Brasil S.A.
Agência: 3234-4
Conta Corrente: 7.909-X
Favorecido: FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV
CNPJ: 07.749.668/0001-85

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 064/2022

Atenciosamente,

ASSINADO DIGITALMENTE POR
JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
CPF: ***.326.354-00 **DATA:** 23/04/2022 14:35
LOCAL: RECIFE - PE
CÓDIGO: 51bf261d-294f-4253-a1ac-83c051da0056
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

ASSINADO DIGITALMENTE POR
ELCIO RICARDO LEITE GUIMARAES
CPF: ***.849.814-49 **DATA:** 24/04/2022 19:55
LOCAL: RECIFE - PE
CÓDIGO: ec9de5f7-9169-409e-9ec7-ae39268ae05c
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

:: BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES

02/05/2022

Características

CNPJ: 12.239.939/0001-92
Gestão: BNP Paribas Asset Management
Administrador: BNP Paribas
Taxa de Administração: 2,00%
Taxa de Administração (Máxima): 2,02%
Classificação Anbima: Ações Livre
Código de Referência: 287393
Início do Fundo: 22/09/2011

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R$ 5.000,00
Aplicação Adicional: R$ 5.000,00
Saldo Mínimo: R$ 1.000,00
Resgate Mínimo: R$ 5.000,00
Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Conversão da Cota para Resgate: D+27
Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+29

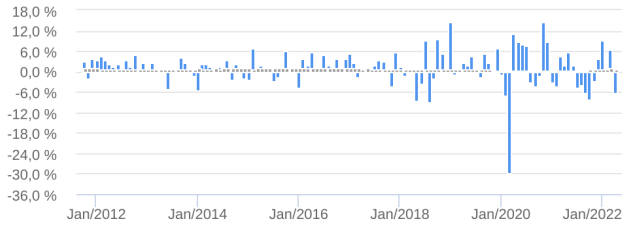
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21
Fundo	249,43	7,56	-8,13	27,61	13,46	-6,42	6,40	0,03	9,15	3,75	-2,73	-8,24	-6,13	-3,92	-4,68	1,67	5,53
% do CDI	181,95	227,54	-114,18	292,01	88,84	-769,88	693,07	4,22	1.249,73	490,59	-464,67	-1.715,53	-1.399,87	-924,69	-1.315,57	546,74	2.067,31
CDI	137,09	3,32	7,12	9,46	15,15	0,83	0,92	0,75	0,73	0,76	0,59	0,48	0,44	0,42	0,36	0,30	0,27
Ibovespa	100,15	1,73	-10,31	31,15	10,87	-10,10	6,06	0,89	6,98	2,85	-1,53	-6,74	-6,57	-2,48	-3,94	0,46	6,16
IBX	151,77	2,05	-11,21	32,81	14,22	-10,11	5,96	1,46	6,87	3,14	-1,69	-6,81	-6,99	-3,25	-3,99	0,63	5,92
IGP-M	151,67	7,00	14,69	51,53	61,60	1,41	1,74	1,83	1,82	0,87	0,02	0,64	-0,64	0,66	0,78	0,60	4,10

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	349,4331789	202.604,04	257.970,33	18,40%	-24,88%	8,74%	3,07	18,40%	9,15%	-8,24%	5
CDI	-	-	-	0,17%	-	0,08%	1,00	0,00%	0,92%	0,27%	0

Gráficos

Fundo CDI

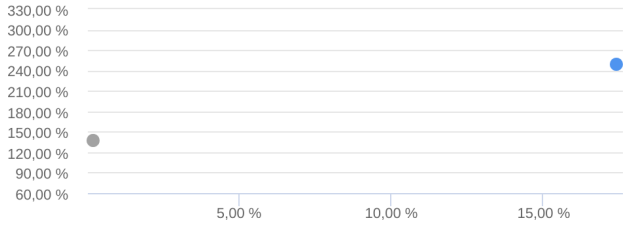
Retorno Mensal - 23/09/2011 a 02/05/2022 (mensal)



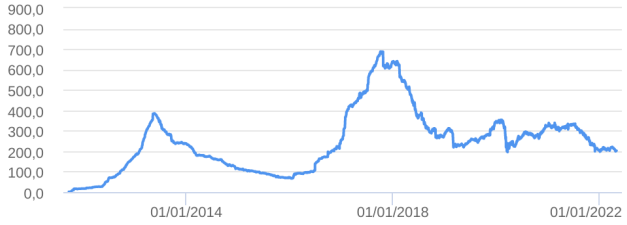
Retorno Acumulado - 23/09/2011 a 02/05/2022 (diária)

Volatilidade Anualizada - 23/09/2011 a 02/05/2022 (diária)

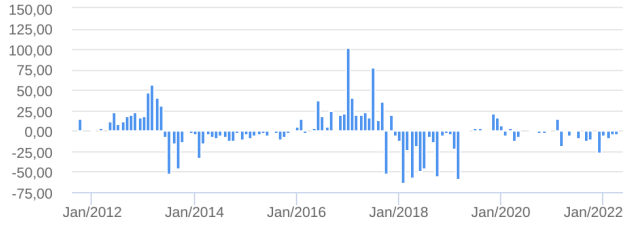
Risco x Retorno - 23/09/2011 a 02/05/2022 (diária)



Patrimônio Líquido (R$ Milhões) - 23/09/2011 a 02/05/2022 (diária)



Fluxo Mensal (R$ Milhões) - 23/09/2011 a 02/05/2022 (mensal)



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

abr/2022

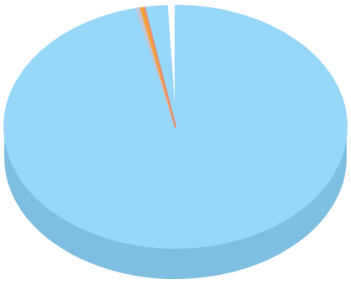
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas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

:: BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES

02/05/2022

Tipo de Aplicação	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21	out/21	set/21
Cotas de Fundos	102,18%	100,10%	99,91%	98,85%	99,73%	89,18%	99,62%	100,11%
Operações Compromissadas	0,45%	0,09%	0,09%	0,08%	0,02%	0,07%	0,10%	0,07%
Valores a receber	0,35%	0,01%	0,23%	1,26%	0,52%	11,05%	4,36%	1,00%
Disponibilidades	0,01%	0,00%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-2,99%	-0,20%	-0,24%	-0,20%	-0,28%	-0,31%	-4,07%	-1,19%
Patrimônio Líquido (R$ mil)	199.938,36	218.822,10	209.736,02	218.945,32	205.904,38	224.686,89	230.759,98	262.817,56
Data da Divulgação	04/05/2022	05/04/2022	03/03/2022	03/02/2022	04/01/2022	03/12/2021	04/11/2021	04/10/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%) abr/2022



Cotas de BNP PARIBAS ACTION MASTER FI AÇÕES	102,18 %
Outros Valores a pagar	-2,99 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/08/2024	0,45 %
Outros Valores a receber	0,35 %
Outras Disponibilidades	0,01 %

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, 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 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.

:: BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES

23/05/2022

Características

CNPJ: 11.108.013/0001-03
Gestão: BNP Paribas Asset Management
Administrador: BNP Paribas
Taxa de Administração: 2,00%
Taxa de Administração (Máxima): 2,00%
Classificação Anbima: Ações Small Caps
Código de Referência: 237191
Início do Fundo: 29/10/2009

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R$ 5.000,00
Aplicação Adicional: R$ 1.000,00
Saldo Mínimo: R$ 1.000,00
Resgate Mínimo: R$ 1.000,00
Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Conversão da Cota para Resgate: D+5 du
Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+7 du

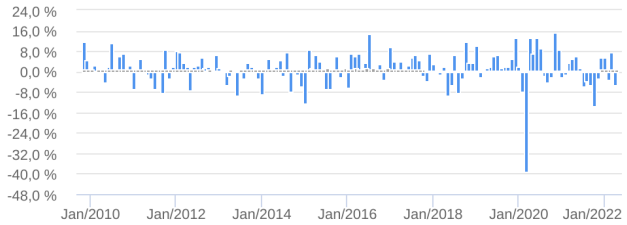
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21
Fundo	240,43	0,35	-19,13	31,53	22,24	-5,28	7,36	-3,24	5,58	5,23	-2,97	-13,79	-5,27	-3,75	-5,64	1,27	6,20
% do CDI	127,91	8,76	-249,26	314,74	143,25	-633,00	797,41	-432,03	762,55	685,42	-505,82	-2.871,39	-1.201,60	-885,23	-1.587,25	415,78	2.316,54
CDI	187,97	4,05	7,67	10,02	15,53	0,83	0,92	0,75	0,73	0,76	0,59	0,48	0,44	0,42	0,36	0,30	0,27
Ibovespa	79,29	5,27	-9,99	35,69	16,79	-10,10	6,06	0,89	6,98	2,85	-1,53	-6,74	-6,57	-2,48	-3,94	0,46	6,16
IBX	140,54	5,58	-10,47	37,87	19,93	-10,11	5,96	1,46	6,87	3,14	-1,69	-6,81	-6,99	-3,25	-3,99	0,63	5,92
IGP-M	191,83	7,38	11,84	51,67	61,64	1,41	1,74	1,83	1,82	0,87	0,02	0,64	-0,64	0,66	0,78	0,60	4,10

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	340,4270063	371.465,43	509.255,15	25,65%	-33,43%	12,18%	2,53	25,64%	7,36%	-13,79%	5
CDI	-	-	-	0,17%	-	0,08%	1,00	0,00%	0,92%	0,27%	0

Gráficos

Fundo CDI

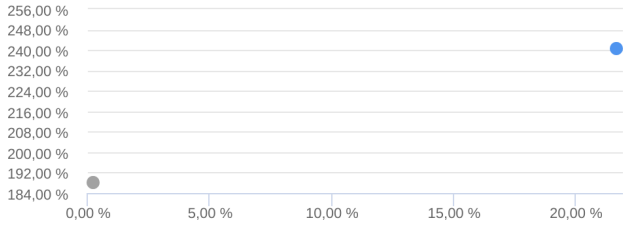
Retorno Mensal - 03/11/2009 a 23/05/2022 (mensal)



Retorno Acumulado - 03/11/2009 a 23/05/2022 (diária)

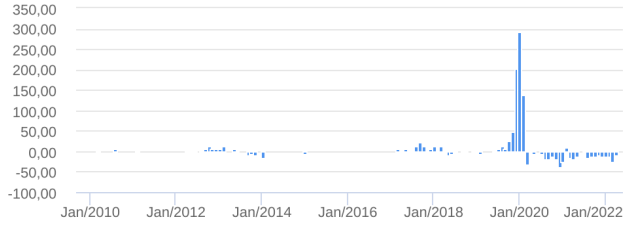
Volatilidade Anualizada - 03/11/2009 a 23/05/2022 (diária)

Risco x Retorno - 03/11/2009 a 23/05/2022 (diária)



Patrimônio Líquido (R$ Milhões) - 03/11/2009 a 23/05/2022 (diária)

Fluxo Mensal (R$ Milhões) - 03/11/2009 a 23/05/2022 (mensal)



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

abr/2022

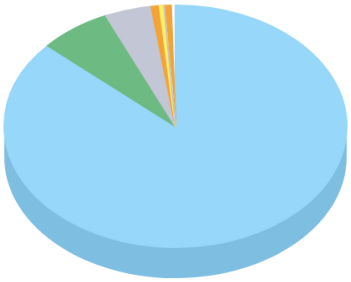
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas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

:: BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES

23/05/2022

Tipo de Aplicação	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22	dez/21	nov/21	out/21	set/21
Ações	87,54%	86,82%	92,09%	89,74%	85,10%	84,10%	82,71%	89,53%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	6,81%	6,29%	1,38%	3,05%	2,80%	8,00%	5,69%	1,09%
Títulos Públicos	4,45%	4,07%	0,64%	0,60%	0,61%	0,62%	0,58%	0,48%
Operações Compromissadas	1,86%	3,14%	8,63%	6,76%	8,32%	7,32%	8,24%	4,67%
Valores a receber	0,42%	0,31%	0,28%	0,38%	1,16%	0,10%	0,50%	1,63%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-1,08%	0,63%	-3,95%	-0,53%	-1,03%	-1,05%	-0,72%	-0,78%
Cotas de Fundos	-	-	0,93%	-	2,16%	-	-	-
Obrigações por ações e outros TVM recebidos em empréstimo	-	-	-	-	-0,88%	-0,90%	-2,87%	-3,38%
Opções - Posições lançadas	-	-	-	-	-	-0,00%	-	-
Opções - Posições titulares	-	-	-	-	-	-	0,12%	-
Patrimônio Líquido (R$ mil)	402.246,99	436.762,16	429.981,46	456.383,34	444.667,64	435.071,82	459.836,56	548.501,13
Data da Divulgação	06/05/2022	05/04/2022	09/03/2022	03/02/2022	05/01/2022	08/12/2021	04/11/2021	04/10/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%) abr/2022



Ações (omitidas)	87,54 %
Outros Certificados ou recibos de depósito de valores mobiliários	6,81 %
Títulos Públicos (omitidos)	4,45 %
Operações Compromissadas	1,86 %
Valores a pagar (omitidos)	-1,08 %
Valores a receber (omitidos)	0,42 %
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, 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, 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 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.