

VERSÃO: FEVEREIRO DE 2022



**AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA A SAÚDE
DOS SERVIDORES**

MANUAL DE PROCEDIMENTOS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS E DE RISCOS

SUMÁRIO

| | |
|--|-----------|
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência a Saúde dos Servidores | 1 |
| MANUAL DE PROCEDIMENTOS DA..... | 1 |
| GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS E DE..... | 1 |
| RISCOS..... | 1 |
| OBJETIVOS..... | 6 |
| ARQUIVOS DIGITAIS - CAPÍTULO I..... | 8 |
| pasta pendências..... | 8 |
| pasta reciprev DIVERSOS | 8 |
| pasta resumos carteira reciprev..... | 10 |
| pasta cadprev | 11 |
| ARQUIVOS FÍSICOS - CAPÍTULO II..... | 13 |
| composição dos arquivos da gerência de investimentos..... | 13 |
| móvel fixo na parede da sala da gerência de investimento..... | 13 |
| armário da gerência de investimento cor branca..... | 13 |
| POLÍTICA DE INVESTIMENTOS E DPIN- CAPÍTULO III..... | 16 |
| elaboração da política de investimentos | 16 |
| cálculos da política de investimentos..... | 16 |
| procedimentos para gerar a política de investimentos..... | 18 |
| CREDENCIAMENTOS, ATUALIZAÇÕES E DESCREDENCIAMENTOS - CAPÍTULO IV | 21 |
| credenciamentos | 21 |
| atualizações de credenciamentos | 24 |
| descredenciamentos ou suspensões de credenciamentos..... | 26 |
| COMITÊ DE INVESTIMENTOS - CAPÍTULO V | 29 |
| processo das deliberações do comitê de investimentos..... | 29 |

| | |
|--|-----------|
| ATIVIDADES DIÁRIAS, MENSAIS E ANUAIS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS - CAPÍTULO VI | 32 |
| ATIVIDADES DIÁRIAS | 32 |
| ATIVIDADES MENSAIS | 32 |
| ATIVIDADES ANUAL | 33 |
| quando ocorrer necessidade | 33 |
| CONSULTA DIÁRIA DAS CONTAS CORRENTES – OFÍCIOS – APR – PENDÊNCIAS – CAPÍTULO VII..... | 35 |
| procedimentos | 35 |
| pendências | 37 |
| PLANILHA RELATÓRIOS DIVERSOS – CAPÍTULO VIII..... | 39 |
| procedimentos | 39 |
| planilha relatórios diversos – INCLUSÃO E EXCLUSÃO DE FUNDOS | 44 |
| PLANILHA ATUALIZAÇÃO DE FUNDOS PELO DI E IBOVESPA – CAPÍTULO IX.. | 48 |
| procedimentos | 48 |
| PLANILHA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – CAPÍTULO X..... | 54 |
| procedimentos | 54 |
| DAIR- CAPÍTULO XI..... | 65 |
| procedimentos | 65 |
| OUTRAS ATIVIDADES - CAPÍTULO XII | 68 |
| CRONOGRAMA DAS REUNIÕES DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS | 68 |
| plano de ação anual da gerência de investimentos | 68 |
| plano de capacitação | 68 |
| comunicação interna - CI..... | 68 |
| APLICATIVO QUANTUM AXIS - CAPÍTULO XIII..... | 70 |
| definição..... | 70 |
| operando o sistema | 70 |
| MODELOS E DIRETRIZES - CAPÍTULO XIV | 73 |

| | |
|--|------------|
| CRENCIAMENTO, ANÁLISE E RENOVAÇÕES DAS INSTITUIÇÕES: GESTORES E ADMINISTRADORES | 73 |
| CRENCIAMENTO, ANÁLISE E RENOVAÇÕES DAS INSTITUIÇÕES DISTRIBUIDORAS | 74 |
| CRENCIAMENTO, ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS | 75 |
| RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTOS DIÁRIOS E MENSASIS | 78 |
| DELIBERAÇÕES DOS INVESTIMENTOS | 80 |
| AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR | 84 |
| CONTRATOS DE PRESTAÇÃO DE SERVIÇOS | 87 |
| FLUXO DE ENTRADAS E SAÍDAS | 87 |
| metodologia e critérios para análise prévia dos riscos dos investimentos e as diretrizes de controle e monitoramento | 89 |
| metodologia e critérios para avaliação e acompanhamento do retorno esperado dos investimentos | 90 |
| plano de contingências | 91 |
| distribuição da carteira por prazos e ativos | 91 |
| ALÇADAS - CAPÍTULO XV | 94 |
| alçadas | 94 |
| COMITÊ DE RISCOS - CAPÍTULO XVI | 96 |
| comitê de riscos | 96 |
| procedimentos mensais | 96 |
| PLANO DE TRABALHO E PRESTAÇÃO DE CONTAS DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS - CAPÍTULO XVII | 100 |
| comitê de INVESTIMENTOS | 100 |
| PLANO DE TRABALHO | 100 |
| PRESTAÇÃO DE CONTAS | 100 |
| ALM – ASSET LIABILITY MANAGEMENT - CAPÍTULO XVIII | 102 |
| estudo de asset liability management | 102 |
| MODELOS - CAPÍTULO XIX | 104 |
| modelos | 104 |

| | |
|--|------------|
| MAPEAMENTOS - CAPÍTULO XX..... | 108 |
| mAPEAMENTOS | 108 |
| formular e aprovar a política de investimentos | 109 |
| credenciar instituições financeiras..... | 110 |
| gestão de riscos dos investimentos | 111 |
| apr | 112 |

OBJETIVOS

O **Manual de Procedimentos** busca facilitar e padronizar a realização de todas as atividades da Gerência de Investimentos, além de atender a **Portaria MPS n° 185, de 14 de maio de 2015 "Programa de Pró-Gestão RPPS" e alterações.**

Trata-se do "Manual de Procedimentos da Gerência de Investimentos", sendo a primeira edição elaborada em outubro de 2015. Porém, o mesmo está sujeito a modificações em decorrência das alterações de procedimentos, da inclusão ou exclusão de arquivos/pastas/procedimentos ou mesmo pela modificação da forma de realização das atividades.

O Manual de Procedimentos procura demonstrar de forma simplificada os passos a serem seguidos, para a realização de cada atividade, nos diversos aplicativos como: Quantum, CADPREV e planilhas, ao tempo em que preserva os dados, assim como as equações matemáticas utilizadas nas diversas planilhas. Serve, ainda, como um "checklist" das atividades a serem realizadas pela Gerência de Investimentos.

Com vistas a uma melhor compreensão, o manual possui a classificação em capítulos, e estes em temas e subtemas. Os grandes temas constam de capítulos isolados para melhor compreensão, tais como Política de Investimentos; Política de Riscos; Comitê de Investimentos; Credenciamentos e atividades diárias, mensais e anuais.

Este manual ajudará nos procedimentos, porém, não se esgota em si mesmo, devendo, ser aperfeiçoado de modo a permitir a realização das atividades da forma mais eficiente.

CAPÍTULO I

ARQUIVOS DIGITAIS

ARQUIVOS DIGITAIS - CAPÍTULO I

Os arquivos digitais estão distribuídos nas seguintes pastas:

- ✓ **PENDÊNCIAS**
- ✓ **RECIPREV DIVERSOS**
- ✓ **RESUMOS DA CARTEIRA RECIPREV**
- ✓ **SISTEMA CADPREV**

PASTA PENDÊNCIAS

- **Pendências:** Apresenta várias subpastas de pendências a serem tratadas no dia-a-dia;

PASTA RECIPREV DIVERSOS

Apresenta as seguintes subpastas:

- **Análise Marcação na Curva das NTN-B 2045:** Análise a respeito da marcação pela curva de juros ou a mercado das NTN-B 2045, para o ano de 2018 e 2019;
- **Artigos Antigos RECIPREV:** Constam diversos arquivos antigos;
- **Audiências Públicas na Câmara:** Apresentações das audiências públicas por ano;
- **Auditorias – TCE - Demais:** Material das auditorias e TCE;
- **Balanços e CNPJ da RECIPREV:** Balanços da Autarquia e dos fundos RECIFIN e RECIPREV de 2011 até 2017 e o CNPJ;
- **Cálculo Taxa Administração:** Cálculos da taxa dos fundos RECIFIN e RECIPREV;
- **CIs da Gerência Investimentos:** CIs da Gerência de Investimentos de 2013 até a data mais atualizada;
- **Conselhos:** Diversos documentos sobre os Conselhos Municipal de Previdência e Conselho Fiscal;
- **Cursos:** CPA; Pró Gestão, Dair e Dpin;
- **Consultoria:** Documentos antigos de Consultoria;
- **Contabilidade RPPS:** manual de contabilidades RPPS;

- **Desenquadramentos:** Documentos a respeito de desenquadramentos;
- **Documentos BB-CEF-BRADESCO:** Diversos documentos;
- **Documentos dos representantes da AMPASS:** Cópia de documentos de dos representantes da RECIPREV;
- **Documentos Prefeitura Recife:** Diversos documentos, inclusive os cálculos de projeções;
- **Documentos sobre as NTN-B:** Documentos aquisição NTN-B;
- **Estudos Atuariais:** Consta todos os estudos atuarias do RECIFIN e RECIPREV;
- **Eventos:** Eventos realizados com a participação da RECIPREV;
- **Grupo Trabalho Nova 3.922:** material do GT 3.922 de 20219;
- **Indicador de Situação Previdenciária - ISP-RPPS:** Contêm normas sobre o indicador do Ministério criado em 2017, para avaliar os RPPS;
- **Leis:** Todas as leis e Portarias da RECIPREV, Ministério da Previdência e Conselho Monetário Nacional;
- **Nota Técnica suspensão repasses:** todo material e cálculos suspensão dos repasses em 2020;
- **Novas Certificações RPPS 19.12.2019:** material a respeito das certificações RPPS;
- **Planejamento Estratégico:** Planejamento Estratégico da AMPASS;
- **Plano de Ação 2019:** Documentos sobre o plano de ação da gerência de investimentos para 2019;
- **Portarias Nomeações Diversas:** Diversas portarias de nomeações;
- **Pró Gestão:** Normas do Pró Gestão;
- **Relatório Geral da Gerência de Investimentos:** Relatório geral da Gerência de Investimentos, contemplando todas as ações que foram realizadas na Gerência de Investimentos de 2013 até certa data;
- **Revista Investidor Institucional abril 2020:** material da revista;
- **Sistema UFPE:** Tudo sobre o sistema da UFPE e RECIPREV;
- **Teletrabalho:** material do Teletrabalho;
- **Visitas aos FIPS:** Documentários das diligências de FIPS;

PASTA RESUMOS CARTEIRA RECIPREV

- **Cálculos Diários:** Subpastas: Cálculos Diários e Semanais e Subpastas por ano que contêm os Relatórios Diversos;
- **Cálculos da Carteira:** Subpastas por ano dos cálculos da Carteira RECIPREV;
- **Cálculos Instituições e Rankings ANBIMA:** Subpastas dos cálculos e Rankings ANBIMA;
- **Relatórios Mensais da Carteira de Investimentos:** Relatórios Mensais da Carteira de Investimentos;
- **Comitê de Investimentos:** Todos os documentos do Comitê de Investimentos;
- **Manual de Processos Gerência Investimentos:** Manual da Gerência de Investimentos;
- **APR e Atestados de Compatibilidades:** Modelos de APR e Atestados, bem como todas as APR e Atestados digitalizados e relatórios de APR divulgados no CADPREV;
- **Modelos de Ofício:** Modelos dos ofícios;
- **Contas Corrente:** Contas corrente da RECIPREV e RECIFIN;
- **DAIR:** Arquivos DAIR;
- **Contratos de Serviços Investimentos:** Resumo dos contatos de Serviços da área de investimentos para o Site da RECIPREV;
- **Modelos CI:** Modelos de CI;
- **Política:** Documentos da Política de Investimentos;
- **Site RECIPREV:** Documentos constantes no Site da RECIPREV;
- **Credenciar Instituições:** Documentos do Credenciamento e Descredenciamento de Instituições;
- **Declarações de Investidor Qualificado:** Declarações de Investidor Qualificado;
- **Planos de Ações e Treinamentos:** Os planos de ações da Gerência de Investimentos, bem como os planos de treinamentos;
- **Alçadas:** Consta as alçadas relativas à área de investimentos;
- **Comitê de Riscos:** Consta todos documentos da Política de Riscos;
- **Estudo de ALM:** constam os ALM de 2019 e 2020

PASTA CADPREV

- **Sistema CADPREV:** Sistema para registro do DAIR e DPIN.

CAPÍTULO II

ARQUIVOS FÍSICOS

ARQUIVOS FÍSICOS - CAPÍTULO II

Os arquivos físicos dos documentos compreendem:

Local dos arquivos: Sala da Gerência de Investimentos. Localizados nos armários da Gerência de Investimentos.

COMPOSIÇÃO DOS ARQUIVOS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS

MÓVEL FIXO NA PAREDE DA SALA DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTO

Todos os documentos recebidos dos Gestores, Administradores e Custodiantes.

ARMÁRIO DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTO COR BRANCA

- **1 Pasta de Documentos Diversos**: Contêm diversos documentos da Gerência de Investimentos;
- **4 Pastas de Credenciamentos**: Contêm os originais das súmulas de credenciamentos das Instituições por ordem alfabética;
- **3 Pasta de Credenciamentos Encerrados**: Contêm os originais das súmulas de credenciamentos encerrados das Instituições por ordem alfabética;
- **1 Pasta de Atas do Comitê de Investimentos**: Contêm os originais das Atas do Comitê de Investimentos;
- **1 Pasta de Atas de Declarações de Veracidade**: Contêm os originais das Declarações de Veracidade do DAIR;
- **1 Pasta de Relatórios Trimestrais**: Contêm os originais dos Relatórios Trimestrais a partir do ano de 2013 até o ano de 2015;
- **3 Pastas Políticas de Investimentos**: Contêm os originais das Políticas de Investimentos a partir de:
 - 2013 a 2015;
 - 2016 a 2020;

- **17 Pastas de APR/Ofícios:** Contêm os originais dos ofícios/APR/Atestados de Compatibilidades. Dividido da seguinte forma:
 - 1 Pasta de 2012;
 - 1 Pasta de 2013;
 - 2 Pastas de 2014;
 - 2 Pastas de 2015;
 - 2 Pastas de 2016;
 - 2 Pastas de 2017;
 - 4 Pastas de 2018;
 - 4 Pastas de 2019;
 - 1 Pasta de 2020;
- **3 Pasta de Relatórios Mensais da Carteira de Investimentos:** Contêm os originais dos Relatórios Mensais da Carteira de Investimentos de:
 - 2016 a junho 2017;
 - A partir de julho de 2017 a dezembro de 2018;
 - A partir de janeiro de 2019.

CAPÍTULO III

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS E DPIN

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS E DPIN- CAPÍTULO III

A Política de Investimentos do ano seguinte deve ser encaminhada até 31 de dezembro do ano anterior.

ELABORAÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

CÁLCULOS DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

Copiar o arquivo **Cálculo da Política** existente na pasta RESUMOS CARTEIRA RECIPREV -> 13. Política -> Política -> Ano -> Cálculo da Política.

O arquivo possui as subpastas:

- **Metas**
- **Estatística**
- **Fluxo Recursos ano atual**
- **Fluxo Recursos ano seguinte**
- **Entrada de Dados**
- **Rentabilidade e Estratégia**
- **Resumo**
- **Política**

METAS

- Baixe o arquivo de Cenários do Focus – BACEN no seguinte endereço:
<https://www.bcb.gov.br/pec/GCI/PORT/readout/readout.asp>;
- Veja quais as expectativas do IPCA e SELIC para o ano atual e seguinte e informe na aba Metas.

ESTATÍSTICA

Na aba Estatística informe todos os fundos que estão compondo a carteira atual. Parta tanto, coletar os dados na planilha da carteira do mês em que está fazendo a Política de Investimentos. Poderá, também, adicionar novos fundos ou índices.

Na aba Estatística complete os demais dados (taxas de retornos), com base na planilha de Relatórios Diários na aba de retorno dos produtos. Faça isto para os 12 meses do ano seguinte.

FLUXO DE RECURSOS DO ANO SEGUINTE

Preencha o fluxo de entradas e saídas do ano seguinte da Política de Investimentos com vistas a obtermos o saldo final das. Para tanto, faz-se necessário conhecer o fluxo médio mensal de entradas e saídas.

ENTRADA DE DADOS

Com base nos fluxos de entradas e saídas defina os resgates e aplicações do ano seguinte. Para facilitar os trabalhos, coletar o resultado final do fluxo de cada ano e definir os resgates e aplicações com base nos cenários.

RENTABILIDADE E ESTRATÉGIA

Verifique o resultado final das estratégias e se está coerente com a meta definida. Caso não esteja, reveja as alocações e resgates ou o fluxo. Após a revisão, outras sugestões podem ser propostas, caso seja factível e possível.

RESUMO

Aqui é efetuado o cálculo das taxas de retornos dos blocos do DAIR de forma ponderada.

POLÍTICA

Aqui é o resultado final da Política de Investimentos em números para ser preenchida no DPIN.

PROCEDIMENTOS PARA GERAR A POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

1. Acessar o DPIN no CADPREV local. Inserir o ano da nova política de investimentos e preencher todas as informações do DPIN fazendo as adequações necessárias para o ano;
2. Imprima o DPIN em “pdf”;
3. Transforme o arquivo do DPIN em “pdf” para “word”, através de qualquer aplicativo gratuito da internet que faz conversão;
4. Com base no relatório “word” elabore a Política de Investimentos;
5. Transforme o relatório da política de investimentos de “word” para “pdf” e encaminhe com antecedência por e-mail para deliberações, primeiramente, pelo Comitê de Investimentos e depois pelo Conselho Municipal de Previdência;
6. Nos dias das reuniões, atentar para as Atas das reuniões;
7. Acessar o DPIN no CADPREV local e imposter o restante das informações necessárias ao fechamento do DPIN, como datas das reuniões e os textos das deliberações dos Comitê de Investimentos e Conselho Municipal de Previdência; data de publicação e outros dados que se façam necessários. Não tendo mais nenhuma pendência, gerar o arquivo “XML” da Política de Investimentos e salvar;
8. Acessar CADPREV WEB e transmitir o arquivo: “XML” da Política de Investimentos (Atentar para o nome do arquivo de acordo com o Manual do DPIN);
9. Após decorrido um espaço de tempo, Acessar CADPREV WEB e consultar se o arquivo foi processado. Caso tenha sido processado com erros ou pendências, refazer e reencaminhar como retificadora, conforme o manual do DPIN. Caso tenha sido processada, então, digitalizar a Política de Investimentos em “pdf” ou arquivo de imagem e encaminhar pelo CADPREV WEB para a Secretaria de Previdência ou também, pode ser encaminhada a Política transformada em PDF sem a assinatura desde que conste no texto que os originais se encontram na RECIPREV;

10. Acessar CADPREV WEB e imprimir a Declaração de Veracidade e coletar as assinaturas. Digitalize em “pdf” e encaminhe o arquivo através do CADPREV WEB;
11. Acesse o site da RECIPREV e publique os seguintes arquivos:
 - DPIN em “pdf”
 - Política de Investimentos que foi digitalizada e encaminhada a Secretaria de Previdência ou também, pode ser encaminhada e transformada em PDF sem assinatura desde que conste no texto que os originais se encontram na RECIPREV;
 - Atas do Comitê de Investimentos e Conselho Municipal de Previdência;
12. Guarde os originais da Política de Investimentos na pasta de arquivos da Gerência de Investimentos bem como a Ata do Comitê de Investimentos e entregue a Ata do Conselho Municipal de Previdência para presidência;
13. Salvar todos os documentos na Pasta Política de Investimentos do respectivo ano;
14. Agendar para no primeiro dia útil do mês de janeiro do ano seguinte para informar os novos dados da Política de Investimentos na planilha de acompanhamento da Carteira de Investimentos.

CAPÍTULO IV

CRENCIAMENTOS, ATUALIZAÇÕES E DESCRENCIAMENTOS

CRENCIAMENTOS, ATUALIZAÇÕES E DESCRENCIAMENTOS - CAPÍTULO IV

CRENCIAMENTOS

No site da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores (AMPASS)-RECIPREV <http://reciprev.recife.pe.gov.br/> constam os Atestados de Credenciamentos das Instituições e os seus fundos de investimentos.

A pasta de Credenciamento constante do arquivo Resumos da Carteira Reciprev - > Credenciar Instituições constam todos os documentos dos credenciamentos, atualizações e descenciamentos.

Os passos são os seguintes:

1. Marcação de visita pelo Gestor; Administrador ou Distribuidor com a Gerência de Investimentos;
2. A Gerência de Investimentos analisa os produtos oferecidos, bem como as condições iniciais do Gestor, Administrador e Distribuidor do fundo e verifica se atende aos requisitos da RECIPREV. Caso negativo, não ocorre o credenciamento. Caso positivo, é informado para que colete os documentos de credenciamento através do site: <http://reciprev.recife.pe.gov.br/>
3. Receba os documentos do Gestor; Administrador e Distribuidor e dos Fundos de Investimentos, juntamente com as planilhas de credenciamentos baixadas do site da RECIPREV. Abra uma pasta com o nome do Gestor, outra com o nome do Administrador e também do Distribuidor. Caso já possua pasta em nome do Gestor, Administrador, Distribuidor não há necessidade de se abrir nova pasta. Os modelos de credenciamento disponibilizados no site possuem versão em word e excel, ficando a critério da instituição;
4. A Pasta de credenciamento é composta das seguintes subpastas:
 - **Pasta do Ano**: Exemplo 1.2019; 2.2019 e dentro desta subpasta abrir 3 subpastas: Documentos; Fundos e Ratings de Gestão. Por sua vez, cada subpasta destas terão outras subpastas, conforme a seguir:

- **Documentos**: Subpasta Financeiro; Subpasta Fiscal; Subpasta Jurídico: Identidade; Subpasta Súmula de Credenciamento; Subpasta Técnicos;
 - **Fundos**: Incluir tantas subpasta com os nomes dos fundos quantos serão credenciados;
 - **Ratings de Gestão**: (Somente para o caso de Gestor). Portanto, não há necessidade no caso de Administrador ou Distribuidor);
5. Colocar cada documento recebido dentro de cada pasta/subpasta;
 6. Na subpasta Súmula de Credenciamento, abra o arquivo em “excel” de credenciamento e verifique todas as abas: Credenciamento, fundos, Termo de Declaração e se estão preenchidos corretos. Na sequência veja os documentos de cada pasta e compare com o checklist constante da aba de Credenciamento e vá informando ao lado de cada linha do checklist as pendências;
 7. Havendo pendências, encaminhar e-mail solicitando os documentos;
 8. Acessar o site da CVM (<http://www.cvm.gov.br/>) -> Central de Sistema, Consulta Fundos e baixar em “pdf” todos os documentos do(s) fundo(s) para credenciamento que foram listados e preenchidos pelo Gestor na aba Fundos. Lembrando que o Questionário Due Diligence II padrão ANBIMA de cada fundo deve ser encaminhado pelo Gestor ou Administrador;
 9. Acessar o site da CVM (<http://www.cvm.gov.br/>) -> Central de Sistema-> Consulta a processo, e efetue todas as consultas a respeito da Instituição. Acessar o site do BACEN para efetuar pesquisas a respeito da(s) instituição (ões). Acesse a Internet e pesquisa dados sobre a instituição(ões);
 10. No arquivo em “excel” de credenciamento providenciar as análises e responder as perguntas constantes dos modelos;
 11. No arquivo em “excel” de credenciamento na aba Credenciamento, após responder as perguntas acima, incluir local, data, nomes, cargos, CPF das pessoas autorizadas a assinar o credenciamento: Equipe de Investimento; Diretor Executivo e Presidente e reconfirmar no Comitê de Investimentos;
 12. Imprima o relatório de credenciamento acima;

13. Incluir os fundos de investimentos credenciados; o gestor; administrador e distribuidor na planilha **Relatórios Diversos**, conforme o caso, e da forma a seguir:
- **Aba Fund.Creden**: Incluir linha(s) e adicionar o(s) fundo(s) e informar todos os dados do fundo constantes da planilha;
 - **Aba Análise Fundos**: Imprimir a análise e coletar assinaturas Equipe de Investimento; Diretor Executivo e Presidente e reconfirmar no Comitê de Investimentos;
 - **Aba Resp.Creden**: Incluir linha e adicionar o Gestor ou Administrador ou Distribuidor e informar todos os dados constantes da planilha;
 - **Aba Inst.Creden**: Incluir linha e adicionar o Gestor ou Administrador ou Distribuidor e informar todos os dados constantes da planilha;
 - **Aba Limites**: Incluir linha e adicionar o Gestor ou Administrador e informar todos os dados constantes da planilha;
 - **Aba Atualiza Dados**:
 - Incluir linha e adicionar o Gestor ou Administrador e informar todos os dados do fundo constantes da planilha;
 - Incluir linha e adicionar o Gestor ou Administrador e informar todos os dados relativos ao controle de credenciamentos;
 - Incluir linha e adicionar o Gestor e informar todos os dados relativos ao controle do rating;
 - Incluir linha e adicionar o rating do fundo (quando necessário).
14. Preencha o Atestado de Credenciamento conforme seja um gestor, administrador ou distribuidor e do(s) fundo(s). Atentar para informar no Atestado os fundos que também estão sendo credenciados. Imprimir para coleta de assinatura da Equipe de Investimento; Diretor Executivo e Presidente e reconfirmar no Comitê de Investimentos;
15. De posse dos seguintes relatórios: Credenciamentos e Atestado de Credenciamento, comece a coleta de assinaturas. Após a conclusão digitalizar todos os documentos;
16. Publicar no site da AMPASS: <http://reciprev.recife.pe.gov.br/>

17. Acesso o DAIR no CADPREV Local e no campo de credenciamento de instituições e fundos, registre o credenciamento da(s) instituição(ões) e do (s) fundo(s)
18. Arquivar os relatórios assinados de Credenciamento e Atestado de Credenciamento na pasta de credenciamento por ordem alfabética;
19. Salvar todos os documentos na pasta de credenciamentos;
20. Levar o resumo do mês de todos os Credenciamentos para o Comitê de Investimentos convalidar.

Desejando, pode ser publicado apenas lista das Instituições credenciadas.

ATUALIZAÇÕES DE CREDENCIAMENTOS

As atualizações de credenciamento dos Gestores ou Administradores ou Distribuidores são realizados após 1 ano de cada credenciamento. No entanto, para facilitar o nosso trabalho e unificar os procedimentos e evitar credenciamentos e atualizações todos os meses do ano, procuramos, quando possível, fixar as atualizações de credenciamento para os meses de outubro, novembro e dezembro de cada ano, mesmo que o credenciamento ainda esteja em vigor.

Para a atualização de credenciamento, a equipe de investimentos divide a quantidade de atualizações a serem feitas nos meses de outubro, novembro e dezembro, e identifica quais os documentos devem ser solicitados para cada um dos Gestores; Administradores e Distribuidores. A planilha de atualização de credenciamento é a mesma utilizada para o credenciamento, não havendo a necessidade da aba de Fundos e do Termo de Declaração. Também, os documentos a serem solicitados para a atualização do credenciamento são menores que os documentos para o credenciamento. Todos os documentos necessários constam do arquivo “excel” de atualização do credenciamento.

Encaminhar e-mail com a planilha de atualização de credenciamentos, para cada um, mantendo o controle na Planilha de Relatórios Diversos.

Fixar a data para entrega dos documentos para evitarmos o volume excessivo de documentos para análise, bem como de ultrapassar a data de vencimento constante no DAIR.

Ao receber os documentos adotar os seguintes procedimentos:

1. Na pasta do Gestor; Administrador ou Distribuidor abra uma **subpasta do ano**: Exemplo 1.Ano; 2.Ano e dentro desta subpasta incluir a subpasta **DOCUMENTOS**, e dentro dela criar as seguintes subpastas: Financeiro; Subpasta Fiscal; Subpasta Jurídico: Identidade; Subpasta Súmula de Credenciamento e Subpasta Técnicos;
2. Colocar cada documento recebido dentro de cada pasta/subpasta, sendo que os documentos de identidades são para ser colocados na primeira subpasta do credenciamento inicial na supasta jurídico – identidades;
3. Na subpasta Súmula de Credenciamento, abra o arquivo em “excel” de credenciamento e verifique se está preenchido correto. Na sequência veja os documentos de cada pasta e compare o checklist constante da aba Credenciamento e vá colocando ao lado de cada linha do checklist as pendências;
4. Havendo pendências, encaminhar e-mail solicitando os documentos;
5. Faça as pesquisas da mesma forma de quando está credenciando;
6. No arquivo em “excel” de credenciamento, após o final do relatório, incluir linhas e providenciar as análises e responder as perguntas constantes do modelo;
7. No arquivo em “excel” de credenciamento, após responder as perguntas acima, incluir local, data, nomes, cargos, CPF das pessoas autorizadas a assinar o credenciamento: Equipe de Investimento; Diretor Executivo e Presidente;
8. Imprima o relatório de atualização do credenciamento;
9. Na planilha Relatórios Diversos, conforme o caso, e conforme a seguir:
 - **Resp.Creden**: colocar as respostas acima e responder as demais perguntas do Gestor ou Administrador ou Distribuidor;
 - **Inst.Creden**: responder as perguntas necessários de Gestor ou Administrador ou Distribuidor constantes da planilha;
10. Preencha o Atestado de Credenciamento conforme seja um gestor, administrador ou distribuidor. Atentar para informar no Atestado os fundos credenciados. Imprimir para coleta de assinatura da Equipe de Investimento; Diretor Executivo e Presidente;

11. De posse dos seguintes relatórios: Credenciamento e Atestado de Credenciamento, comece a coleta de assinaturas. Após a conclusão digitalizar todos em conjunto e isoladamente o Atestado de Credenciamento;
12. Publicar no site da AMPASS <http://reciprev.recife.pe.gov.br/> o Atestado de Credenciamento;
13. Acesso o DAIR no CADPREV Local e no campo de credenciamento de instituições e fundos, registre a atualização do credenciamento da(s) instituição(ões) e do (s) fundo(s)
14. Arquivar os relatórios assinados de Credenciamento e Atestado de Credenciamento na pasta de credenciamento por ordem alfabética;
15. Salvar todos os documentos na pasta de credenciamentos na subpasta instituições.
16. Fazer o resumo das atualizações para convalidar no Comitê de Investimentos.

Desejando, pode ser publicado apenas lista das Instituições credenciadas.

DESCRENCIAMENTOS OU SUSPENSÕES DE CREDENCIAMENTOS

1. Para o caso de ***Descredenciamento ou Suspensão de Credenciamento*** basta emitir o Atestado de Credenciamento informando sobre o Descredenciamento ou Suspensão da Instituição. Imprimir e coletar as assinaturas da Equipe de Investimento; Diretor Executivo e Presidente. Digitalizar em “pdf” e arquivar em conjunto com os demais documentos do gestor ou administrador;
2. Na pasta de credenciamentos - > instituições, recorte toda a pasta da instituição que será descredenciada e coloque na pasta de credenciamentos “encerrados”;
3. No site da AMPASS, exclua totalmente a pasta da instituição;
4. Acesso o CADPREV Local e em credenciamentos vá na instituição e mude o número do termo de credenciamento para CREDENCIAMENTO ENCERRADO – DESCRENCIAMENTO e inabilite a instituição. Na sequência vá para fundos e exclua todos.

5. Informar todos os casos na reunião do Comitê de Investimentos para convalidar.

CAPÍTULO V

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

COMITÊ DE INVESTIMENTOS - CAPÍTULO V

As datas das reuniões do Comitê de Investimentos do ano seguinte são definidas e divulgadas, no anterior, no Site da AMPASS <http://reciprev.recife.pe.gov.br/>.

A equipe da Gerência de investimentos todos os meses efetua as análises dos investimentos para serem encaminhados para deliberações do Comitê de Investimentos ou Conselho Municipal de Previdência. As deliberações são tomadas com base em análises técnicas, e para serem realizadas/cumpridas após a reunião ou no(s) mês(es) seguinte(s) concomitante com as APR. Todas as deliberações são registradas em ata e publicadas as Atas e APR no Site da AMPASS no máximo em até 30 dias, além do registro diário no DAIR (CADPREV local).

As análises constam do arquivo das deliberações mensais, e salvas/guardadas.

PROCESSO DAS DELIBERAÇÕES DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

1. Preparar mensalmente em “excel” as sugestões de deliberações e salvar na subpasta de reuniões do Comitê de Investimentos do respectivo ano e mês;
2. O Gerente de Investimentos, deve encaminhar, com antecedência, por e-mail a planilha contendo as sugestões de deliberações para o Comitê de Investimentos ou Conselho Municipal de Previdência (para compor a pauta), conforme alçadas. No dia da reunião, apresentar as sugestões, e as deliberações serão registradas em ata e na planilha Relatórios Diversos na aba Deliberações;
3. Após devidas deliberações e atualizações mensais da planilha Relatórios Diversos, efetuar uma cópia da mesma e salvar/guardar na pasta das reuniões do Comitê de Investimentos do respectivo mês.
4. Após a cópia da planilha, efetue as alterações no campo “hoje” que corresponde as datas para ficar com a data correta.

Os arquivos das reuniões do Comitê de Investimentos ficam em Resumos
Carteira RECIPREV - > Comitê de Investimentos -> Reuniões do Comitê ->
Ano -> Mês

CAPÍTULO VI

ATIVIDADES DIÁRIAS, MENSAIS E ANUAIS DA GERÊNCIA DE
INVESTIMENTOS

ATIVIDADES DIÁRIAS, MENSAIS E ANUAIS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS - CAPÍTULO VI

ATIVIDADES DIÁRIAS

- Consultar diariamente as contas correntes dos fundos RECIPREV e RECIFIN, junto os bancos que possui conta corrente com movimentações;
- Fazer APR e ofício sempre que houver movimentações nas contas do fundo RECIPREV;
- No caso das contas do fundo RECIFIN, fazemos apenas 2 (duas) APR por mês, sendo uma conta do RECIFIN no BB e outra da conta do RECIFIN no Bradesco;
- Pendências;
- Planilha Relatórios Diversos;
- Planilha de atualização de fundos pelo DI e IBOVESPA;
- Planilha da Carteira de Investimentos;
- Publicação dos documentos no site da AMPASS.

ATIVIDADES MENSAIS

- Deliberações do Comitê de Investimentos ou Conselho Municipal, este apenas no caso de ultrapassar a alçada do Comitê de Investimentos;
- Fechamento da Carteira de Investimentos;
- Fechamento do Relatório Diversos;
- Encaminhamento do DAIR (CADPREV);
- Publicação da Carteira de Investimentos no site da AMPASS e salvar na respectiva pasta;
- Publicação no site da AMPASS das Atas do Comitê de Investimentos ou Conselho Municipal se este deliberar investimentos e salvar na respectiva pasta;
- Publicar o DAIR e Relatório de APR mensal do DAIR no site da AMPASS e salvar na respectiva pasta do DAIR;
- Publicar as Lâminas dos fundos de investimentos no site da AMPASS e salvar na pasta de lâminas;

- Efetuar a Explosão de carteira.

ATIVIDADES ANUAL

- Política de Investimentos até 31/12 de cada ano;
- Encaminhamento do DPIN (CADPREV) – Conforme capítulo da Política de Investimentos;
- Anualmente os arquivos das datas das reuniões do Comitê e dos Conselhos publicar no site da AMPASS e salvar nas pastas respectivas;
- Publicação no site da AMPASS da Política de Investimentos e salvar na pasta de Políticas.

QUANDO OCORRER NECESSIDADE

- CI (Comunicados Internos)

CAPÍTULO VII

CONSULTA DIÁRIA DAS CONTAS CORRENTES – OFÍCIOS – APR -
PENDÊNCIAS

CONSULTA DIÁRIA DAS CONTAS CORRENTES – OFÍCIOS – APR – PENDÊNCIAS – CAPÍTULO VII

PROCEDIMENTOS

Consultar, diariamente, as contas correntes do FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV:

- Banco do Brasil: 7.909-X;
- Caixa Econômica: 4-5;
- Banco Bradesco: 65.000-5

Observação: Todos os valores creditados na conta 7.909-X são aplicados no final da noite, automaticamente, no fundo BB Previdenciário RF Fluxo FIC FI CNPJ: 13.077.415/0001-05, com vistas a não termos nenhum valor do Fundo Previdenciário RECIPREV sem estar aplicado, o mesmo ocorre no Bradesco em que são aplicados no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14.

Havendo as movimentações, providenciar com a data do dia do evento:

1. Fazer Ofício(s) para o respectivo(s) Banco(s) ou Gestor de Investimentos, conforme modelo constante da pasta modelos de ofícios e imprimir;
2. Através do aplicativo QUANTUM imprimir a(s) lâmina(s) do(s) fundo(s) que os recursos foram ou serão aplicados e/ou resgatados;
5. Fazer APR (Autorização de Aplicação e Resgate), conforme modelo constante do arquivo **Relatórios Diversos, Aba Mod Apr**. Imprimir, assinar, digitalizar e guardar o original da APR na pasta do ano, e a versão digitalizada salvar na Pasta APR. Depois, acessar o aplicativo CADPREV local, e no DAIR, registrar a mesma APR com todos os dados solicitados, os quais já irão constar do modelo da aba **Mod Apr**. Publicar no site da RECIPREV as APR. Caso haja necessidade de Atestado de Compatibilidade, efetuar o preenchimento e coletar as assinaturas do Gerente de Investimento, Chefe de Divisão de Investimentos, Diretor Executivo e Presidente da RECIPREV. Fazer Atestado de Compatibilidade, **caso tenha prazo de carência superior a 60 dias**, conforme modelo constante da pasta modelo de Atestado;

6. Colher assinatura do Gerente de Investimentos e de outro ordenador de despesas no ofício e na APR modelo excel as assinaturas são do Gerente de Investimentos e do Chefe de Divisão de Investimentos. No modelo do CAPREV não precisa coletar as assinaturas nas APR;
 7. Encaminhar o ofício(s) para o Banco(s) ou para o Gestor/Administrador/Distribuidor. Caso esteja localizado em outro Estado, fazer via e-mail e registrar em caneta que o mesmo foi encaminhado na data “tal” por e-mail. O(s) e-mail(s) de encaminhamento são para e-mails constantes do Credenciamento;
 8. Aguardar o retorno do ofício(s) protocolado ou a confirmação do recebimento do e-mail;
 9. Digitalizar o conjunto formado por: Ofício(s), APR, Atestado(s) de Compatibilidade (caso tenha sido necessário) e lâmina(s);
 10. Salvar cópia do arquivo digitalizado em PDF nas seguintes Pastas:
 - Resumos da Carteira RECIPREV -> Apr e Atestados -> Ano - Digitalizados APR e Atestados;
 - Resumos da Carteira RECIPREV -> Site da RECIPREV -> Apr
- Atenção: Lembrar de encaminhar a APR para o Site da RECIPREV.**
11. Guardar o conjunto formado por: Ofício(s), APR, Atestado(s) de Compatibilidade (caso tenha sido necessário) e lâmina(s) na Pasta de Arquivo Físico de Ofícios e APR do respectivo ano;
 12. Providenciar os seguintes registros logo após a confecção da APR:
 - Planilha Relatórios Diversos nas seguintes abas: **Pg e Rc** (caso seja necessário); **Apr do ano**. Atenção: verificar se constava da aba **Deliberações**;
 - Planilha da Carteira de Investimentos no respectivo fundo;
 - Registro no aplicativo QUANTUM no respectivo fundo;
 - Planilha de Atualizações de Fundos pelo DI e IBOVESPA, caso seja necessário.
 - CADPREV – DAIR.

Obs: Atualização de Fundos pelo DI e IBOVESPA. Nem todo fundo consta da planilha de atualização de fundos pelo DI e IBOVESPA, somente aqueles que são necessários fazermos o comparativo da rentabilidade com o DI ou

IBOVESPA. Caso conste, providenciar a anotação. Caso não conste o fundo e seja necessário, providenciar o registro do mesmo.

PENDÊNCIAS

A pasta de pendências serve para registrar as pendências relativas a Gerência de Investimentos.

CAPÍTULO VIII

PLANILHA RELATÓRIOS DIVERSOS

PLANILHA RELATÓRIOS DIVERSOS – CAPÍTULO VIII




















PROCEDIMENTOS

Para acessar a planilha Relatórios Diversos -> Resumos Carteira Reciprev -
> Cálculos Diários -> Ano -> Relatórios Diversos.

A planilha é feita em “excel” e é composta das seguintes “**abas**”:

- **Atualiza Dados**
- **Ext Apr Ano**
- **Mod Apr**
- **Pg e Rc**
- **Deliberações**
- **Saldos**
- **Graf.Saldos**
- **Análises Atuariais Reciprev**
- **Site**
- **Riscos**
- **NTN-B 2045**
- **E.Ret**
- **E.Dif.Ret**
- **E.Cál**
- **E.Rel**
- **Limites**
- **Anbima Gest**
- **Anbima Admin**
- **Rankign Global Adm RPPS**
- **Comitê Risco e Auditoria**
- **Inst.Creden**
- **Resp.Creden**
- **Fund.Creden**
- **Análise Fundos**
- **Escala Ratings**

1. **Atualiza Dados:** É composta da entrada de vários dados para serem atualizados sempre que os novos dados estiverem disponíveis. É composto dos links conforme figura a seguir:

| SEMPRE QUE HOUVER OCORRÊNCIA | | | | | |
|---|---|---|--|---|---|
| CONTROLE DE CREDENCIAMENTO | RATINGS GESTOR | RATING DOS FUNDOS | RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECEPRF | Extração de APR | Modelo APR |
|  |  |  |  |  |  |
| MENSAL | | | | | |
| POLÍTICA DE INVESTIMENTOS | RESUMO DAS APLICAÇÕES POR SETOR | CARTEIRA DE INVESTIMENTOS | RENTABILIDADE MENSAL DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS | COMITÊ DE RISCO E AUDITORIA | SALDOS E RENTABILIDADES RECEPRF |
|  |  |  |  |  |  |
| INDICADORES PARA PARECER DA CARTEIRA | SALDOS E RENTABILIDADES RECEPRF | RANKING ANBIMA DE GESTOR | RANKING ANBIMA DE ADMINISTRADOR | RANKING ANBIMA DE ADMINISTRADOR GLOBAL | DELIBERAÇÕES |
|  |  |  |  |  |  |
| | | | | |  |

Ao clicar em cima da cor, o sistema encaminha diretamente para o tipo de atividade a ser feita.

2. **Ext Apr Ano:** Toda vez que for fazer uma APR é preciso registrar os dados conforme solicitado na linha de registro.
3. **Mod Apr:** Trata-se do modelo para fazer a APR. Basta completar as linhas com cor diferente. Ela é gerada automaticamente.
4. **Pg e Rc:** Registrar as entradas e saídas, tais como: Contribuições, recebimentos de fundos específicos, pagamentos de folha, tarifas e demais taxas conforme o modelo. O registro deve ser feito diariamente, e no campo específico do evento. Automaticamente, o sistema acumula o valor de forma anual. Também, consta o registro dos contratos de prestação de serviços da Gerência de Investimentos.
5. **Deliberações:** Trata-se das decisões tomadas no Comitê de Investimentos, com todos os registros necessários. **A planilha Relatórios Diversos deve ser copiada todo mês e salva na Pasta das reuniões do Comitê de Investimentos do respectivo mês, tendo em vista que a aba Deliberações todo mês é zerada para as próximas reuniões.** As decisões tomadas no Comitê de Investimentos são registradas conforme a data da reunião. Basta preencher os campos que estão na cor amarela da planilha. Os membros do Comitê de Investimentos recebem uma planilha em “excel” com as sugestões das deliberações com antecedência necessária.

6. **Saldos**: Preencher uma vez por mês apenas os campos: Saldo; rendimentos; IPCA+6%; CDI; IMA-B. Com isto a planilha faz todos os cálculos necessários.
7. **Graf.Saldos**: Consta os gráficos de acompanhamento desde 2013 até a data atual. Porém, deve-se atualizar os dados apenas dos gráficos do ano em curso e do gráfico acumulado. Para tanto, todo mês acrescentar mais o mês em curso nos gráficos.
8. **Análises Atuariais Reciprev**: Consta os dados dos Cálculos Atuariais realizados pela empresa de Atuária.
9. **Site**: Trata-se da segunda parte do relatório da Carteira de Investimentos que em conjunto com a primeira parte que é realizado através do arquivo da Carteira de Investimentos, formamos o relatório total da Carteira de Investimentos para ser divulgado no Site da AMPASS. Os únicos procedimentos a serem feitos são: incluir mais o mês em curso nos três gráficos, igualmente como é feito na aba Graf.Saldos e ao final do relatório, informar a data da conclusão do relatório. Feito isto, conferir se todos os demais dados estão corretos. Imprimir em PDF e juntar com a primeira parte do relatório da Carteira de Investimentos e com isto, formar um único relatório através da unificação dos dois pdfs.
10. **Riscos**: Relatório de Riscos Mensais da Carteira de Investimento. O relatório está automatizado, no entanto, é preciso, todos os meses, verificar e adotar os procedimentos que se façam necessários. Após isto, apresentar o parecer, imprimir em PDF, coletar as assinaturas da equipe da Gerência de Investimentos e encaminhar ao Comitê de Riscos após o fechamento mensal da Carteira de Investimentos.
11. **NTN-B 2045**: Constam os preços das NTN-B 2045, pelo valor de mercado, pela curva de juros e por IPCA+6% ao ano com o respectivo gráfico de comportamento;
12. **E.Ret**: Trata-se da planilha inicial para compor os dados estatísticos do(s) fundo(s) que iremos adquirir, bem como de todos os fundos já adquiridos e constantes da carteira de investimentos RECIPREV. Deve ser atualizada uma vez por mês, quando do fechamento da carteira, ou quando da

inclusão de novos fundos para análise. Para incluir ou excluir um novo fundo, basta adicionar ou deletar coluna.

13. **E.Dif.Ret:** Trata-se da planilha que realiza os cálculos entre o retorno mensal do fundo e o seu benchmark.
14. **E.Cál:** Trata-se da realização de todos os cálculos estatísticos dos fundos de investimentos aplicados e da carteira de investimentos, tendo como base as abas **E.Ret e E.Dif.Ret** além dos próprios cálculos efetuados na própria **E.Cál**. Esta aba requer muita atenção com relação as vinculações e cálculos, em especial, quando da inclusão ou exclusão de fundos, de modo a não ocasionar a perda de vinculação ou vinculação incorreta. A atualizada desta planilha é automática, exceto quando da inclusão ou exclusão de fundo em que deveremos fazer os devidos ajustes.
15. **E.Rel:** Trata-se do resumo por fundo de todos os dados estatísticos coletados na **E.Ret; Dif.Ret e E.Cál**. A atualizada desta planilha é automática, exceto quando da inclusão ou exclusão de fundo em que deveremos fazer os devidos ajustes.
16. **Limites:** Trata-se da planilha que estabelece o máximo que podemos aplicar com um Gestor ou Administrador de Investimentos com base nos limites máximos da Resolução CMN 3.922/2010.
17. **Anbima Gest:** Trata-se do ranking Anbima de Gestores. O ranking é divulgado sempre no 14º dia útil do mês, através do site: http://www.anbima.com.br/pt_br/informar/ferramenta/app-anbima.htm. Portanto, todos os meses, fazer o download do arquivo e salvar na pasta Resumos Carteira Reciprev -> 3.Cálculos do Máximo Aplicação por Gestor e Classificação de Instituições -> C - Ranking Gestor e Administrador -> Ranking de Gestores -> Ano. Após o salvar o arquivo, abra o mesmo e copie e cole para a aba **Anbima Gest**. A atualização desta planilha é feita somente uma vez por mês.
18. **Anbima Admin:** Trata-se do ranking Anbima de Administradores. O ranking é divulgado sempre no 14º dia útil do mês, através do site: http://www.anbima.com.br/pt_br/informar/ferramenta/app-anbima.htm. Portanto, todos os meses, fazer o download do arquivo e salvar na pasta Resumos Carteira Reciprev -> 3.Cálculos do Máximo Aplicação por Gestor

e Classificação de Instituições -> C - Ranking Gestor e Administrador -> Ranking de Adm -> Ano. Após o salvar o arquivo, abra o mesmo e copie e cole para a aba **Anbima Admin**. A atualização desta planilha é feita somente uma vez por mês.

19. **Rankign Global Adm RPPS**: Trata-se do ranking Global Anbima de Administradores. O ranking é divulgado sempre no 14º dia útil do mês, através do site: http://www.anbima.com.br/pt_br/informar/ferramenta/app-anbima.htm. Portanto, todos os meses, fazer o download do arquivo e salvar na pasta Resumos Carteira Reciprev -> 3.Cálculos do Máximo Aplicação por Gestor e Classificação de Instituições -> C - Ranking Gestor e Administrador -> Ranking de Admin Global -> Ano. Após o salvar o arquivo, abra o mesmo e copie e cole para a aba **Ranking Global Admin RPPS**. A atualização desta planilha é feita somente uma vez por mês.
20. **Inst.Creden**: Trata-se da planilha que contém os dados necessários para o registro e controle de credenciamento e atualização dos Gestores, Administradores e Distribuidores. Também, consta todos os custodiantes. Deste modo, está planilha deve ser atualizada: quando das atualizações do credenciamento ou quando da inclusão (novo credenciamento), exclusão ou alteração de dados do Gestor, Administrador, Distribuidor ou Custodiante. Esta planilha alimenta a aba **Cont.Creden**.
21. **Comitê Risco e Auditoria**: Trata-se do ranking divulgado pela SPREV dos gestores e administradores que possuem comitê de risco e auditoria obrigados pelo BACEN.
22. **Resp.Creden**: Trata-se do banco de dados de informações para o credenciamento dos Gestores/Administradores e Distribuidores.
23. **Fund.Creden**: Trata-se do banco de dados dos fundos credenciados. Esta aba deve ser atualizada sempre quando das atualizações dos credenciamentos ou a qualquer momento, sempre que houver alterações nos fundos de investimentos, novos credenciamentos ou o descredenciamento de fundos. Os dados são coletados das planilhas de credenciamentos.
24. **Análise Fundos**: Relatório de credenciamento de fundo com todos os dados necessários;

25. **Escala Ratings:** Trata-se da aba que consta o resumo dos tipos de ratings de Qualidade de Gestão por agência classificadora de risco e ratings para fundos que necessitam de rating.

26. **A inclusão ou exclusão de Gestor, Administrador, Distribuidor e Fundos de investimentos requer MUITA ATENÇÃO**, tendo em vista a necessidade constar em diversas abas da planilha **Relatórios Diversos**.

PLANILHA RELATÓRIOS DIVERSOS – INCLUSÃO E EXCLUSÃO DE FUNDOS

1. Verifique se o Gestor, Administrador, Distribuidor, Custodiante constam da aba **Inst.Creden**. Caso não conste, é preciso primeiramente credenciar o Gestor, Administrador, Distribuidor, Custodiante (conforme o caso). Caso conste vá para o passo seguinte;
2. Verificar se o fundo consta na aba **Fund.Creden**. Caso não conste, é preciso primeiramente credenciar o fundo. Caso conste vá para o passo seguinte;
3. Verifique se Gestor e/ou Administrador constam da aba **Limites**. Caso não conste, é preciso, primeiramente fazer **as vinculações devidas na planilha**. Caso conste vá para o passo seguinte;
4. Verifique se o fundo consta na aba **E.Ret**. Caso não conste, **efetue a inclusão e informar todas as rentabilidades desde o início do fundo**, tendo como base a partir do início do fundo e máximo janeiro de 2011. As rentabilidades podem ser coletadas do QUANTUM, ou CVM, ou das lâminas do fundo fornecida pelo Gestor/Administrador ou através de ambiente de pesquisa na internet;
5. Verifique se o fundo consta na aba **E.Dif.Ret**. Caso não conste, **efetue a inclusão e faça as devidas vinculações, ou seja**, cada linha da coluna deste novo fundo deverá ser igual a diferença entre a rentabilidade do fundo e o seu benchmark que constam na aba **E.Ret**. Caso conste vá para o passo seguinte;
6. Verifique se o fundo consta na **aba E.Cál**. Caso não conste, **efetue a inclusão do mesmo e faça todas as vinculações necessárias, tendo**

- como base o que está sendo feito com os demais fundos.** Caso conste vá para o passo seguinte;
7. Verifique se o fundo consta na aba **E.Rel.** Caso não conste, **efetue a inclusão do mesmo e faça todas as vinculações necessárias, tendo como base o que está sendo feito com os demais fundos.** Caso conste vá para o passo seguinte;
 8. Verifique se o Gestor e Administrador constam na aba **Cont.Creden.** Caso não conste, faça a vinculação com a aba **Inst.Creden.** Caso conste vá para o passo seguinte;
 9. Verifique se o fundo precisa constar da aba **Pg e Rc do mês e do resumo anual** no campo **Recebimentos/Rendimentos/Amortizações específicas.** Caso seja necessário, incluir a linha para constar o nome do fundo e fazer a vinculação devida. Caso não seja necessário, não efetuar nenhuma inclusão. Caso conste vá para o passo seguinte;
 10. Verifique se o fundo precisa constar da aba **Site** no campo **Recebimentos/Rendimentos/Amortizações específicas.** Caso seja necessário, incluir a linha para constar o nome do fundo. Caso não seja necessário, não efetuar nenhuma inclusão. Na sequência, verifique se o fundo consta no campo **Estatística da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPIREV.** Caso não conste, incluir a linha e fazer a vinculação para constar na referida estatística do Site. Caso conste vá para o passo seguinte;
 11. Verifique se o fundo aparece na aba **Deliberações** no campo **Fundo.** **Caso não conste, basta alterar a vinculação.** Caso conste vá para o passo seguinte;
 12. Verifique se o fundo aparece na aba **Apr Ano** no campo **Fundo.** **Caso não conste, basta alterar a vinculação.** Caso conste vá para o passo seguinte;
 13. Verifique se o Gestor consta na aba **Atualiza Dados** no campo **Gestor de Investimento.** Caso não conste, efetuar a inclusão com os dados do rating de Qualidade de Gestão. Caso conste vá para o passo seguinte;
 14. Verifique se o fundo consta na aba **Atualiza Dados** no campo **Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios (caso trata-se de um FIDC).** Caso não conste, efetuar a inclusão com os dados do rating do FIDC.

OBSERVAÇÃO: Para o caso de exclusão de fundos adotar os procedimentos acima, porém, excluindo colunas e linhas.

CAPÍTULO IX

PLANILHA ATUALIZAÇÃO DE FUNDOS PELO DI E IBOVESPA

PLANILHA ATUALIZAÇÃO DE FUNDOS PELO DI E IBOVESPA – CAPÍTULO IX

PROCEDIMENTOS

A planilha de atualização de fundos pelo DI e IBOVESPA possui as seguintes "Abas" de trabalho:

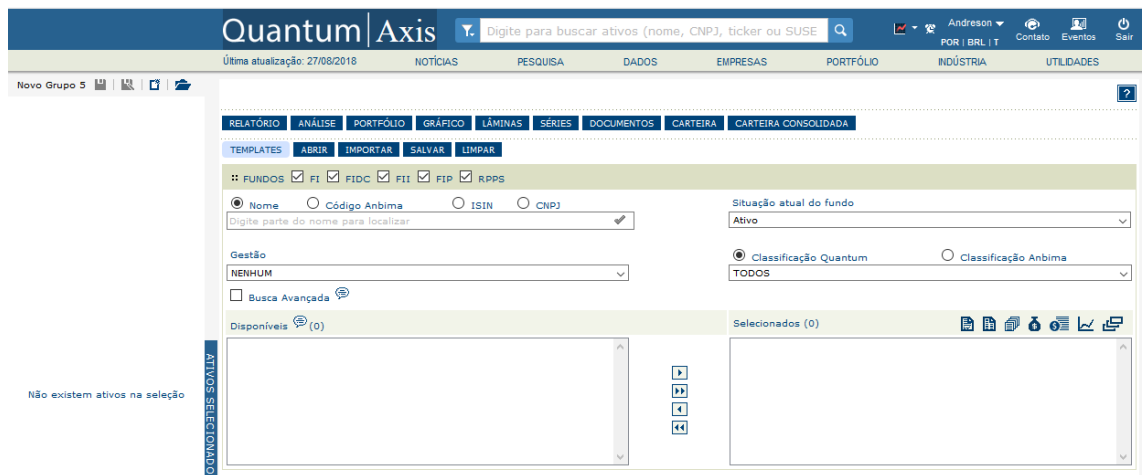
- **Fund.Creden**
- **QuantumCota**
- **QuantumPL**
- **Copiar Dados**
- **Di-Cotas**
- **Cálculo RV**
- **Cálculo RF**
- **Rel. Classificação**

O primeiro procedimento da Planilha de atualização de fundos pelo DI e IBOVESPA é definir se o fundo deve constar ou não na planilha DI e IBOVESPA. Nem todos fundos realiza-se o comparativo com o DI e IBOVESPA, em decorrência de diversas razões.

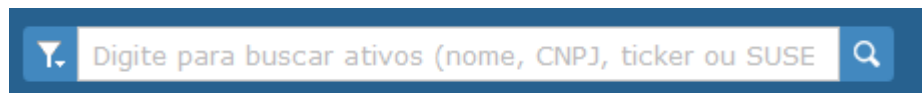
O ponto de partida de toda a planilha, começa a partir da aba Fund.Creden. A partir daí parte-se para as abas Copiar Dados e DI Cotas, e finalmente, para as abas Cálculo RV ou RF e na sequência para Rel. Classificação.

Procedimentos:

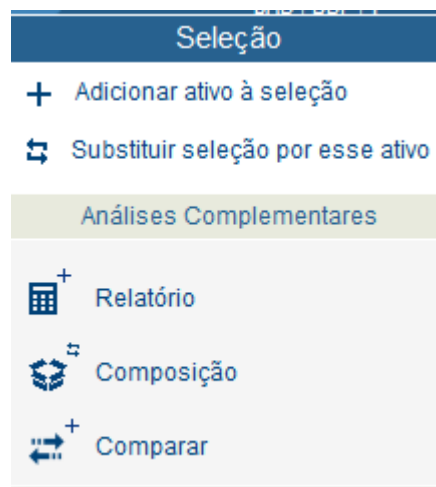
1. **Fund Credenciados**: Pelo menos uma vez por mês copiar da planilha Relatórios Diversos, aba **Fund.Creden** e salvar na aba **Fund.Creden** da planilha de atualização de fundos pelo DI e IBOVESPA;
2. **Entrada Quantum Axis**: Diariamente, capturar os dados dos fundos já selecionados para atualização dos fundos pelo DI e IBOVESPA do Quantum e salvar os dados na respectiva aba;
 - Acessar o aplicativo Quantum no site: <https://www.quantumaxis.com.br/webaxis>
 - Inserir o login e a senha e o Quantum ira abrir com a seguinte janela:



- Para acessar a pasta **Carteira Reciprev** no Quantum deve-se digitar o nome da pasta no ícone de pesquisa:



- Após digitar o nome da pasta clicar Enter e selecionar “Adicionar ativo à seleção” na janela que se abrirá.



- Com os ativos selecionados clicar em “Séries” na barra de menus:



- A janela que abrirá deverá ser configurada de acordo com a figura abaixo. Clique em “cota/preço de fechamento” no quadro da esquerda e através da

seta, adicione a seleção no quadro da direita. Marque o campo “Por datas” e o Período “Por mês” com periodicidade “Diária”.

Campos disponíveis (126)

Campos selecionados (1)

Cota/Preço de Fechamento

Forma de Visualização | Deflatores | Preços/Quantidades | Fonte

Exibir datas sem negociação Definir casas decimais

Por ativos Por datas

| Nome do Ativo | Data | Campo 1 | Campo N |
|---------------|--------|---------|----------|
| Ativo 1 | Data 1 | 535,03 | 123,45 |
| Ativo 1 | Data 2 | 537,93 | 12,34 |
| Ativo 2 | Data 1 | 678,90 | 4.647,08 |
| Ativo 2 | Data 2 | 56,78 | 78,93 |

| Data | Ativo 1 | | Ativo 2 | |
|--------|---------|---------|---------|----------|
| | Campo 1 | Campo N | Campo 1 | Campo N |
| Data 1 | 535,03 | 123,45 | 678,90 | 4.647,08 |
| Data 2 | 263,93 | 12,34 | 56,78 | 78,93 |

Período

no mês

Periodicidade Diária Semanal Mensal

- Após configurar a janela clique em “Consultar”:



- Na janela que abrirá clicar no ícone do meio na figura abaixo para exportar os dados para o excel:



- Copiar todos os dados da planilha exportada para a **planilha Atualização de Fundos pelo DI e IBOVESPA** e colar os dados na aba **Quantum Cotas**

Obs.1: Os fundos que não constam no Quantum são obtidos através de e-mail.

Obs.2: Repetir o mesmo procedimento a partir da janela que se abrirá ao clicar em “Séries” para selecionar o “Patrimônio Líquido” que deverá ser colado na aba **Quantum PL**.

3. **Copiar Dados:** O objetivo desta aba é transpor as informações das abas **Quantum Cotas** e **Quantum PL** para as configurações da aba Di-Cotas.

Após a transposição automática dos dados selecionar as cotas referentes ao dia, copiando e colando na aba DI-Cotas. Portanto, esta aba é somente com os dados do mês em curso.

Observação:

Caso deseje incluir ou excluir um fundo na aba Copiar Dados, proceder conforme a seguir:

▪ **Incluir um Fundo:**

Inserir 2 colunas para o fundo e capturar os dados do fundo através da aba **Fund.Creden**, porém, antes, colocar o código Anbima/Quantum do fundo.

ATENÇÃO: Seguir posicionamento dos fundos da aba DI-Cotas.

▪ **Excluir um Fundo:**

Excluir as colunas referente ao fundo.

4. Aba DI-Cotas: Trata-se das cotas do DI de todos os períodos.

O objetivo desta aba é transpor as informações das abas **Caso deseje incluir ou excluir um fundo na aba DI-Cotas, proceder conforme a seguir:**

▪ **Incluir um Fundo:**

Inserir 2 colunas para o fundo e capturar os dados do fundo através da aba **Copiar Dados**.

▪ **Excluir um Fundo:**

Excluir as colunas referente ao fundo.

▪ **Abas Cálculo RV (Renda Variável) e RF (Renda Fixa):** Trata-se de fundos de Renda Variável e Renda Fixa que efetuamos os cálculos comparativo ao DI e IBOVESPA.

Caso deseje incluir ou excluir um fundo na aba Cálculo RV (Renda Variável) e RF (Renda Fixa), proceder conforme a seguir:

▪ **Incluir um Fundo:**

Copiar o quadro de um Fundo já existente e colar em linhas e colunas vazias no final da planilha. Após cópia do quadro, copiar os dados do fundo através de vinculação com a **aba Fund.Creden e demais abas**, e completar os demais dados, verificando como é feito cada caso.

ATENÇÃO:

Fazer os **ajustes em todas as fórmulas** do quadro criado para o novo fundo. Para tanto, verificar as fórmulas do quadro que efetuou a cópia. Ex.: Variação percentual cota versus cota ($=F9/E9-1$).

- **Excluir um Fundo:**

Basta excluir da **as linhas do fundo**. Depois de excluído, recomendamos verificar se não afetou algum cálculo de outro fundo.

- **Aba Rel. Classificação:** Esta aba é o resumo total dos fundos que constam nas abas **Cálculo RV e Cálculo RF**. Serve de checagem dos dados, inclusive para análise de forma resumida dos comparativos dos DIs e/ou IBOVESPA.

CAPÍTULO X

PLANILHA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

PLANILHA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – CAPÍTULO X

PROCEDIMENTOS

A atualização da Carteira de Investimentos compreende as seguintes fases:

- Fund. Creden;
- Inclusão de Fundos;
- Exclusão de Fundos;
- Atualização Diária;
- Fechamento Mensal da Carteira;
- Abertura de nova carteira mensal.

Mensalmente, ou sempre que necessário, atualizar a aba Fund.Creden, através do banco de dados de fundos da planilha Relatórios Diversos.

1. Inserir Fundo na aba Apoio:

Caso deseje incluir ou excluir um fundo na aba Apoio, proceder conforme a seguir:

Incluir um Fundo:

Inserir 1 coluna e vincular a célula com o nome do Fundo constante da aba **Fund.Creden**.

ATENÇÃO: Seguir numeração das colunas e ajustar as fórmulas, datas e copiar os dados do último dia da carteira anterior e colar na carteira atual. Promover as vinculações com as outras abas da carteira Operação realizada com frequência para abertura de nova Carteira.

Excluir um Fundo:

Excluir colunas referentes ao fundo e ajustar as formulas da planilha.

2. Inserir Fundo na aba Consolidados:

Caso deseje incluir ou excluir um fundo na aba Consolidados, proceder conforme a seguir:

Incluir um Fundo:

Inserir 1 coluna e vincular a célula com o nome do Fundo constante da aba **Fund.Creden**.

ATENÇÃO: Seguir numeração das colunas e ajustar as fórmulas, ajustando as datas e dias da semana. Promover as vinculações com as outras abas da carteira. Operação realizada com frequência para abertura de nova Carteira.

Excluir um Fundo:

Excluir colunas referentes ao fundo e ajustar as formulas da planilha.

3. Inserir Fundo na aba Inserir Rent MSD Acumulada:

Caso deseje incluir ou excluir um fundo na aba Rent MSD Acumulada, proceder conforme a seguir:

Incluir um Fundo:

Inserir 1 linha e renomear a célula com o nome do Fundo e CNPJ.

ATENÇÃO: Copiar a rentabilidade final da carteira anterior e colar na coluna de rentabilidade inicial. Sempre se atentando a ordem dos fundos e ajustar as fórmulas. Promover as vinculações com as outras abas da carteira. Operação realizada com frequência para abertura de nova Carteira.

Excluir um Fundo:

Excluir Linhas referentes ao fundo e ajustar as formulas da planilha.

4. Criar aba do Fundo:

Caso deseje incluir ou excluir um fundo, proceder conforme a seguir:

Incluir um Fundo:

Copiar uma planilha de um Fundo já existente e colar em uma nova aba e vincular a célula com o nome do Fundo constante da aba **Fund.Creden**.

ATENÇÃO: Fazer os **ajustes em todas as fórmulas** da planilha criada para o novo fundo. Para tanto, verificar as fórmulas da planilha que efetuou a cópia.

Excluir um Fundo:

Basta excluir a aba do fundo.

5. Inserir Fundo na aba Resumo e aba Contabilidade:

Caso deseje incluir ou excluir um fundo nas abas Resumo e Contabilidade, proceder conforme a seguir:

Incluir um Fundo:

Inserir 1 linha e renomear a célula com o nome do Fundo e CNPJ e fazer as vinculações.

ATENÇÃO: Sempre ajustar as fórmulas da aba Resumo e Contabilidade, atentando as datas, saldos e rentabilidades dos fundos. Promover as vinculações com as outras abas da carteira. Operação realizada com frequência para abertura e fechamento de nova Carteira.

Excluir um Fundo:

Excluir Linhas referentes ao fundo e ajustar as formulas da planilha.

6. Inserir Fundo na aba Quadro Demonstrativo:

Caso deseje incluir ou excluir um fundo na aba Quadro Demonstrativo, proceder conforme a seguir:

Incluir um Fundo:

Inserir 1 linha e renomear a célula com o nome do Fundo conforme a aba **Fund.Creden** e Ajustar quadro de renda fixa e variável.

ATENÇÃO: Sempre ajustar as fórmulas e promover as vinculações com as outras abas da carteira. Operação realizada com frequência para abertura e fechamento de nova Carteira.

Excluir um Fundo:

Excluir Linhas referentes ao fundo e ajustar as formulas da planilha.

Ajustar planilhas Gestor, Administrador.

ATENÇÃO: Sempre ajustar as fórmulas. Operação realizada com frequência para abertura e fechamento de nova Carteira.

Ajustar Renda Fixa-Gestor, Renda Fixa-Administrador.

ATENÇÃO: Sempre ajustar as fórmulas. Operação realizada com frequência para abertura e fechamento de nova Carteira.

Ajustar Renda Variável-Gestor, Renda Variável-Administrador;

ATENÇÃO: Sempre ajustar as fórmulas. Operação realizada com frequência para abertura e fechamento de nova Carteira.

Ajustar planilha Prazos de Liquidação da Carteira.

ATENÇÃO: Sempre ajustar as fórmulas. Operação realizada com frequência para abertura e fechamento de nova Carteira.

7. Inserir e ajustar o Fundo na aba Política de Investimentos

Caso deseje incluir ou excluir um fundo na aba Política de Investimentos proceder conforme a seguir:

Incluir um Fundo:

Inserir 1 linha e renomear a célula com o nome do Fundo no seguimento ao qual ele pertence;

ATENÇÃO: Sempre ajustar as fórmulas e promover as vinculações com as outras abas da carteira. Operação realizada com frequência para inclusão de novo Fundo.

Excluir um Fundo:

Excluir Linha referente ao fundo e ajustar as formulas da planilha.

8. Ajustar a aba Site

ATENÇÃO: Sempre ajustar as fórmulas e promover as vinculações com as outras abas da carteira. Operação realizada com frequência.

Excluir Fundos:

- a) Excluir Fundo na aba Entrada de Dados, na aba Apoio, na aba Consolidados e na aba Inserir Rent MSD Acumulada;
- b) Excluir aba do Fundo;
- c) Excluir Fundo na aba Resumo e aba Contabilidade;
- d) Excluir Fundo na aba Quadro Demonstrativo:

- Ajustar planilha de renda fixa e variável;
 - Ajustar planilhas Gestor, Administrador, Renda Fixa-Gestor, Renda Fixa-Administrador, Renda Variável-Gestor, Renda Variável-Administrador.
 - Ajustar planilha Prazos de Liquidação da Carteira.
- e) Excluir e ajustar o Fundo na aba Política de Investimentos;
- f) Ajustar a aba Portal e Trimestral.

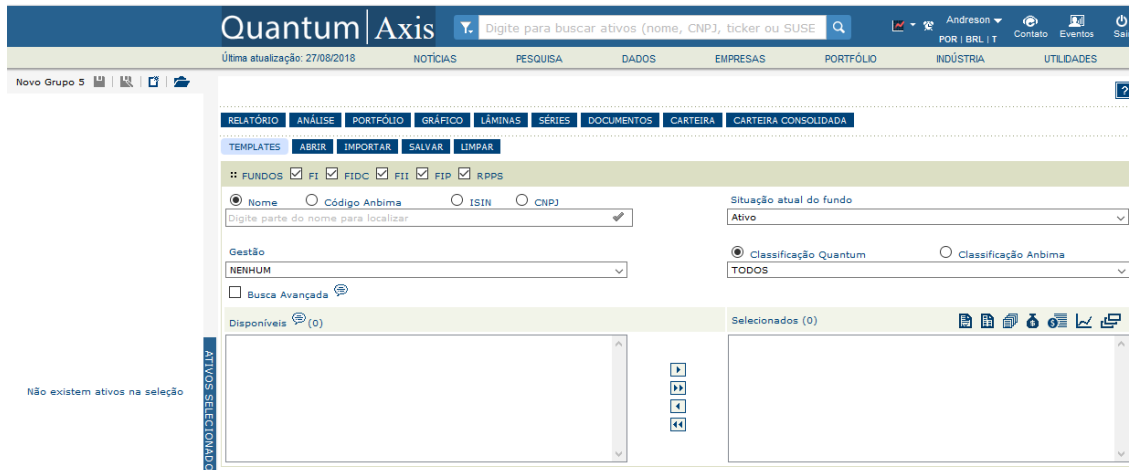
9. Atualização Diária da Carteira

Diariamente, efetuar a atualização da planilha: Atualização da Carteira de Investimentos.

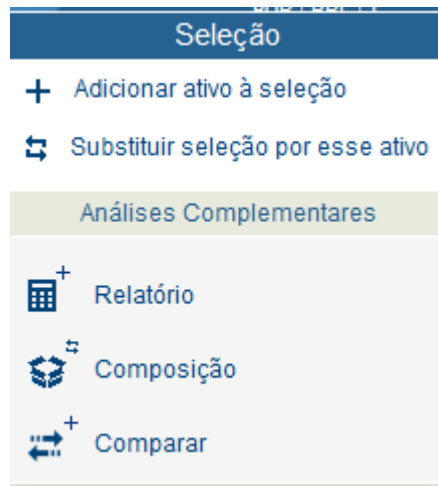
Para tanto:

- Acessar o aplicativo Quantum no site:
<https://www.quantumaxis.com.br/webaxis/>

- a) Inserir o login e a senha
- b) Digitar o nome **Carteira Reciprev** no campo de pesquisa na janela que abrirá e teclar enter:



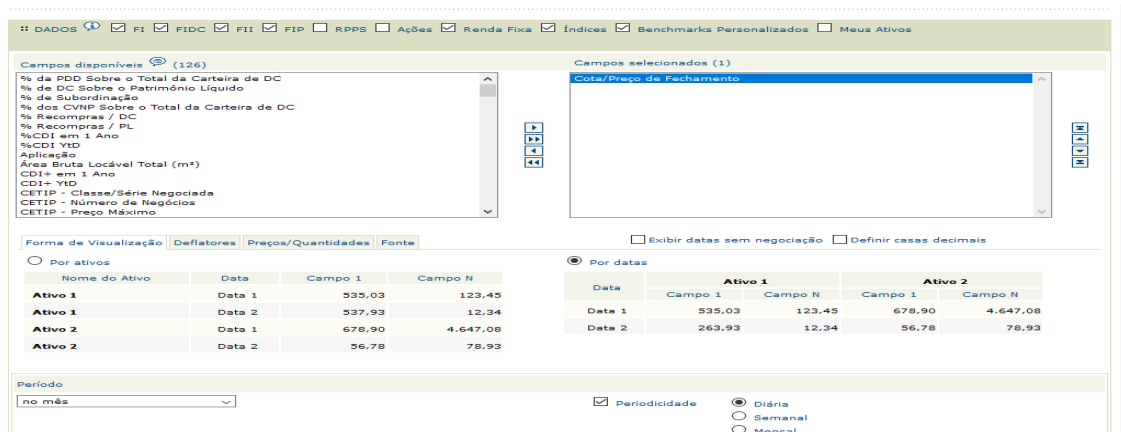
- c) Selecionar “Adicionar ativo à seleção” na janela que se abrirá.



d) Com os ativos selecionados clicar em “Séries” na barra de menus:



e) A janela que abrirá deverá ser configurada de acordo com a figura abaixo. Clique em “cota/preço de fechamento” no quadro da esquerda e através da seta, adicione a seleção no quadro da direita. Marque o campo “Por datas” e o Período “Por mês” com periodicidade “Diária”.



f) Após configurar a janela clique em “Consultar”:



g) Na janela que abrirá clicar no ícone do meio na figura abaixo para exportar os dados para o excel:

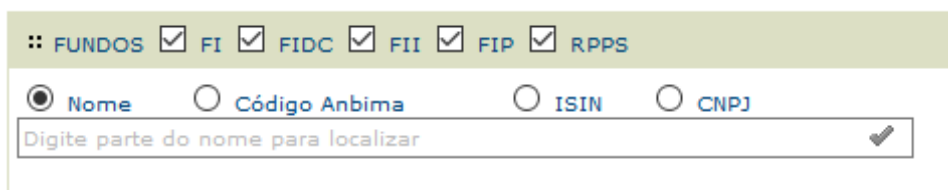


h) Copiar todos os dados da planilha exportada para a **planilha referente ao mês atual e colar os dados na aba Quantum Cotas.**

Obs.1: Os fundos que não constam no Quantum são obtidos através de e-mail.

Obs.2: Repetir o mesmo procedimento a partir da janela que se abrirá ao clicar em “Séries” para selecionar o “Patrimônio Líquido” que deverá ser colado na aba **Quantum PL.**

Observação: Para incluir um fundo em Carteira Reciprev no Quantum basta digitar o nome/código/CNPJ do fundo no campo indicado na figura abaixo e adicionar a seleção com a seta para direita.



Em seguida clicar em salvar:



Para excluir um fundo basta clicar no “x” ao lado de seu nome na caixa de seleção à esquerda e salvar:

| CARTEIRA R... | |
|--------------------------|---|
| — Fundos (57) | X |
| ÁTICO FLORESTAL MULT... | X |
| AZ LEGAN BRASIL FI AÇ... | X |
| AZ QUEST SMALL MID C... | X |
| AZ QUEST VALORE FI RE... | X |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC... | X |
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕE... | X |
| BB FLUXO FIC RENDA FI... | X |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕ... | X |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚB... | X |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBL... | X |

10. Fechamento Mensal da Carteira:

- Solicitar no **2º Dia útil** de cada mês os extratos fundos/títulos, conforme a lista de e-mails de solicitação de extratos. A maioria dos extratos dos fundos do Banco do Brasil, Caixa Econômica Federal, Bradesco, Itaú, Socopa, B3 e outros podem ser retirados diretamente no site de cada um deles;
- Receber todos os extratos solicitados até o **5º Dia útil** de cada mês e salvar na pasta de extratos do mês em referência;
- Até o **5º Dia útil** de cada mês realizar o fechamento da planilha da carteira do mês anterior;
- Preencher o Resumo Anual.

11. Abertura de nova carteira mensal:

Até o **6º Dia útil** de cada mês abrir nova planilha da carteira de investimentos, após o fechamento da carteira do mês anterior.

Portanto, copiar a Planilha da Carteira do mês anterior e promover as devidas alterações, conforme os passos anteriores de inclusão/exclusão de fundos e atualização da carteira.

12. Checklist da Carteira:

12.1 De abertura

| CHECKLIST 2019 | | |
|----------------|---|--------|
| AÇÕES | | STATUS |
| 1 | "SALVAR COMO" A CARTEIRA DO MÊS ANTERIOR TROCANDO O NOME PARA O MÊS ATUAL | ok |
| 2 | INSERIR COTAS DO MÊS DE REFERÊNCIA NA ABA "QUANTUM COTAS" | ok |
| 3 | INSERIR PL's DO MÊS DE REFERÊNCIA NA ABA "QUANTUM PL" | ok |
| 4 | COLAR INFORMAÇÕES DO MÊS ANTERIOR NA ABA "APOIO" | ok |
| 5 | VERIFICAR AS DATAS NA ABA "APOIO" | ok |
| 6 | COLAR RENTABILIDADE DO MÊS ANTERIOR NA ABA "INSER RENT MSD" | ok |
| 7 | VERIFICAR DATA INICIAL NAS ABAS DOS FUNDOS | ok |
| 8 | APAGAR MOVIMENTAÇÕES NAS ABAS DOS FUNDOS | ok |
| 9 | VERIFICAR DATA INICIAL NA ABA "CONSOLIDADO" | ok |
| 10 | VERIFICAR DIAS DA SEMANA NA ABA "CONSOLIDADO" | ok |
| 11 | VERIFICAR DATA FINAL NA ABA "CONSOLIDADO" | ok |
| 12 | INSERIR SALDO DO MÊS ANTERIOR NA ABA "RESUMO" | ok |
| 13 | VERIFICAR AS DATAS NA ABA "RESUMO" | ok |
| 14 | INSERIR FÓRMULA PARA SALDO DO MÊS ATUAL NA ABA "RESUMO" | ok |
| 15 | APAGAR TODOS OS DADOS INSERIDOS NA ABA "RESUMO" | ok |
| 16 | VERIFICAR RENTABILIDADES DIGITADAS NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |

12.2 De fechamento

| CHECKLIST DA CARTEIRA | | |
|-----------------------|---|--------|
| AÇÕES | | STATUS |
| 1 | VERIFICAR RENTABILIDADES NA ABA "INSER RENT MSD" | ok |
| 2 | VERIFICAR OS ÚLTIMOS DIAS DO MÊS DA RENTABILIDADE NA ABA "CONSOLIDADO" | ok |
| 3 | PREENCHER SALDO ATUAL DO MÊS NA ABA "RESUMO" DE ACORDO COM OS EXTRATOS | ok |
| 4 | PREENCHER SALDO DO MÊS ANTERIOR NA ABA "RESUMO" DE ACORDO COM OS EXTRATOS | ok |
| 5 | PREENCHER COTA DE FECHAMENTO NA ABA "RESUMO" DE ACORDO COM OS EXTRATOS | ok |
| 6 | PREENCHER QUANTIDADE DE COTAS DE FECHAMENTO NA ABA "RESUMO" DE ACORDO COM OS EXTRATOS | ok |
| 7 | PREENCHER APLICAÇÕES DO MÊS NA ABA "RESUMO" DE ACORDO COM OS EXTRATOS | ok |
| 8 | PREENCHER RESGATES DO MÊS NA ABA "RESUMO" DE ACORDO COM OS EXTRATOS | ok |
| 9 | PREENCHER RENDIMENTOS DO MÊS NA ABA "RESUMO" DE ACORDO COM OS EXTRATOS | ok |
| 10 | VERIFICAR SE TODAS AS CHECAGENS ESTÃO ZERADAS | ok |
| 11 | VERIFICAR AS SOMAS DA ABA "RESUMO" | ok |
| 12 | VERIFICAR AS DESPESAS NA ABA "RESUMO" | ok |
| 13 | CONFERIR AS DATAS NA ABA "RESUMO" | ok |

| | | |
|----|---|----|
| 14 | VERIFICAR SE OS RETORNOS DA ABA "RESUMO" ESTÃO PRÓXIMOS AOS DA ABA "CONSOLIDADO" | ok |
| 15 | VERIFICAR RECEITAS NA ABA "CONTABILIDADE" | ok |
| 16 | VERIFICAR DESPESAS NA ABA "CONTABILIDADE" | ok |
| 17 | SEPARAR RECEITA E RESGATE DO FIDC CASAN | ok |
| 18 | VERIFICAR SE TODAS AS CHECAGENS ESTÃO ZERADAS NA ABA "CONTABILIDADE" | ok |
| 19 | INSERIR O RETORNO DE RENDA FIXA DA ABA "CONSOLIDADO" NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 20 | INSERIR O RETORNO DE RENDA VARIÁVEL DA ABA "CONSOLIDADO" NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 21 | INSERIR O RETORNO TOTAL DA CARTEIRA DA ABA "CONSOLIDADO" NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 22 | INSERIR O RETORNO DO IPCA DO MÊS NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 23 | INSERIR O RETORNO DO IPCA + 6% DO MÊS NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 24 | INSERIR O RETORNO DO CDI DO MÊS NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 25 | INSERIR O RETORNO DO IBOVESPA DO MÊS NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 26 | VERIFICAR RENTABILIDADES DIGITADAS NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 27 | INSERIR SALDO DE FECHAMENTO NA Tabela Evolução do Patrimônio Líquido "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 28 | INSERIR RETORNO DE FECHAMENTO NA Tabela Evolução do Patrimônio Líquido "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 29 | PREENCHER DADOS DO MÊS NA ABA "DADOS ACUMULADOS" | ok |
| 30 | VERIFICAR SALDO DA CARTEIRA NA ABA "POLÍTICA INVESTIMENTOS" | ok |
| 31 | CONFERIR OS GRÁFICOS NA ABA "SITE" | ok |
| 32 | CONFERIR OS SALDOS NA ABA "CADPREV" | ok |
| 33 | CONFERIR OS PL's NA ABA "CADPREV" | ok |

12.3 Diário

| CHECKLIST 2019 | | |
|----------------|--|--------|
| AÇÕES | | STATUS |
| 1 | INSERIR PL NA ABA "QUANTUM PL" | ok |
| 2 | INSERIR COTAS NA ABA "QUANTUM COTAS" | ok |
| 3 | INSERIR MOVIMENTAÇÕES DO DIA NAS ABAS DOS FUNDOS | ok |
| 4 | INSERIR AS DESPESAS DO DIA NA ABA "RESUMO" | ok |
| 5 | ATUALIZAR A DATA NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | ok |
| 6 | VERIFICAR A DIFERENÇA DE PL EM RELAÇÃO AO DIA ANTERIOR NA ABA "QUADRO DEMONSTRATIVO" | |

CAPÍTULO XI

DAIR

DAIR- CAPÍTULO XI

PROCEDIMENTOS

O DAIR a partir do ano de 2017, passou a ter o preenchimento mensal ou sempre que ocorrer a necessidade de APR ou alterações. Deste modo, a remessa de um mês deve ser feita até o último dia do mês seguinte, conforme calendário divulgado pela Secretaria de Previdência.

O preenchimento do mesmo, consta de Manual DAIR constante do site da SPREV. Apesar de termos até 30 dias para transmitirmos o DAIR, o recomendado é fazer, diariamente as APR, e transmitir o DAIR tão logo ocorra o fechamento da carteira. Média de até o décimo dia do mês seguinte.

É preciso ficar atento aos seguintes itens:

- Houve ou não mudanças de conselheiros ou gestores: Caso positivo, providenciar a alteração;
- Marcar o mês de fechamento do DAIR;
- Existe algum Gestor, Administrador, Distribuidor para inclusão ou exclusão;
- Existe algum fundo de investimento para inclusão ou exclusão;
- Atas;
- No final do relatório descrever os retornos comparativos;
- Fazer todas as APR. No caso do Fundo Previdenciário RECIPREV, deve ser feito APR para qualquer valor;
- No caso do Fundo Financeiro RECIFIN basta fazer uma única APR relativo ao resumo total do mês para os fundos de aplicações e resgates diários do BB e Bradesco.

O manual do DAIR consta do site:

<http://www.previdencia.gov.br/regimes-proprios/investimentos-do-rpps/>

Todos os meses após a conclusão do DAIR no CADPREV local, efetuar o seguinte:

1. Gerar o arquivo XML;
2. Acessar o CADPREV WEB e transmitir o arquivo XML;
3. Após um tempo consulte se o arquivo foi processado sem pendências;
4. Se houver pendências, providencie a resposta das pendências ou corrigir o DAIR se foi decorrente de erro de processamento;
5. Emita a Declaração de Veracidade;

6. Colha a assinatura na Declaração de Veracidade;
7. Digitalize a Declaração de Veracidade e encaminhe via CADPREV WEB;
8. Imprima o DAIR e Relatórios de APR do CADPREV WEB;
9. Divulgue no site da AMPASS o DAIR e Relatórios de APR retirados do CADPREV WEB;
10. Guarda a Declaração de Veracidade original na pasta de Declarações;
11. Salve o DAIR e Relatórios de APR do CADPREV WEB nas pastas: site e em APR ->CADPREV

CAPÍTULO XII

OUTRAS ATIVIDADES

OUTRAS ATIVIDADES - CAPÍTULO XII

CRONOGRAMA DAS REUNIÕES DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os cronogramas das reuniões do Comitê de Investimentos são definidos todos os anos conforme regulamento do Comitê de Investimento e, após digitalizados em “PDF”, são divulgados no Site da AMPASS.

Os documentos originais da definição das reuniões são guardados na Gerência de Investimentos.

A Gerência de investimentos verifica as datas e encaminha o documento para o Presidente do Comitê de Investimentos. Este por sua vez verifica a adequação das datas, encaminha ao Comitê e definem as datas. Após isto, é assinado o documento e devolvido para a Gerência de Investimentos.

PLANO DE AÇÃO ANUAL DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS

Em janeiro de cada ano a Gerência de Investimentos elabora o Plano de Ações da Gerência de Investimentos para o respectivo ano, conforme o modelo de Plano de Ações, e entrega uma cópia para a Presidência da Autarquia e Controles Internos.

PLANO DE CAPACITAÇÃO

Em janeiro de cada ano a Gerência de Investimentos elabora o Plano de Capacitações da Gerência de Investimentos, conforme o modelo de Plano de Capacitações e entregar uma cópia para a Presidência da Autarquia e Controles Internos.

COMUNICAÇÃO INTERNA - CI

O formulário de Comunicação Interna (CI) consta o modelo na pasta CI. Deve ser utilizada sempre que houver a necessidade.

CAPÍTULO XIII

APLICATIVO QUANTUM AXIS

APLICATIVO QUANTUM AXIS - CAPÍTULO XIII

DEFINIÇÃO

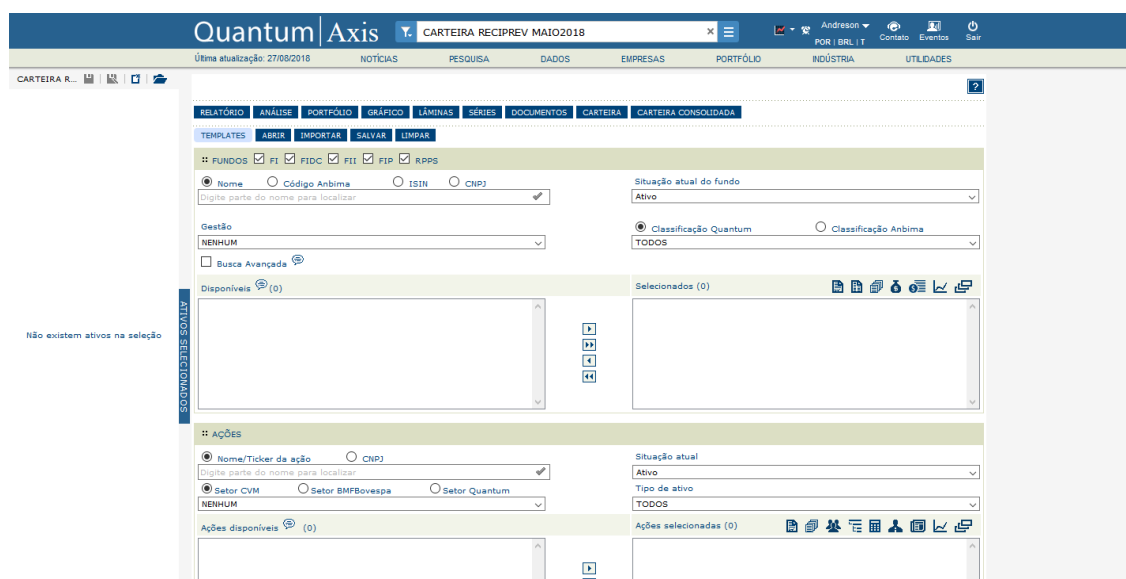
O Quantum é um software utilizado pela Gerência de Investimentos para acompanhamento e análise dos fundos de investimentos, captura de cotas e patrimônio líquido e obtenção de lâminas dos fundos. Nele matem-se uma cópia da carteira do Fundo Previdenciário RECIPREV a título de conferência.

Para acessar: <https://www.quantumaxis.com.br/webaxis/>


OPERANDO O SISTEMA

▪ Tela Inicial

- ✓ Ao inserir o login e senha o Quantum abrirá com a seguinte janela:



▪ Obtenção de Lâmina dos fundos


- ✓ Para localizar a lâmina de um fundo deve-se digitar o nome/CNPJ/Código do fundo no campo de pesquisa abaixo de "FUNDOS";
- ✓ Em seguida, deve-se selecionar o fundo jogando-o para o quadro da direita com a seta 

- ✓ Na barra de menu selecione **LÂMINAS** e na janela que abrirá clique em PDF para baixar a lamina do fundo.

- **Verificação de Cotas e patrimônio líquido**

- ✓ Selecione o fundo como demonstrado no item anterior;

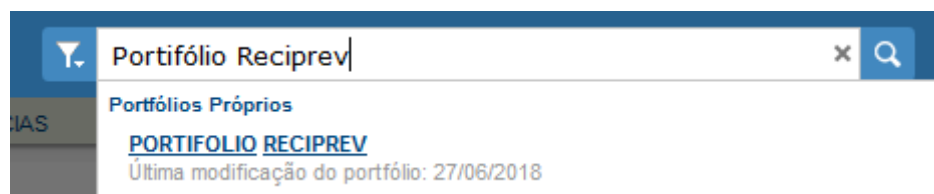
- ✓ Em seguida clique em **SÉRIES** na barra de menu.

- ✓ Na janela que abrirá selecione “cota” e “Patrimônio Líquido” jogando para a caixa da direita através da seta , escolha os formatos, o período e a periodicidade que desejar e clique em

CONSULTAR


- **Portfólio RECIPREV**

- ✓ Para acessar o Portfólio RECIPREV no Quantum deve-se digitar o nome no campo de pesquisa e clicar nele:



- ✓ Em seguida, clicar em “Adicionar a seleção”

- **Inserindo as movimentações na carteira RECIPREV**

- ✓ Para inserir uma aplicação ou resgate na carteira, com o portfólio selecionado, clique no menu **PORTFÓLIO**, em seguida em “realocação”. Clique no ícone  insira a data e o valor da alocação e clique em OK.

CAPÍTULO XIV

MODELOS E DIRETRIZES

CRENCIAMENTO, ANÁLISE E RENOVAÇÕES DAS INSTITUIÇÕES: GESTORES E ADMINISTRADORES

RESUMO DOS DOCUMENTOS, DADOS E ANÁLISES PRELIMINAR DO GESTOR e ADMINISTRADOR

- Atos Constitutivos, Estatuto ou Contrato Social e última alteração, devidamente registrados, em se tratando de sociedades comerciais. No caso de sociedades por ações, acompanhado do documento de eleição de seus administradores;
- Certidão da Fazenda Estadual ou Distrital;
- Certidão da Fazenda Municipal;
- Certidão quanto a Contribuições para o FGTS;
- Certidão de Débitos relativos a Créditos Tributários Federais e à Dívida Ativa da União;
- Termo de Declaração;
- Questionário Padrão Due Diligence ANBIMA Seção 1 e 3 e seus anexos;
- Relatórios de Ratings de Qualidade de Gestão e Ambiente de Controle;
- Balanço Patrimonial e demonstrações contábeis dos 3(três) últimos exercícios sociais, já exigíveis e apresentados na forma da lei, devidamente auditados, que comprovem a solidez da situação econômico-financeira da entidade, sendo vedada a sua substituição por balancetes ou balanços provisórios;
- O administrador ou o gestor do fundo de investimento é instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil obrigada a instituir comitê de auditoria e comitê de riscos, nos termos da regulamentação do Conselho Monetário Nacional;
- O administrador do fundo de investimento deter no máximo 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social;
- Estrutura da Instituição;
- Segregação de Atividades;
- Qualificação do corpo técnico;
- Histórico e experiência de atuação;
- Principais Categorias de Ativos e Fundos;
- Avaliação dos riscos assumidos pelos fundos sob sua administração/gestão;
- Verificação de informações sobre conduta nas operações realizadas no mercado financeiro e restrições que desaconselham um relacionamento seguro;
- Regularidade Fiscal e Previdenciária;
- Volume de recursos sob administração/gestão;
- Avaliação da rentabilidade dos fundos sob sua administração/gestão;

- Critérios de análise pré-estabelecidos pelo ente federativo para credenciamento ou alocação de recursos do RPPS;
- Qualidade de gestão e de ambiente de controle de investimento;
- Outros critérios de análise;
- Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigados, pelo BACEN;
- Disponibilização de Documentos no Site;
- Penalidades: Pesquisa CVM, BACEN e mercado;
- Agência de Rating;
- Nota do Rating;
- Data do Rating;
- Vencimento do Rating.

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

RESUMO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR e ADMINISTRADOR

- Saldo;
- % PL RECIPIREV;
- Volume de Gestão ANBIMA GESTOR e ADMINISTRADOR;
- Percentual do Volume de Recursos RECIPIREV em relação ao Volume ANBIMA do GESTOR e ADMINISTRADOR;
- Volume de Gestão ANBIMA junto a RPPS do GESTOR e ADMINISTRADOR;
- Percentual do Volume de Gestão ANBIMA junto a RPPS do GESTOR e ADMINISTRADOR;
- Classificação ANBIMA do GESTOR e ADMINISTRADOR;
- Valor Máximo Admitido Resolução = 5% por GESTOR e ADMINISTRADOR;
- Valor Máximo Admitido por ADMINISTRADOR = 50%;
- Margem;
- Disponibilização de Documentos no Site;
- Penalidades;
- Data Credenciamento;
- Data Renovação.

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

CREDENCIAMENTO, ANÁLISE E RENOVAÇÕES DAS INSTITUIÇÕES DISTRIBUIDORAS

São observados:

- CNPJ;
- Data registro CVM;
- Disponibilização de Documentos no Site;
- Penalidades;
- Data credenciamento;
- Data renovação;
- Número/Identificação do Processo Administrativo;

- Verificação de informações sobre conduta nas operações realizadas no mercado financeiro e restrições que desaconselhem um relacionamento seguro;
 - Regularidade Fiscal e Previdenciária;
 - Estrutura da Instituição;
 - Segregação de Atividades;
 - Qualificação do corpo técnico;
 - Histórico e experiência de atuação;
 - Principais categorias de ativos e fundos;
 - Volume de recursos sob administração/gestão;
 - Avaliação da rentabilidade dos fundos sob sua administração/gestão;
 - Avaliação dos riscos assumidos pelos fundos sob sua administração/gestão;
 - Critérios de análise pré-estabelecidos pelo ente federativo para credenciamento ou alocação de recursos do RPPS;
 - Outros critérios de análises;
 - Cópia dos contratos de distribuição
- Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

CREDENCIAMENTO, ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

Quanto ao credenciamento dos fundos de investimentos, são verificados quando do credenciamento e acompanhamentos:

- Nome do Fundo;
- CNPJ;
- Gestor;
- CNPJ Gestor;
- Administrador;
- CNPJ Administrador;
- Custodiante;
- CNPJ Custodiante;
- Distribuidor;
- CNPJ Distribuidor;
- Artigo da Resolução 3.922/10;
- Limite por fundo de investimento;
- % Resolução 3.922/10 - Limite Inicial;
- % Resolução 3.922/10 - Pró Gestão - Limite Nível I;
- % Resolução 3.922/10 - Pró Gestão - Limite Nível II;
- % Resolução 3.922/10 - Pró Gestão - Limite Nível III;
- % Resolução 3.922/10 - Pró Gestão - Limite Nível IV;
- Corresponde nos Termos de Credenciamento;
- Segmento: Renda Fixa ou Renda Variável;
- Data de Início;
- Benchmark (Índice de Referência anual);
- Grupo de Benchmark;

- Prazo Duração do Fundo;
- Prazo de Carência;
- Prazo para conversão de cotas em dias;
- Dia da Solicitação e Pagamento;
- Prazo para pagamento dos resgates em dias;
- Taxa de Administração Anual (%);
- Índice Referência da Taxa de Performance;
- Taxa performance;
- Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010;
- Observação;
- Aplicação;
- Risco Classificado pelo Administrador;
- Classificação Risco do Fundo;
- Agência de Rating do Fundo;
- Rating de Crédito do Fundo (Classificação de risco);
- Data do relatório de Rating;
- Prazo de Liquidação;
- Instituição;
- Data Análise;
- Data Credenciamento;
- Código ANBIMA;
- Público Alvo;
- Data listagem Bolsa;
- Código Negociação Bolsa;
- FIC de FI;
- Característica dos Ativos;
- Compatibilidade aplicação com as obrigações da RECIPREV;
- Principais Riscos do Fundo;
- CNPJ do Fundo Aplicado;
- Segmento;
- Tipo de Ativo;
- % Carteira do Fundo;
- Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?
- Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?
- Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?
- Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?
- Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?
- Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?
- A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?
- O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?
- Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?
- O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?

- O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?
- O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?
- 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?
- 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?
- 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?
- O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantém a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?
- 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?
- 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?
- Retorno Ano 2011;
- Retorno Ano 2012;
- Retorno Ano 2013;
- Retorno Ano 2014;
- Retorno Ano 2015;
- Retorno Ano 2016;
- Retorno Ano 2017;
- Retorno Ano 2018;
- Retorno Ano 2019;
- Retorno Médio Mensal;
- Retorno Médio Anual;
- Retorno Total;
- Maior Retorno;
- Menor Retorno;
- Qtde. mês Positivo;
- Qtde. mês Negativo;
- Qtde. mês acima do Benchmark;
- Qtde. mês abaixo do Benchmark;
- Risco Mensal Período;
- Risco mensal 12 meses;
- Risco Anual do Período;

- Em 68% dos dados o retorno ficará entre;
 - Em 95% dos dados o retorno ficará entre;
 - Retorno Relativo ao Benchmark;
 - Retorno Relativo ao CDI;
 - Retorno Relativo ao IBOVESPA;
 - Retorno Relativo ao IMA B;
 - Retorno Relativo ao IPCA + 6% ano;
 - Sharpe;
 - Information Ratio;
 - Tracking Error;
 - VAR HISTÓRICO (95%);
 - VAR 12 MESES (95%);
 - Correlação CDI;
 - Correlação IMA-B;
 - Correlação IBOVESPA;
 - Sharpe Modificado;
 - Beta (12 meses);
 - Erro Quadrático Médio (EQM);
 - Questionário Due Diligence ANBIMA Seção 2;
 - Pesquisa Comissão de Valores Mobiliários:
 - Balancete
 - Composição da Carteira
 - Dados diários (Valor.Quota, Patrimônio Líquido, Número de Cotistas, Captação e Resgate)
 - Fato Relevante
 - Prospecto
 - Regulamento
 - Lâmina do Fundo
 - Demonstrações contábeis com parecer do auditor
 - Perfil mensal
 - Formulário de Informações Complementares
 - Outros
- Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTOS DIÁRIOS E MENSAIS

Diariamente, a Gerência de Investimentos efetua diversos acompanhamentos da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV, dentre os quais, destacamos:

- Volume e % dos gestores e administradores por RF, RV e Exterior;
- Arquivo contendo: Nome do Fundo; Gestor; Administrador; Taxa de Administração Anual (%); Benchmark (Índice de Referência anual); Taxa Performance; % PL RECIPREV; % PL Fundo; Saldo (R\$); CNPJ do fundo; Rentabilidade do Produto (mensal); Rentabilidade do Produto (anual); Prazo de Liquidação; Artigo da Resolução 3.922/10; Classificação Risco do Fundo;

- Gráfico da Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual;
- Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV – Ano;
- Percentual de Participação das Instituições Administradoras Consolidado por Grupo Econômico - Carteira RECIPREV – Ano Atual;
- Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV – Ano Atual;
- Percentual de participação dos investimentos da RECIPREV em relação ao Volume sob Administração ANBIMA;
- Percentual de participação dos investimentos da RECIPREV em relação ao Volume Consolidado por Grupo Econômico sob Administração ANBIMA;
- Percentual de participação dos investimentos da RECIPREV em relação ao Volume sob Gestão ANBIMA;
- Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Gestão ANBIMA – Ano Atual;
- Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Administração ANBIMA – Ano Atual;
- Percentual de Composição da Carteira RECIPREV por Benchmark – Ano Atual;
- Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual:
 - Renda Fixa x Renda Variável;
 - Volatilidade da Carteira por Fundos de Investimentos e Títulos: muito baixa; baixa; média; alta e muito alta;
 - Prazos Gerais de Liquidação: Curto Prazo (Até 60 dias); Médio Prazo (Até 5 anos); Longo Prazo (Acima de 5 anos);
- Acompanhamento Geral da Política de Investimentos;
- Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual;
- Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

Mensalmente, todos os dados anteriores mais os dados a seguir:

- Resumo do Patrimônio Líquido e Rentabilidade da Carteira de Investimentos
 - Fundo Previdenciário RECIPREV
 - Fundo Financeira RECIFIN
 Contendo os seguintes dados: Data; Saldo; Rendimento mês; % Rendimento Carteira e o resumo anual.
- Gráfico comparativo da carteira RECIPREV:
 - Rendimento da Carteira (%) x Crescimento da Carteira (%) do Ano Atual;
 - Rendimento da Carteira (%) x IPCA + 6% x CDI x IMA-B x IBOVESPA do ano atual
- Rendimento da Carteira (%) x IPCA + 6% x CDI x IMA-B x IBOVESPA de 2013 até o Ano atual;

- Comparativo das NTN-B 2045, a preço de mercado, curva e IPCA+6% ao ano;
- Fluxo mensal de caixa com resumo anual de recebimentos/pagamentos do Fundo Previdenciário RECIPREV;
- Contratos de prestação de serviços da Gerência de Investimentos com os fluxos de pagamentos mensais e resumo anual;
- Estatística da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV;
- Evolução da Carteira de Investimentos e Superavit atuarias da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV;
- Panorama Macroeconômico;
- Desempenho da Carteira de Investimentos RECIPREV;
- Parecer do Comitê de Investimentos da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde do Servidores (RECIPREV)

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

DELIBERAÇÕES DOS INVESTIMENTOS

- Data da Reunião;
- APR/OFICIO;
- Tipo;
- Valor;
- Fundo;
- Atende a resolução quanto ao Comitê de Auditoria e Risco?
- Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigados, pelo BACEN;
- Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigados, pelo BACEN;
- CNPJ;
- Data credenciamento do fundo;
- Gestor;
- Data Credenciamento Gestor;
- Administrador;
- Data Credenciamento Administrador;
- Custodiante;
- Distribuidor;
- Data Credenciamento Distribuidor;
- Res.3.922/10;
- Correspondente na Res.3.922/10;
- Tipo;
- Início do fundo;
- Benchmark;
- Prazo do fundo;
- Prazo de Carência;
- Prazo Conversão de Cotas;
- Prazo de Resgate do Fundo;
- Taxa de Administração;

- Índice Performance;
- Cobrança Taxa de Performance;
- Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010;
- Risco do fundo classificado pelo Administrador;
- Agência que realizou o Rating do Fundo;
- Rating de Crédito do Fundo (Classificação de risco);
- Data do Relatório de Rating;
- Prazo de Liquidação do fundo;
- Data Análise;
- Data do Credenciamento do Fundo;
- Código ANBIMA;
- Público Alvo do Fundo;
- Data listagem Bolsa;
- Código Negociação Bolsa;
- Característica dos Ativos;
- Compatibilidade com as obrigações da RECIPEV;
- Principais Riscos do Fundo;
- O Fundo aplica em outros Fundos;
- CNPJ do Fundo Aplicado;
- Segmento;
- Tipo de Ativo;
- % Carteira do Fundo;
- Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?
- Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?
- Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?
- Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?
- Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?
- Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?
- A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?
- O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?
- Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?
- O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?
- O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?
- O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?
- 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?
- 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?

- 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?
- 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?
- 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?
- 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?
- Retorno Ano 2011;
- Retorno Ano 2012;
- Retorno Ano 2013;
- Retorno Ano 2014;
- Retorno Ano 2015;
- Retorno Ano 2016;
- Retorno Ano 2017;
- Retorno Ano 2018;
- Retorno Ano 2019;
- Retorno Médio Mensal;
- Retorno Médio Annual;
- Retorno Total;
- Maior Retorno;
- Menor Retorno;
- Qtde. meses positivo;
- Qtde. meses negativo;
- Qtde. mês acima do Benchmark;
- Qtde. mês abaixo do Benchmark;
- Risco Mensal Período;
- Risco Mensal 12 meses;
- Risco Anual do Período;
- Em 68% dos dados o retorno ficará entre;
- Em 95% dos dados o retorno ficará entre;
- Retorno Relação Benchmark;
- Retorno Relativo ao CDI;
- Retorno Relativo ao IBOVESPA;
- Retorno Relativo ao IMA B;
- Retorno Relativo ao IPCA + 6% ano;
- Sharpe;
- Information Ratio;

- Treck Error;
- VAR HISTÓIRICO (95%);
- VAR 12 MESES (95%);
- Correlação CDI;
- Correlação IMA – B;
- Correlação Ibovespa;
- Sharpe Modificado;
- Índice Beta (12 meses);
- Erro Quadrático Médio (EQM);
- Ranking ANBIMA Gestão;
- Volume sob Gestão/ANBIMA;
- Volume de Recursos do Gestor com RPPS;
- % Recursos do Gestor com RPPS;
- Empresa Certificadora do Rating;
- Rating (Conceito);
- Rating do Gestor;
- Total Aplicado com o Gestor;
- Limite Gestor;
- Margem para aplicar com o Gestor;
- Ranking ANBIMA Administração;
- Volume sob Administração/ANBIMA;
- Volume de Recursos do Administrador com RPPS;
- % Recursos do Administrador com RPPS;
- Máximo de Recursos do Administrador com RPPS não pode ultrapassar 50%;
- Total Aplicado com o Administrador;
- Limite Administrador;
- Margem para aplicar com o Administrador;
- Valor que a RECIPREV já possui aplicado no Fundo sob análise;
- % do fundo no PL da Carteira;
- % do fundo no PL do Fundo;
- PL do fundo;
- PL Carteira RECIPREV;
- % que a RECIPREV possui no Segmento;
- Volume que a RECIPREV possui aplicado no Segmento;
- % Resolução 3.922/10 - Limite Política Investimentos
- % Resolução 3.922/10 - Limite Máximo
- % Resolução 3.922/10 - Pró Gestão - Limite Nível I;
- % Resolução 3.922/10 - Pró Gestão - Limite Nível II;
- % Resolução 3.922/10 - Pró Gestão - Limite Nível III;
- % Resolução 3.922/10 - Pró Gestão - Limite Nível IV;
- % máximo sobre o PL do Fundo;
- % máximo por fundo em razão PL da Carteira;
- Margem;
- A aplicação atende o % máximo de 20%

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR

Todas as APR relativos ao Fundo Previdenciário RECIPREV, constam os dados a seguir:

- Fundo;
- CNPJ do Fundo;
- Segmento;
- Tipo de Ativo;
- Tipo de operação realizada;
- Valor da operação;
- Quantidade de Cotas;
- Valor da Cota (R\$);
- Data da Operação;
- Data de Liquidação;
- Patrimônio Líquido do Fundo (R\$);
- (%) no Patrimônio Líquido do fundo;
- Limite Máximo por PL do fundo;
- Banco/Agência/Conta;
- Administrador;
- CNPJ do Administrador;
- Data do Termo de Credenciamento do Administrador;
- Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN;
- Volume de Recursos do Administrador com RPPS;
- % 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.;
- Gestor;
- CNPJ do Gestor;
- Data do Termo de Credenciamento do Gestor;
- Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN;
- Volume de Recursos do Gestor com RPPS;
- % Recursos do Gestor com RPPS;
- Empresa de Rating;
- Conceito;
- Representação do conceito;
- O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN;
- Distribuidor;
- CNPJ do Distribuidor;
- Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor;
- Data de Início FI;
- Taxa Administração do FI (%);
- Índice de Referência do FI;
- Tx Performance do FI (%);

- Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não);
- Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance);
- Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010;
- Agência de Classificação de Risco que classificou o FI;
- Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco;
- Carência (dias);
- Data Listagem Bolsa;
- Resgate (dias);
- Cód. Negociação Bolsa;
- Fundo Destinado à Categoria de Investidor;
- Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos;
- CNPJ do Fundo;
- Segmento;
- Tipo de Ativo;
- % Carteira do Fundo;
- Descrição da operação (como foi realizada a negociação);
- Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado);
- Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo;
- Retorno Médio Mensal;
- Retorno Médio Anual;
- Retorno Total;
- Maior Retorno;
- Menor Retorno;
- Qtde. mês Positivo;
- Qtde. mês Negativo;
- Qtde. mês acima do Benchmark;
- Qtde. mês abaixo do Benchmark;
- Risco Mensal Período;
- Risco Mensal 12 meses;
- Risco Anual do Período;
- Retorno Relativo ao Benchmark;
- Sharpe ;
- Information Ratio;
- Tracking Error;
- VAR HISTÓRICO (95%);
- VAR 12 MESES (95%);
- Sharpe Modificado;
- Beta (12 meses);
- Erro Quadrático Médio (EQM);
- Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS;

- Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas);
- Outras Observações;
- Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?
- Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?
- Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?
- Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?
- Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?
- Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?
- A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?
- O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?
- Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?
- O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?
- O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?
- O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?
- 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?
- 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?
- 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?
- 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?
- 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?
- 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?

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

CONTRATOS DE PRESTAÇÃO DE SERVIÇOS

- Contrato de Sistema de Banco de Dados - Paramita Tecnologia Consultoria Financeira Ltda (QUANTUM)
- Contrato de Custódia Títulos junto ao Banco do Brasil S.A. O custo é somente o da SELIC
- Contrato com a Corretora Santander. Destinado a venda dos fundos: FII BB Recebíveis Imobiliário e Caixa Rio Bravo Fundo de Investimento Imobiliário - FII.Custo 0,10% de corretagem e os custos normais da operação.
- Contrato com a Corretora. Destinado a venda do fundo Socopa FII. Custo zero de corretagem. Somente os custos normais da operação.
- Contrato com a Corretora XPI. Destinado aos serviços de compra e venda de Títulos Públicos. Custo sobre as operações, quando houver, 0,001%
- Contrato com a Corretora Renascença. Destinado aos serviços de compra e venda de Títulos Públicos. Custo sobre as operações, quando houver, 0,001%
- Asset Liability Management (ALM), Cash Flow Matching e Fronteira Eficiente (Em processo de licitação)

FLUXO DE ENTRADAS E SAÍDAS

RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO (Fluxo Positivo)

- PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)
- PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL INATIVOS/PENSIONISTAS)
- PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)
- PARCELAMENTO
- COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA
- CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)
- CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)

RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS (Fluxo Positivo)

- BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)
- CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)
- FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)
- SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)

- FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES) - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)
- TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - (CUPOM/JUROS)
- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)
- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)
- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)
- FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)

FOLHA DE PAGAMENTO E CONSIGNAÇÕES (Fluxo negativo)

- FOLHA DE PAGAMENTO
- CONSIGNAÇÕES
- DEVOLUÇÕES DE FOLHA NÃO PROCESSADAS E DE CONSIGNAÇÕES

PAGAMENTOS DIVERSOS (Fluxo negativo)

- TARIFA DE CORRETAGEM DE COMPRA E VENDA DE TÍTULOS PÚBLICOS
- TARIFA DE CORRETAGEM DE FUNDOS IMOLIÁRIOS
- TARIFA DE CUSTÓDIA DE FUNDOS IMOBILIÁRIOS
- TARIFA DE CUSTÓDIA TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)
- CUSTO SELIC TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)
- (TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPREV)
- AUXILIO DOENÇA E OUTROS

RESUMO GERAL

- TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO
- TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMOTRIZAÇÕES ESPECÍFICAS
- TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS E CONSIGNAÇÕES
- TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS

METODOLOGIA E CRITÉRIOS PARA ANÁLISE PRÉVIA DOS RISCOS DOS INVESTIMENTOS E AS DIRETRIZES DE CONTROLE E MONITORAMENTO

Adotamos sistema rigoroso no credenciamento das instituições e fundos de investimentos. Analisamos diversos dados do fundo de investimento conforme o **tópico de credenciamento dos fundos** que envolve diversos itens.

Mensalmente, para todos os fundos da carteira analisamos os seguintes dados: Benchmark; Retorno Ano 2011; Retorno Ano 2012; Retorno Ano 2013; Retorno Ano 2014; Retorno Ano 2015; Retorno Ano 2016; Retorno Ano 2017; Retorno Ano 2018; Retorno Médio Mensal; Retorno Médio Anual; Retorno Total; Maior Retorno; Menor Retorno; Qtde. mês Positivo; Qtde. mês Negativo; Qtde. mês acima do Benchmark; Qtde. mês abaixo do Benchmark; Risco Mensal Período; Risco Mensal 12 meses; Risco Anual do Período; Em 68% dos dados o retorno ficará entre; Em 95% dos dados o retorno ficará entre; Retorno Relativo ao Benchmark; Retorno Relativo ao CDI; Retorno Relativo ao IBOVESPA; Retorno Relativo ao IMA B; Retorno Relativo ao IPCA + 6% ano; Sharpe; Information Ratio; Tracking Error; VAR HISTÓRICO (95%); VAR 12 meses (95%); Correlação CDI; Correlação IMA-B; Correlação IBOVESPA; Sharpe Modificado; Beta (12 meses); Erro Quadrático Médio (EQM).

Através do sistema Quantum analisamos a composição do fundo, bem como alterações promovidas no regulamento etc, inclusive, complementada com informações coletadas junto Comissão de Valores Mobiliários (CVM).

Diariamente, verificamos, também:

- Volume e % dos gestores e administradores por RF, RV e Exterior;
- Arquivo contendo: Nome do Fundo; Gestor; Administrador; Taxa de Administração Anual (%); Benchmark (Índice de Referência anual); Taxa Performance; % PL RECIPREV; % PL Fundo; Saldo (R\$); CNPJ do fundo; Rentabilidade do Produto (mensal); Rentabilidade do Produto (anual); Prazo de Liquidação; Artigo da Resolução 3.922/10; Classificação Risco do Fundo;
- Gráfico da Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual;
- Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV – Ano;
- Percentual de Participação das Instituições Administradoras Consolidado por Grupo Econômico - Carteira RECIPREV – Ano Atual;
- Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV – Ano Atual;
- Percentual de participação dos investimentos da RECIPREV em relação ao Volume sob Administração ANBIMA;
- Percentual de participação dos investimentos da RECIPREV em relação ao Volume Consolidado por Grupo Econômico sob Administração ANBIMA;
- Percentual de participação dos investimentos da RECIPREV em relação ao Volume sob Gestão ANBIMA;
- Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Gestão ANBIMA – Ano Atual;

- Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Administração ANBIMA – Ano Atual;
- Percentual de Composição da Carteira RECIPREV por Benchmark – Ano Atual;
- Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual;
 - Renda Fixa x Renda Variável;
 - Volatilidade da Carteira por Fundos de Investimentos e Títulos: muito baixa; baixa; média; alta e muito alta;
 - Prazos Gerais de Liquidação: Curto Prazo (Até 60 dias); Médio Prazo (Até 5 anos); Longo Prazo (Acima de 5 anos);
- Acompanhamento Geral da Política de Investimentos;
- Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual;
- Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

METODOLOGIA E CRITÉRIOS PARA AVALIAÇÃO E ACOMPANHAMENTO DO RETORNO ESPERADO DOS INVESTIMENTOS

Adotamos sistema próprio via “excel” e coleta de dados do sistema Quantum e acompanhamos, diariamente, o valor da cota, do patrimônio líquido e o retorno mensal e anual dos fundos de investimentos.

Mensalmente, calculamos para cada fundo: Benchmark; Retorno Ano 2011; Retorno Ano 2012; Retorno Ano 2013; Retorno Ano 2014; Retorno Ano 2015; Retorno Ano 2016; Retorno Ano 2017; Retorno Ano 2018; Retorno Médio Mensal; Retorno Médio Anual; Retorno Total; Maior Retorno; Menor Retorno; Qtde. mês Positivo; Qtde. mês Negativo; Qtde. mês acima do Benchmark; Qtde. mês abaixo do Benchmark; Risco Mensal Período; Risco Mensal 12 meses; Risco Anual do Período; Em 68% dos dados o retorno ficará entre; Em 95% dos dados o retorno ficará entre; Retorno Relativo ao Benchmark; Retorno Relativo ao CDI; Retorno Relativo ao IBOVESPA; Retorno Relativo ao IMA B; Retorno Relativo ao IPCA + 6% ano; Sharpe; Information Ratio; Tracking Error; VAR HISTÓRICO (95%); VAR 12 meses (95%); Correlação CDI; Correlação IMA-B; Correlação IBOVESPA; Sharpe Modificado; Beta (12 meses); Erro Quadrático Médio (EQM).

Adotamos Política de Riscos, com gestão pelo Comitê de Riscos, com produção mensal de Relatório Específico de Riscos, e encaminhado ao Comitê de Riscos para as análises adequadas, através de reunião mensal, quando necessária.

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN.

PLANO DE CONTINGÊNCIAS

Todas as aplicações realizadas pelo Fundo Previdenciário RECIPIREV atendem a Resolução 3.922/2010. Com a Resolução 4.604/2017, tivemos o apontamento, que hoje correspondem a 3 fundos de investimentos, para os quais, são informados todos os meses a SPREV, através do CADPREV, as ações tomadas. Um deles, imobiliário, encontra-se a venda na B3. Os outros dois seguirão os prazos de desinvestimento, conforme previsto no regulamento dos fundos e em conformidade com a Resolução 3.922/2010.

Com relação as alterações promovidas pela Resolução 4.695/2018, os casos identificados já foram comunicados aos administradores e gestores para a promoção da alteração dos administradores de modo a contemplar as condições da nova resolução, em particular: I - o administrador ou o gestor do fundo de investimento seja instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil obrigada a instituir comitê de auditoria e comitê de riscos, nos termos da regulamentação do Conselho Monetário Nacional; II - 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 e III - o gestor e o administrador do fundo de investimento tenham sido objeto de prévio credenciamento, de que trata o inciso VI do § 1º do art. 1º, e sejam considerados pelos responsáveis pela gestão de recursos do regime próprio de previdência social como de boa qualidade de gestão e de ambiente de controle de investimento.

Inclusive, controlamos, diariamente, os vencimentos anuais dos ratings de qualidade de gestão dos gestores e os ratings dos FDICS.

Temos o prazo de 180 dias para promover os ajustes para regularização, portanto, até 26/05/2019. Os casos em que não se ajustar as condições informadas, iremos promover os resgates.

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR PRAZOS E ATIVOS

O acompanhamento diário da carteira permite verificarmos os volumes e percentuais distribuídos no tempo. Adotamos a seguinte classificação:

- a) Até 60 dias
- b) Acima de 60 dias até 5 anos;
- c) Acima de 5 anos.

Para todos os fundos acima de 60 dias, efetuamos ATESTADO DE COMPATIBILIDADE DO INVESTIMENTO, o qual é elaborado com base no último cálculo atuarial, contemplando as receitas e despesas anuais, com vistas a evitarmos de fazer investimentos que possam comprometer o equilíbrio do fundo no tempo.

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

Os ativos compreendem os seguintes blocos de ativos:

- Renda fixa;
- Renda variável e investimentos estruturados;
- Investimentos no exterior

Obs: Referidas informações podem sofrer alterações e adaptações em decorrência de alterações de modelos pela SPREV ou CMN

CAPÍTULO XV

ALÇADAS

ALÇADAS - CAPÍTULO XV

ALÇADAS

O modelo de Alçadas é elaborado pela Gerência de Investimentos, conforme as normas da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores e deliberado através do Conselho Municipal de Previdência da Autarquia.

Pode ser revisado a qualquer momento.

O modelo contendo as Alçadas consta da Pasta: Resumos da Carteira RECIREF->Alçadas e divulgado no site da RECIREF <http://reciprev.recife.pe.gov.br/>.

CAPÍTULO XVI

COMITÊ DE RISCOS

COMITÊ DE RISCOS - CAPÍTULO XVI

COMITÊ DE RISCOS

A Política de Riscos consta do site da RECIPIREV. A revisão é anual, no entanto, a depender das circunstâncias, pode haver a revisão através do Comitê de Riscos.

Mensalmente, a Gerência de Investimentos, após o fechamento da Carteira de Investimentos do mês anterior, encaminha Relatório de Riscos dos Investimentos para o Comitê de Riscos dos Investimentos, que adotará as medidas necessárias ou submeterá ao Comitê de Investimentos ou Conselho para deliberações que envolvam movimentações de recursos como aplicações/resgates.

O Relatório de Riscos, contém diversos dados, em conformidade com a Política de Riscos dos Investimentos da Autarquia.

PROCEDIMENTOS MENSAIS

Após o fechamento mensal da Carteira de Investimentos, efetuar os seguintes procedimentos:

- a) Acessar a pasta RESUMOS CARTEIRA RECIPIREV, subpasta Cálculos Diários, subpasta Ano, subpasta Relatórios Diversos;
- b) Abrir o arquivo Relatórios Diversos e providenciar as atualizações das “abas”:
 - Atualiza Dados;
 - Saldos;
 - NTN-B 2040 e 2045;
 - Site.
- c) Agora vá para a “aba” RISCOS, e faça o seguinte:
 - Veja se o campo data está correto;
 - Veja se o campo com todos os fundos e ativos da carteira de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev estão todos listados com os respectivos riscos atribuídos pelos Administradores de Recursos ou pela RECIPIREV para aqueles que o administrador não atribuiu;
 - Veja se todos os dados necessários do relatório do risco de cada ativo da carteira de investimento estão corretamente listados;
 - Veja se está sendo feito o devido cálculo do risco da carteira considerando os saldos dos ativos e o risco dos ativos no modo matemático ponderado;
 - Agora vá para a parte do relatório: 2. RISCO DA CARTEIRA (CONCEITO DE VOLATILIDADE); VAR GERAL DA CARTEIRA; VOLATILIDADE DA CARTEIRA; PRAZOS DA CARTEIRA E RATINGS DE QUALIDADE DE GESTÃO, e no campo VAR DA CARTEIRA, informar nos campos a seguir os respectivos resultados dos cálculos: Risco, VaR histórico (95%) e VaR 12 meses (95%);

- Veja se os campos: VOLATILIDADE, PRAZOS DA CARTEIRA e RATINGS dos GESTORES, estão devidamente preenchidos e corretos, tendo atenção para o saldo total que precisa ser igual ao da carteira de investimentos;
- Vá para o campo: 3. RISCO DE FUNDOS ESPECÍFICOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV, e calcular os riscos dos fundos específicos que constam no modelo. Geralmente, são os fundos de maiores volatilidades;
- Vá para o campo 4. FUNDOS E TÍTULOS MARCADOS PELA CURVA DE JUROS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV, e veja se as informações estão corretas;
- Vá para o campo 5. GRÁFICO DAS NTN-B 2045 (MARCAÇÃO PELA CURVA DE JUROS X MARCAÇÃO À MERCADO) DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV, e atualize o gráfico para a data atual. Para tanto, teclar em cima do gráfico e marcar atualizar, isto se o gráfico já não estiver atualizado;
- Vá para o campo 6. RISCOS DE ADMINISTRADOR - GRUPO ECONÔMICO, e veja se está tudo preenchido correto e se o valor da carteira na curva e a mercado estão corretos e batendo com o saldo da carteira. Caso não, verificar onde está o erro e corrigir;
- Vá para o campo 7.1 FUNDOS DE DIREITOS CREDITÓRIOS (FIDIC). Só temos apenas um FIDIC que precisa de acompanhamento que é o FIDIC DUNAS. Veja se está com todas as informações atualizadas. Lembrando que sempre que o fundo efetuar pagamentos, deverá ser lançado também na planilha deste campo de modo a demonstrar sempre o valor atualizado. Também, registrar fatos relevantes;
- Vá para o campo 7.2 FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÃO (FIP), e veja se os saldos estão corretos, ou seja, se estão em conformidade com os saldos constantes na carteira de investimentos. Também, registrar fatos relevantes;
- Vá para o campo 8. PROVISÕES PARA PERDAS FUTURAS, e veja se está calculando conforme o mesmo valor constante da Carteira de Investimentos;
- Vá para o campo 11. FUNDOS DESENQUADRADOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV, e veja se os fundos listados e os valores e percentuais estão corretos. Deve-se comparar com os valores da carteira;
- Vá para o campo 12. FUNDOS DESENQUADRADOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV - RESOLUÇÃO CMN 4.695/2018 (RISCO LEGAL), e veja se os fundos listados e os valores e percentuais estão corretos. Deve-se comparar com os valores da carteira;
- Vá para o campo 13. IMPACTOS DE LIMITES DO ADMINISTRADOR E GESTOR DE INVESTIMENTOS, e veja se está devidamente preenchido em especial os limites por gestor e administrador que não podem ultrapassar os % previstos na Resolução 4.963/2021;
- Vá para o campo 14. DADOS RELATIVOS AO CREDENCIAMENTO DAS INSTITUIÇÕES, e veja se os campos “ação” possui alguma pendência de credenciamento. Caso sim, ver se foi solicitado os documentos para atualizar o credenciamento. Fazer o mesmo com relação aos ratings vencidos dos gestores de recursos;

- Fazer o parecer;
- Fechar o relatório;
- Imprimir em PDF;
- Coletar a assinatura dos membros do Comitê de Riscos;
- Divulgar no Site.

CAPÍTULO XVII

PLANO DE TRABALHO E PRESTAÇÃO DE CONTAS DO COMITÊ DE
INVESTIMENTOS

PLANO DE TRABALHO E PRESTAÇÃO DE CONTAS DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS - CAPÍTULO XVII

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

PLANO DE TRABALHO

Uma vez por ano, preferencialmente, em dezembro do ano anterior ou janeiro do ano em curso, a equipe da Gerência de Investimentos elabora o Plano de Trabalho do Comitê de Investimentos do ano seguinte, em conformidade com o modelo constante da pasta do Comitê de Investimentos e submete ao Comitê de Investimentos para deliberação e assinatura.

PRESTAÇÃO DE CONTAS

Uma vez por ano, preferencialmente, em janeiro do ano seguinte, a equipe da Gerência de Investimentos elabora o relatório de Prestação de Contas do Comitê de Investimentos do ano anterior, em conformidade com o modelo constante da pasta do Comitê de Investimentos e submete ao Comitê de Investimentos para deliberação e assinatura.

CAPÍTULO XVIII

ALM – ASSET LIABILITY MANAGEMENT

ALM – ASSET LIABILITY MANAGEMENT - CAPÍTULO XVIII

ESTUDO DE ASSET LIABILITY MANAGEMENT

Uma vez por ano é feito o processo de cotação/licitação para a escolha da empresa para realizar o estudo de Asset Liability Management da carteira de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev. Poderá, ocorrer, processo de cotação/licitação com vistas a prestação de serviços de consultoria específica de Asset Liability Management, em que envolve além do estudo, todo o processo de acompanhamento e análises constantes e atualizadas do ALM.

CAPÍTULO XIX

MODELOS

MODELOS - CAPÍTULO XIX

MODELOS

| Modelos | Pasta |
|---|---|
| Ata do Comitê de Investimentos | Resumos Carteira Reciprev -> Comitê de Investimentos -> Modelo Investimentos-Pauta-Ata |
| Atestado de Compatibilidade | Resumos Carteira Reciprev -> Apr e Atestados -> Modelos Apr e Atestado |
| Atualizações de fundos pelo DI | Resumos Carteira Reciprev -> Cálculos Diários -> Atualização de Fundos pelo DI |
| Autorização de Aplicação e Resgate – APR | Resumos Carteira Reciprev -> Apr e Atestados -> Modelos Apr e Atestado e também na Planilha Relatórios Diversos |
| Calendários de Recebimentos | Resumos Carteira Reciprev -> Cálculos da Carteira -> Ano mais recente -> Calendário de Recebimentos |
| Carteira de Investimentos | Resumos Carteira Reciprev -> Cálculos da Carteira -> Ano mais recente -> Carteira e Resumo Anual |
| CI | Resumos Carteira Reciprev -> Modelo CI |
| Contas Corrente | Resumos Carteira Reciprev -> Contas Corrente |
| Contratos Serviços da área de investimentos | Resumos Carteira Reciprev -> Contratos de Serviços Investimentos |
| Credenciamento de Instituições | Resumos Carteira Reciprev -> |

| | |
|---|--|
| | Credenciar Instituições -> Normas e Modelos |
| Cronograma das reuniões do Comitê de Investimentos e Conselho | Resumos Carteira Reciprev -> Comitê de Investimentos -> Cronograma de Reuniões e Reciprev -> Conselho Municipal de Previdência -> Cronograma de Reuniões |
| DAIR | Conforme modelo do Ministério -> Aplicativo CADPREV |
| Deliberações do Comitê de Investimentos | Resumos Carteira Reciprev -> Comitê de Investimentos -> Reuniões do Comitê -> Ano -> Mês |
| Ofícios | Resumos Carteira Reciprev -> Modelos de Ofício |
| Informativo para o TCE | Resumos Carteira Reciprev -> Cálculos da Carteira -> Ano -> Demonstrativo TCE |
| Declaração Investidor Qualificado | Resumos Carteira Reciprev -> Declarações de Investidor Qualificado |
| Pauta do Comitê de Investimentos | Resumos Carteira Reciprev -> Comitê de Investimentos -> Modelo Investimentos-Pauta-Ata |
| Pendências | Pendências -> Pendências Gerais |
| Política de Investimentos | Resumos Carteira Reciprev -> Política -> Política -> Ano |
| Site RECIPEV | http://reciprev.recife.pe.gov.br/ |
| Relatórios Diversos | Resumos Carteira Reciprev -> Cálculos Diários -> Ano |
| Relatórios Mensais da Carteira de Investimentos | É produzido através das planilhas Relatórios Diversos e Carteira de Investimentos através da Aba Site de cada um e depois é feita a unificação |

| | |
|---|---|
| | dos PDFs. |
| Resumo Anual da Carteira de Investimentos | Resumos Carteira Reciprev -> Cálculos da Carteira -> Ano -> Carteira e Resumo Anual |
| Planos de Ações e Capacitações | Resumos Carteira Reciprev -> Planos de Ações-> Ano |
| Alçadas | Resumos Carteira Reciprev -> Alçadas - > Ano |
| Comitê de Riscos | Resumos Carteira Reciprev -> Comitê de Riscos - > Relatórios de Riscos -> Ano |

CAPÍTULO XX

MAPEAMENTOS

MAPEAMENTOS - CAPÍTULO XX

MAPEAMENTOS

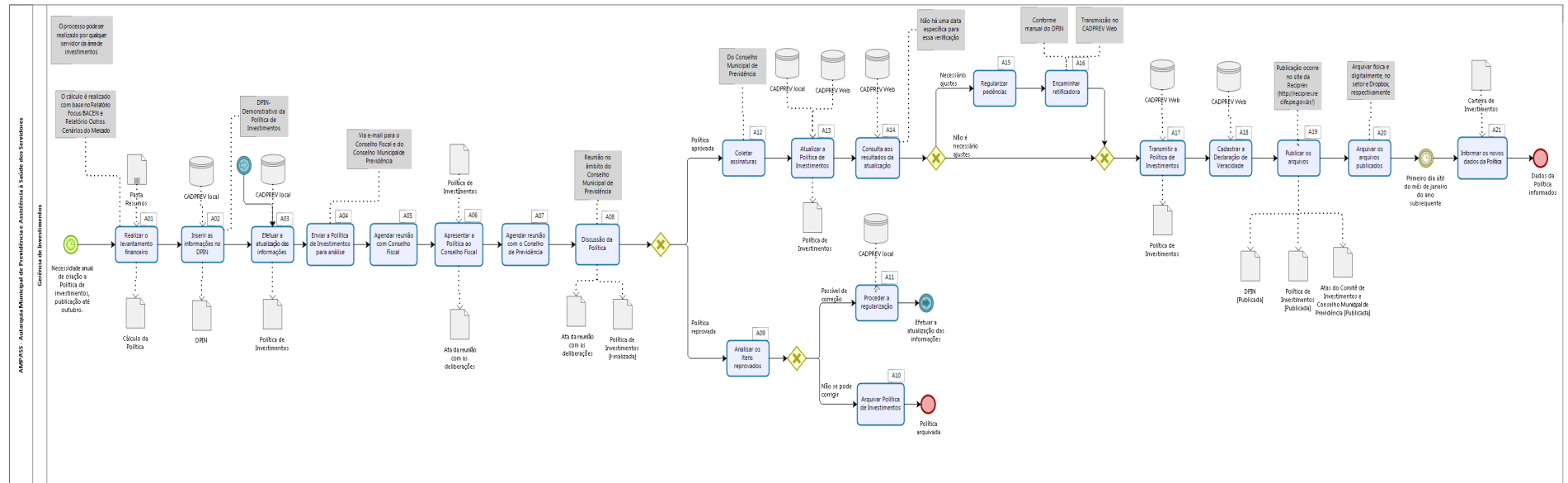
A seguir os mapeamentos dos seguintes processos:

- Política de Investimentos
 - Credenciamentos
- Política de Riscos dos Investimentos
 - APR
 - Riscos

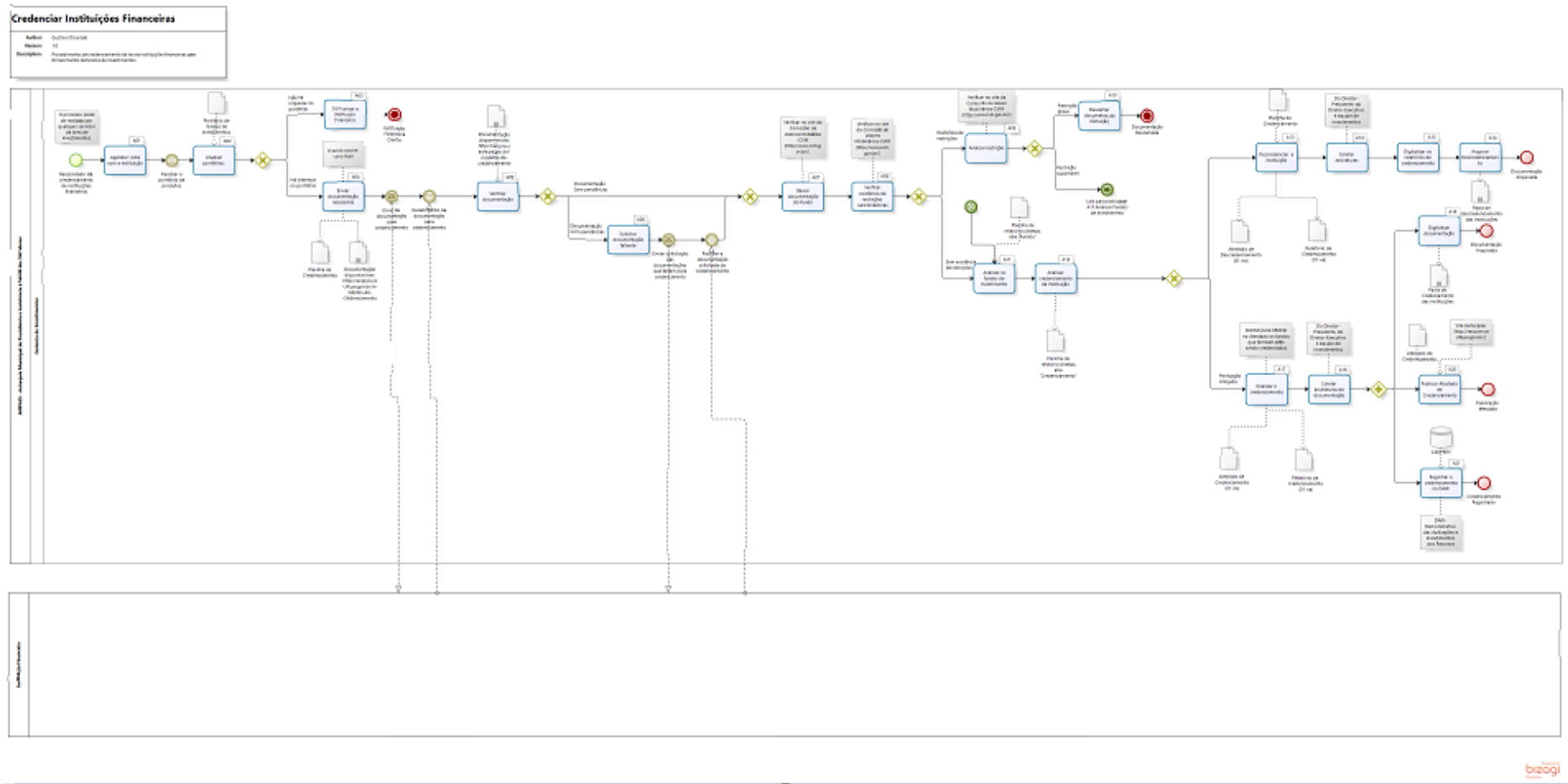
FORMULAR E APROVAR A POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

Formular e Aprovar Política de Investimentos

Autor: Gustavo Ourado
 Versão: 1.0
 Descrição: Formulação da Política de Investimentos que norteará os aportes financeiros da Autarquia



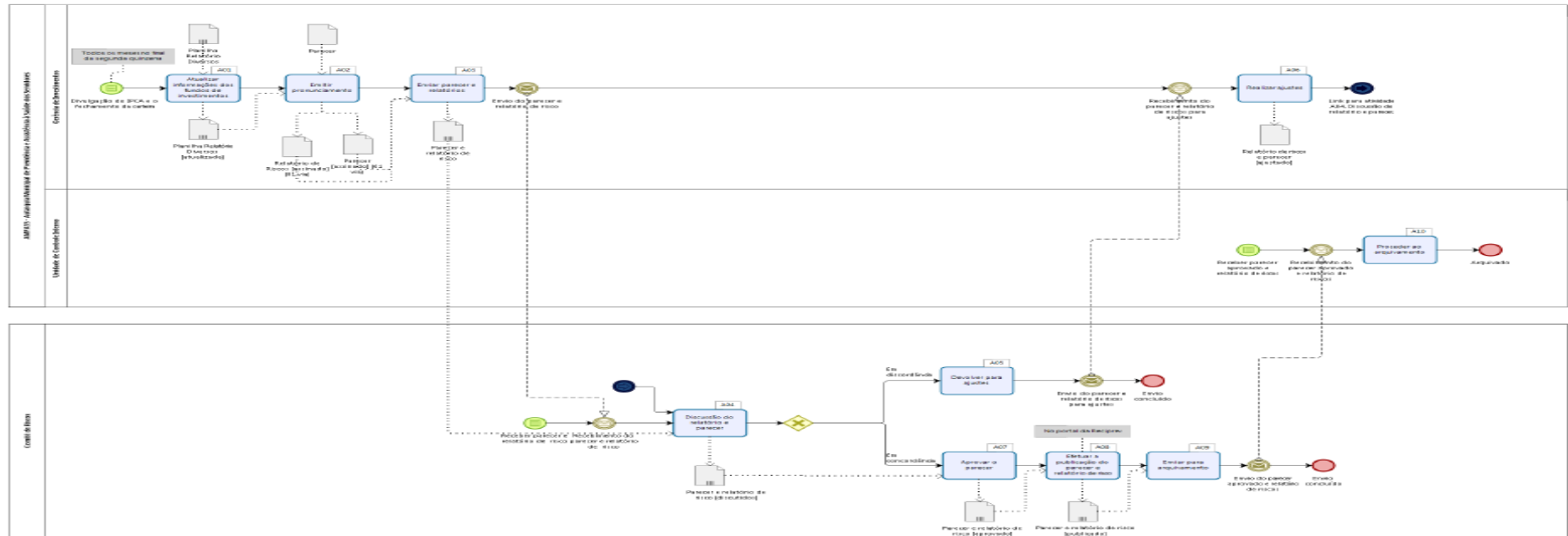
CRENCIAR INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS



GESTÃO DE RISCOS DOS INVESTIMENTOS

MP01.P012.Análise de riscos da carteira de investimentos

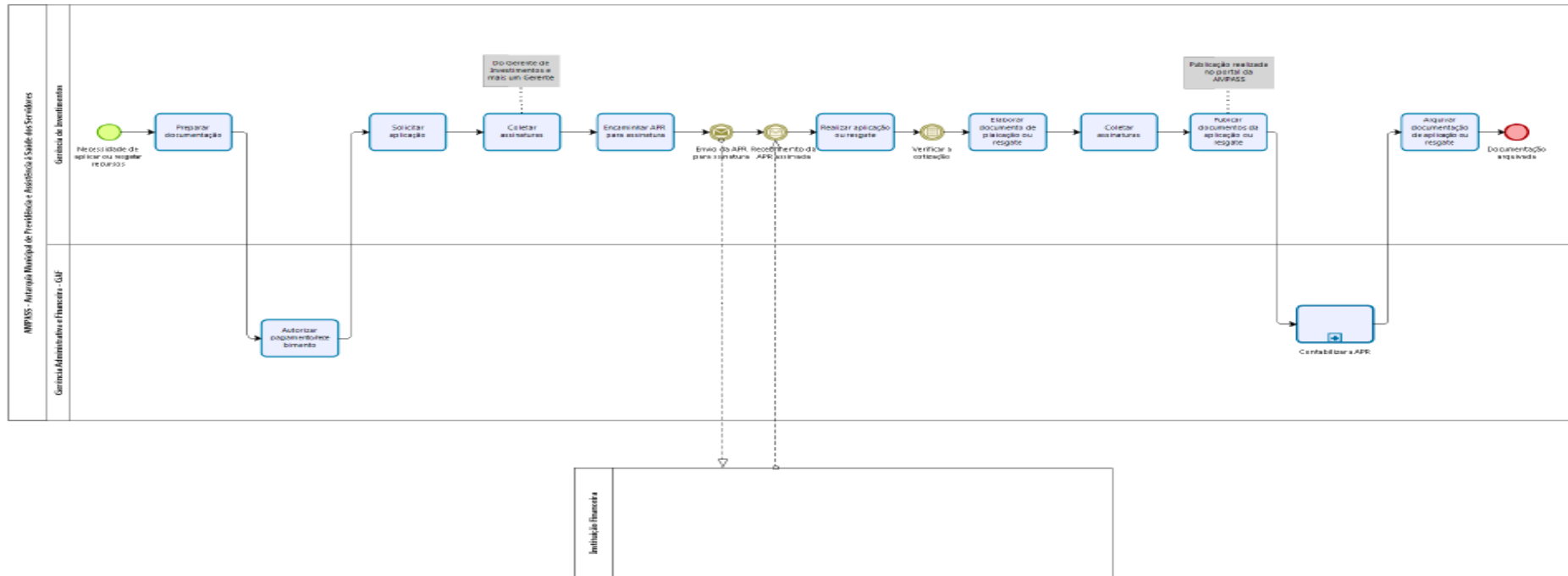
Ativo: OCEANO DOURADO
Unidade: LI
Descrição: Processo interno de análise de risco dos Fundos de Investimentos da carteira de Previdência Equiperam



APR

Aplicação e Resgate de Recursos - APR

Autor: gisela@couraio.br
Versão: 3.0
Descrição: Processo de aplicação e resgate de recursos financeiros na ANPASS em fundos de Investimentos.



MP01.P012.Análise de riscos da carteira de investimentos

Autor: Gustavo Dourado
Versão: 1.0
Descrição: Procedimento de análise de risco dos fundos de investimentos da carteira da Recipiv e Reciprev.

