



**RECIFE**  
PREFEITURA DA CIDADE



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

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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>  Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 Valor: R\$ 80.000.000,00 Oitenta milhões de reais	<b>Nº / ANO:</b>	051 /2017 - GI
	<b>OF. Nº:</b>	051 /2017 - GI
	<b>Data:</b>	08/05/17
		<b>Dispositivo da Resolução do CMN</b>
		FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"

**HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:**

<b>Fundo:</b>	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	11.060.913/0001-10		
<b>Segmento:</b>	Renda Fixa		
<b>Tipo de Ativo:</b>	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Resgate		
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 80.000.000,00		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	35.421.410,73738080		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,25852100		
<b>Data da Operação:</b>	08/05/2017		
<b>Data de Liquidação:</b>	08/05/2017		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 5.935.298.000,00		
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	1,347868%		
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
<b>Administrador:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	06/12/2016		
<b>Gestor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	06/12/2016		
<b>Distribuidor:</b>	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	00.360.305/0001-04		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	06/12/2016		
<b>Data de Início FI:</b>	28/05/2010		
<b>Taxa Administração do FI (%):</b>	0,20		
<b>Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:</b>	Dispensado		



Índice de Referência do FI :	IMA-B 5	
Tx Performance do FI (%):	Não possui	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	0	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Cód. Negociação Bolsa:	Sem código	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:		
Segmento:	X-X-X-X-X-X-X	
Tipo de Ativo:	X-X-X-X-X-X-X	
% Carteira do Fundo:	X-X-X-X-X-X-X	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice do Índice de Mercado ANBIMA - série B 5 - IMA-B 5, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. O prazo médio da carteira do FUNDO será superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias. É vedada ao FUNDO a aplicação de recursos em cotas de fundos de investimento, de qualquer modalidade.
	Principais riscos do fundo:	O cotista está sujeito aos seguintes riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO aplica seus recursos: Risco de mercado: variação dos preços e cotações de mercado dos ativos que compõem a carteira do FUNDO e os demais riscos constantes do regulamento do fundo. (Risco: 3)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	26/04/2017
Outras Observações:		
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	
CNPJ do Fundo:	10.740.670/0001-06	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	



Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 80.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	38.319.883,85243200		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,08768900		
Data da Operação:	08/05/2017		
Data de Liquidação:	08/05/2017		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 12.124.915.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,659798%		
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	06/12/2016		
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	06/12/2016		
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	06/12/2016		
Data de Início FI:	28/05/2010		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado		
Índice de Referência do FI:	IRFM-1		
Tx Performance do FI (%):	Não possui		
Tx Performance (máx. de ret. que o investidor se a tx performance será cobrada ou não):	Não possui		
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado		
Carência (dias):	0		
Data Listagem Bolsa:	Não listado		
Resgate (dias):	0		
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui		
Cód. Negociação Bolsa:	Sem código		
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL		
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	Não		
CNPJ do Fundo:	x-x-x-x-x-x-x		
Segmento:	x-x-x-x-x-x-x		
Tipo de Ativo:	x-x-x-x-x-x-x		
% Carteira do Fundo:	x-x-x-x-x-x-x		
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos		
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Renda Fixa de Mercado 1 - IRF-M 1, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.	
	Principais riscos do fundo:	O Cotista está sujeito aos riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO aplica seus recursos. Existe a possibilidade de ocorrer redução da rentabilidade ou mesmo perda do capital investido no FUNDO, em decorrência dos riscos constantes no regulamento do fundo. (Risco: 2)	
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Baixo	
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate		



Análise / Parecer do Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	26/04/2017
Outras Observações:		
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)		
<p><b>PROponente:</b>  <b>Andreson Carlos Gomes de Oliveira</b>  Chefe de Divisão de Investimentos  CPF: 052.430.264-25  Entidade Certificadora: ANBIMA  Validade da Certificação: 04/02/2018</p>	<p><b>GESTOR/AUTORIZADOR CERTIFICAÇÃO/VALIDADE</b>  <b>José Marcos Alves de Barros</b>  Gerente de Investimentos  CPF: 334.326.354-00  Entidade Certificadora: ANBIMA  Validade da Certificação: 03/05/2019</p>	<p><b>RESPONSÁVEL PELA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO:</b>  <b>Márcio Araújo Acioli</b>  Gerente Administrativo e Financeiro  CPF: 111.494.264-20</p>



Recife, 08 de maio de 2017

**Ofício RECIPREV nº 051/2017 – GI**

Senhora Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 80.000.000,00 (Oitenta milhões de reais), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIZA LONGO PRAZO CNPJ: 11.060.913/0001-10; e aplicar o mesmo valo no FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 10.740.670/0001-06; vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 051/2017

Atenciosamente,

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

  
**MÁRCIO ARAÚJO ACIOLI**  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilma Senhora  
**CARLA DE AZEVEDO M DA FONSECA**  
Gerente de Atendimento PJ - Público  
**Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo**  
NESTA

**RECEBIDO**  
EM 09/05/17

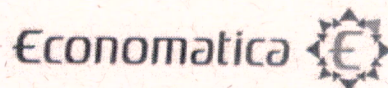
VALDENIA CARNEIRO DOS SANTOS  
Gerente de Atendimento PJ Priv/Pub SE  
Matr. 120.864-3  
Ag. Cais do Apolo/PE  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

*em subst. ao ofício  
realizado em 08.05.17*





# FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP



## Características

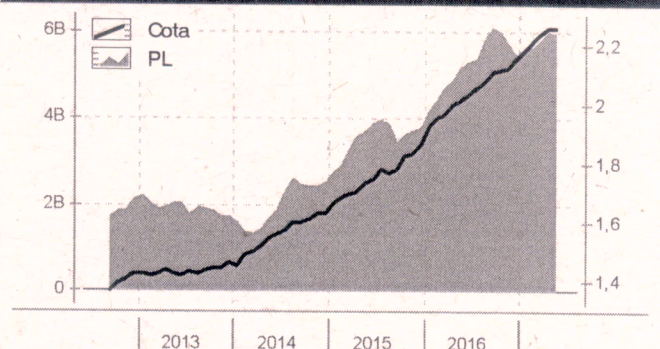
CNPJ	11060913000110
Início do Fundo	09/07/2010
Código Anbima	251496
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	Caixa
Custodiante	Caixa Economica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-

## Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	1.000
Aplicação adicional mínima	0
Resgate mínimo	0
Saldo mínimo	0
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+000
Prazo pgto resgate	D+000
Benchmark	IMA-B 5

Data da Última Cotação	08/05/2017
Cota	2,2585
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	5.935.298
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	5.716.135
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

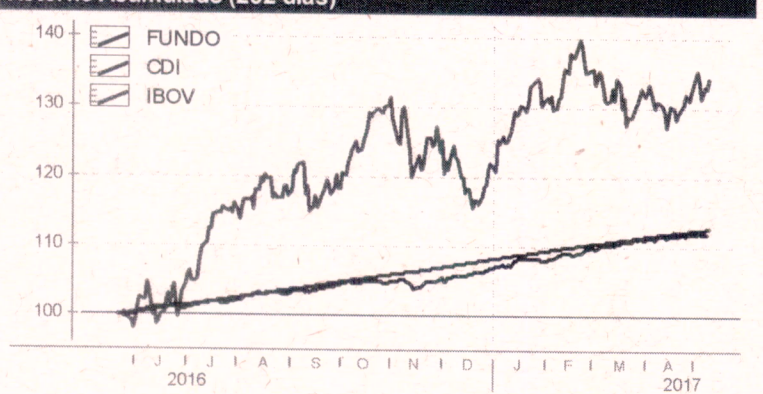
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



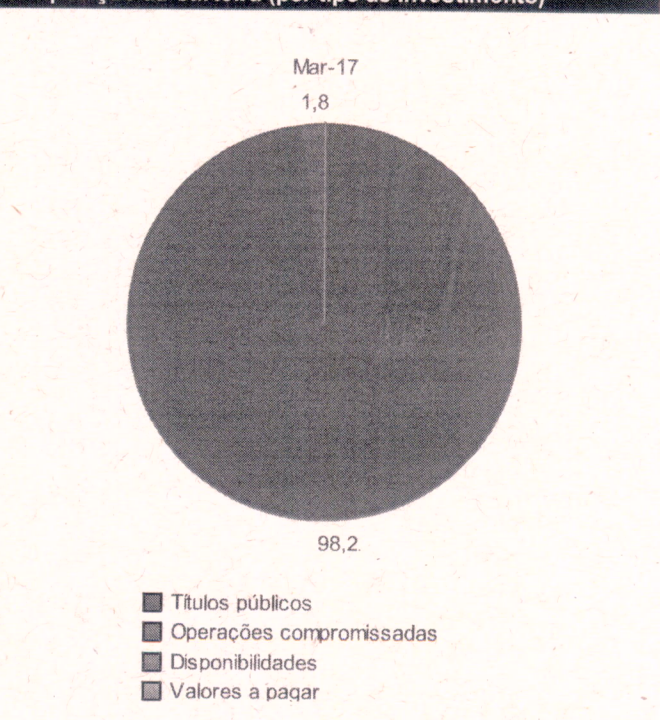
## Retornos (%) (até 08/05/2017)

	dez 2016	jan 2017	fev 2017	mar 2017	abr 2017	mai 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,38	1,14	1,48	1,38	0,70	0,06	14,86	15,19	4,83	12,60	31,95	47,97	125,85
● CDI	1,12	1,08	0,86	1,05	0,79	0,21	13,24	14,00	4,06	13,39	29,11	43,89	104,23
● IBOV	-2,71	7,38	3,08	-2,52	0,64	0,19	-13,31	38,94	8,80	26,70	14,66	22,66	3,23

## Retorno Acumulado (252 dias)



## Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



## Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	1,48
Menor Retorno Mensal (%)	0,06
Retorno Acumulado (%)	12,60
Volatilidade	2,05
Sharpe	-0,34
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,97

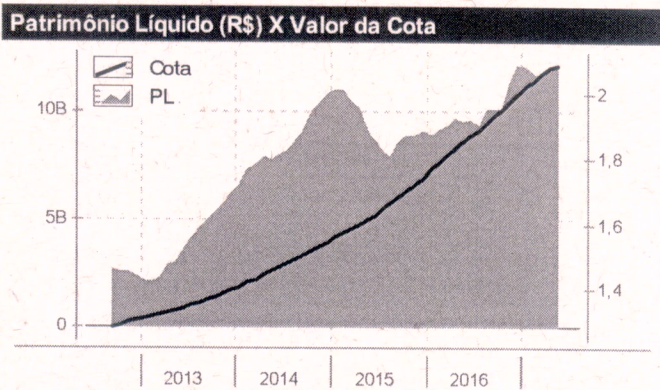
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economática é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.



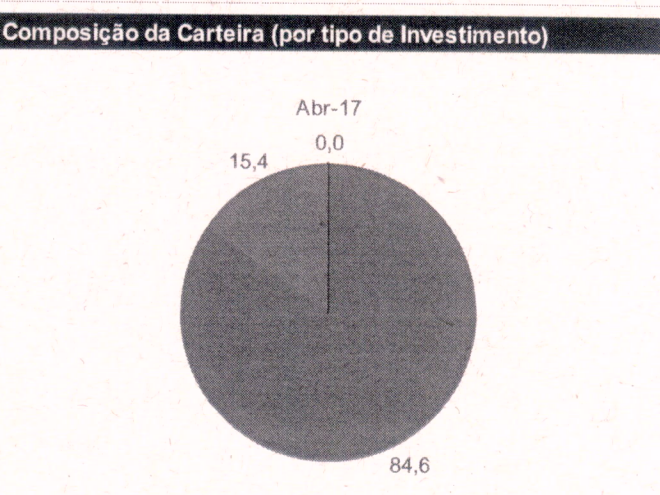
# FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF

Características	
CNPJ	10740670000106
Início do Fundo	28/05/2010
Código Anbima	248975
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	Caixa
Custodiante	Caixa Economica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	08/05/2017
Cota	2,0877
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	12.124.915
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	11.025.267
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

Condições de Investimentos	
Aplicação inicial mínima	1.000
Aplicação adicional mínima	0
Resgate mínimo	0
Saldo mínimo	0
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+000
Prazo pgto resgate	D+000
Benchmark	IRF-M 1



Retornos (%) (até 08/05/2017)													
	dez 2016	jan 2017	fev 2017	mar 2017	abr 2017	mai 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,18	1,26	0,99	1,11	0,86	0,22	12,76	14,58	4,53	13,65	30,15	44,28	108,77
● CDI	1,12	1,08	0,86	1,05	0,79	0,21	13,24	14,00	4,06	13,39	29,11	43,89	106,47
● IBOV	-2,71	7,38	3,08	-2,52	0,64	0,19	-13,31	38,94	8,80	26,70	14,66	22,66	5,78



**Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)**

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	1,26
Menor Retorno Mensal (%)	0,22
Retorno Acumulado (%)	13,65
Volatilidade	0,29
Sharpe	0,72
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,14

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economática é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.