



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



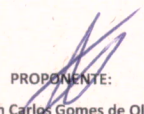
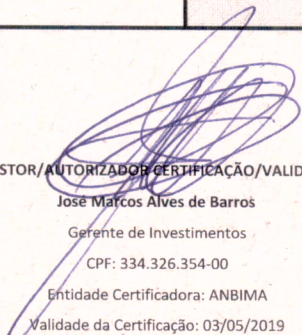
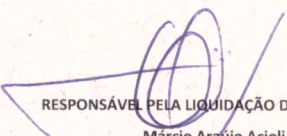
PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

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

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13	Nº / ANO:	052 /2017 - GI
	OF. Nº:	052 /2017 - GI
	Data:	08/05/17
Valor:	Dispositivo da Resolução do CMN	
R\$ 13.036.005,90	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	
Treze milhões, trinta e seis mil, cinco reais e noventa centavos		

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA		
CNPJ do Fundo:	17.517.577/0001-78		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 13.036.005,90		
Quantidade de Cotas:	8.161.875,73042682		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,59718260		
Data da Operação:	08/05/2017		
Data de Liquidação:	09/05/2017		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 119.404.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	10,917562%		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA		
CNPJ do Administrador:	07.437.241/0001-41		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	22/11/2016		
Gestor:	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA		
CNPJ do Gestor:	07.437.241/0001-41		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	22/11/2016		
Distribuidor:	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA		
CNPJ do Distribuidor:	07.437.241/0001-41		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	22/11/2016		
Data de Início FI:	27/08/2013		
Taxa Administração do FI (%):	0,40		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	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):	1	
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	
Segmento:	x-x-x-x-x-x	
Tipo de Ativo:	x-x-x-x-x-x	
% Carteira do Fundo:	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 FUNDO busca atingir o seu objetivo por meio da aplicação de parte relevante de seus recursos em títulos atrelados a índices de preços, além de posicionamentos ativos nas curvas de juros prefixados e de juros reais.
	Principais riscos do fundo:	Taxa de Juros e demais riscos constantes do regulamento (Risco: 3,0)
	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:	Resgate total do fundo	
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)		
PROponente:  Anderson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF: 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 04/02/2018	GESTOR/AUTORIZADOR/CERTIFICAÇÃO/VALIDADE  José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019	RESPONSÁVEL PELA LIQUIDACÃO DA OPERAÇÃO:  Márcio Araújo Acioli Gerente Administrativo e Financeiro CPF: 111.494.264-20

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 08 de maio de 2017

Ofício RECI-REV nº 052/2017 – GI

Prezados (as) Senhores (as),


Solicitamos efetuar o resgate total em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECI-REV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; do fundo **WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CNPJ: 17.517.577/0001-78**.

Na oportunidade, solicitamos o encaminhamento de TED com os dados a seguir:

Banco: Banco do Brasil S.A (001)
Agência: 3234-4
Conta: 7.909-X
Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev


Justificativa da aplicação ou resgate: APR 052/2017

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
Gerente Administrativo e Financeiro

Prezados (as) Senhores (as)
Elder Andrade
Western Asset Management Company DTVM Ltda
São Paulo - SP

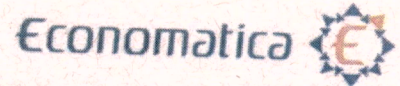
*Encaminhado por
euif au
08/05/2017*

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
Gerente de Investimentos
Autarquia Municipal de Previdência
e Assistência à Saúde dos Servidores - Recife



**PREFEITURA DO
RECIFE**

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife
Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000, Boa Vista, Recife - PE
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647

Wa Imab5 Ativo FI RF



Características

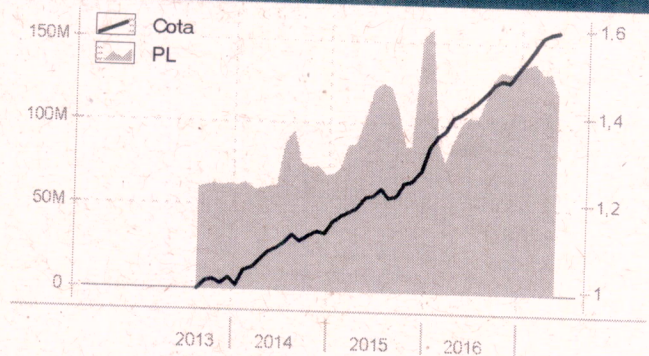
CNPJ	17517577000178
Início do Fundo	27/08/2013
Código Anbima	348430
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Livre Soberano
Gestão	Western Asset
Custodiante	Citibank Dtm SA
Administrador	Western Asset
Taxa máx. adm. (%)	0,40
Taxa performance	-

Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	25.000
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+001
Benchmark	IMA-B 5+

Data da Última Cotação	09/05/2017
Cota	1,5972
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	119.404
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	125.416
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

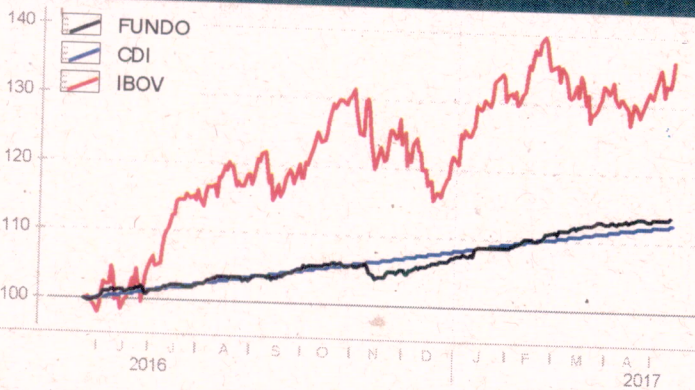
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



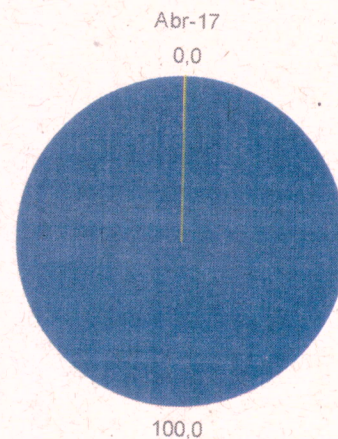
Retornos (%) (até 09/05/2017)

	dez 2016	jan 2017	fev 2017	mar 2017	abr 2017	mai 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,73	1,52	2,10	1,58	0,65	0,18	13,32	18,27	6,17	14,24	34,38	50,22	59,72
● CDI	1,12	1,08	0,86	1,05	0,79	0,25	13,24	14,00	4,10	13,38	29,17	43,90	53,57
● IBOV	-2,71	7,38	3,08	-2,52	0,64	1,34	-13,31	38,94	10,05	29,98	15,97	24,82	32,31

Retorno Acumulado (252 dias)



Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



- Títulos públicos
- Merc Futuro - posic compr
- Valores a receber
- Disponibilidades
- Merc Futuro - posic vend
- Valores a pagar

Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	11
Meses Negativos	1
Maior Retorno Mensal (%)	2,10
Menor Retorno Mensal (%)	-0,35
Retorno Acumulado (%)	14,24
Volatilidade	3,18
Sharpe	0,25
VAR de 1 mês - 95% (%)	1,51

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 investir 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.