



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 Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170,
DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO: 09 /2014
Unidade Gestora do RPPS: Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13	OF. Nº: 09/2014 – GI
	Data: 30/01/2014
VALOR (R\$): R\$ 15.000.000,00 (Quinze milhões de reais)	Dispositivo da Resolução do CMN: Art. 7º, I “b”

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO

Descrição da operação: A aplicação no valor total de R\$ 15.000.000,00 (Quinze milhões de reais) foi realizada no Fundo de Investimento Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos Renda Fixa CNPJ: 18.598.288/0001-03. Referida aplicação foi definida na reunião do Comitê de Investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev realizada no dia 29.01.2014.

Têm como origem o resgate de R\$ 15.000.000,00 (Quinze milhões de reais) do fundo FI Caixa Brasil IMA B5 TP RF LP, CNPJ 11.060.913/0001-10, da Caixa Econômica Federal.

O Fundo de Investimento Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos Renda Fixa CNPJ: 18.598.288/0001-03, está aderente à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev e encontra-se credenciado. Trata-se de uma boa oportunidade para a carteira de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev dentro do processo de diversificação e rentabilização no longo prazo previsto na Política de Investimentos.

O retorno esperado do Fundo de Investimento Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos Renda Fixa está projetado em IPCA+6% ao ano. O fundo está aderente à meta atuarial do Fundo Previdenciário Reciprev que atualmente é de IPCA+6% ao ano.

Por tratar-se de um fundo de longo prazo o Fundo de Investimento Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos Renda Fixa CNPJ: 18.598.288/0001-03, está sujeito ao Atestado de Compatibilidade de Aplicações de Recursos previsto na Portaria Nº 440, de 09 de outubro de 2013, Art. 3º IX § 4º. Referido atestado de compatibilidade encontra-se como anexo desta APR. O fundo terá como composição inicial Títulos do Governo Federal: NTN-B do leilão de 30.01.2014, com vencimento único para 16.08.2024. Deste modo, a carência ocorrerá até 16.08.2024. Haverá amortização dos ativos (cupons) nos meses de fevereiro e agosto de cada ano, através de crédito na conta corrente do Fundo Previdenciário Reciprev.

O Fundo de Investimento Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos Renda Fixa CNPJ: 18.598.288/0001-03, é do segmento de renda fixa e está enquadrado na Resolução do CMN 3.922 de 25.11.2010, no Art. 7º, I “b”.

O Fundo de Investimento Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos Renda Fixa CNPJ: 18.598.288/0001-03, têm como gestor e administrador a Caixa Econômica Federal CNPJ: 00.360.305/0001-04, que ocupa a 4ª posição no ranking ANBIMA (posição ANBIMA de dezembro/2013, com mais de 500 gestores), efetuando a gestão de recursos de mais de 172,6 bilhões de reais.

Anexo: - Ofício de resgate e aplicação

- Atestados de Compatibilidade de Aplicações de Recursos
- Ranking ANBIMA
- Posição do Mercado Secundário da ANBIMA para as NTN-B de 29.01.2014

CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Renda Fixa - Art. 7º, I "b"

Instituição Financeira: Caixa Econômica Federal

CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04,

Fundo: Fundo de Investimento Caixa Brasil 2024 Públicos Público Renda Fixa

CNPJ do Fundo: 15.598.288/0001-03

Índice de Referência: IPCA+6% ao ano

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 140.000.000,00 (O fundo deverá fechar com o Patrimônio Líquido de R\$ 140.000.000,00, informação da CEF)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 10,71 % (R\$ 15.000.000,00/R\$ 140.000.000,00)



PROFONINTELE

Daniel Cruz Magalhães

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 071.848.554-85

Entidade Certificadora: ANBIMA

Validade da Certificação: 05/09/2015

GESTOR/AUTORIZADOR CERTIFICAÇÃO/VALIDADE

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

Validade da Certificação: 15/04/2016

RESPONSÁVEL PELA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO:

Francisco Canindé Antunes Furtado Junior

Diretor Executivo

CPF: 416.004.444-15

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 30 de janeiro de 2014


Ofício RECIprev nº 09/2014 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 15.000.000,00 (quinze milhões de reais) do fundo FI Caixa Brasil IMA B5 TP RF LP, CNPJ 11.060.913/0001-10, vinculados à conta 4-5, e aplicar o valor de R\$ 15.000.000,00 (quinze milhões de reais) no Fundo de Investimento Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos Renda Fixa CNPJ: 18.598.288/0001-03, também vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação: APR 09/2014

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JUNIOR
DIRETOR EXECUTIVO

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

RECEBIDO
EM 30 01 14
CARLA DE AZEVEDO MARQUES DA FONSECA
Gerente Atendimento PJ - P
Matr 0743427
Ag Cais do Apolo
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL


**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

PORTARIA MPS Nº 440, DE 09 DE OUTUBRO DE 2013 - DOU DE 11/10/2013

"Art. 3º IX § 4º As aplicações que apresentem prazos para desinvestimento, inclusive prazos de carência e para conversão de cotas de fundos de investimentos, deverão ser precedidas de atestado do responsável legal pelo RPPS, evidenciando a sua compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do regime.

ATESTADO DE COMPATIBILIDADE DE APLICAÇÕES DE RECURSOS

Com base na Portaria MPS Nº 440, de 09 de outubro de 2013, Art. 3º IX § 4º, apresentamos as projeções de despesas, receitas e saldos do Fundo Previdenciário Reciprev até o ano 2029, decorrentes do Estudo Atuarial realizado pela Caixa Econômica Federal em dezembro/2012.

Ano	Qtde. Aposentadorias e Pensões	Despesas Anual	Receitas Anual	SalDOS Anual
2013	105	4.147.722,21	94.450.517,51	753.463.837,59
2014	208	7.447.593,90	106.949.581,13	898.173.655,08
2015	335	11.278.350,31	121.342.080,49	1.062.127.804,56
2016	415	13.813.038,94	129.549.004,24	1.241.591.438,13
2017	488	16.582.768,46	134.197.081,97	1.433.701.237,93
2018	565	19.332.173,50	138.868.378,57	1.639.259.517,28
2019	639	21.842.215,88	144.382.548,40	1.860.155.420,83
2020	733	25.350.677,13	148.539.877,43	2.094.953.948,38
2021	855	30.801.192,67	152.156.612,90	2.342.006.603,40
2022	1.018	36.820.152,97	155.667.714,12	2.601.374.560,75
2023	1.215	44.481.316,29	158.822.232,61	2.871.797.950,72
2024	1.529	56.175.458,41	161.713.525,32	3.149.643.894,67
2025	2.120	78.780.163,07	164.035.109,76	3.423.877.475,04
2026	2.580	95.897.616,24	166.371.067,42	3.699.783.574,72
2027	3.018	113.134.417,44	168.438.755,25	3.977.074.927,01
2028	3.413	126.992.298,04	170.513.938,75	4.259.221.063,35
2029	4.618	159.590.213,92	172.235.686,39	4.527.419.799,62

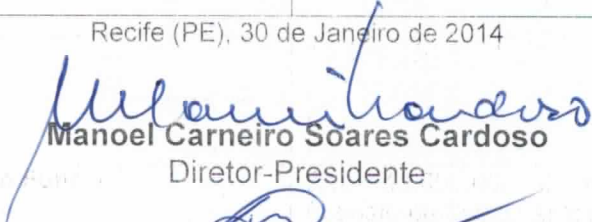
Estudo Atuarial 2012 - realizado pela CEF (Base Dezembro-2012)


Deste modo, as receitas anuais são suficientes para cobrir as despesas anuais no mínimo até o ano de 2029, justificando a realização da aplicação no ativo a seguir por estar compatível com as obrigações presentes e futuras do Fundo Previdenciário Reciprev.



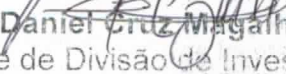
CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS	
Valor da aplicação	R\$ 15.000.000,00 (Quinze milhões de reais)
Segmento	Renda Fixa
Tipo de Ativo	Renda Fixa - Art 7º, I "b"
Instituição Financeira	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ da Instituição Financeira	00.360.305/0001-04
Fundo	Fundo de Investimento Caixa Brasil 2024 Públicos Público Renda Fixa
CNPJ do Fundo	15.598.288/0001-03
Índice de Referência	IPCA + 6% ao ano
Patrimônio Líquido do Fundo	R\$ 140.000.000,00 em 29.01.2014 (PL Previsto de fechamento)
% do Patrimônio Líquido do Fundo	10,71 % (R\$ 15.000.000,00 /R\$ 140.000.000,00)
% da Aplicação – Política de Investimento Art 7º, I, "b"	A soma de todas as aplicações neste artigo encontra-se enquadrada e abaixo dos 27% previsto na Política de Investimento
Prazo da aplicação	Carência dos Títulos: NTN-B até 16.08.2024. Amortização dos ativos (cupons) nos meses de fevereiro e agosto de cada ano.
Justificativas da aplicação	APR N° 09 /2014

Recife (PE), 30 de Janeiro de 2014


Manoel Carneiro Soares Cardoso
Diretor-Presidente


Francisco Canindé Antunes F Junior
Diretor Executivo


José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos


Daniel Cruz Magalhães
Chefe de Divisão de Investimentos

Ranking de Gestão de Fundos de Investimento

Distribuição do PL e Captação Líquida



Instituições Financeiras e Assets

Dez/2013

Patrimônio Líquido (R\$)

Ordem	Gestor	Total
1	BB DTYM S A	478.552,8
2	ITALU UNIBANCO SA	358.755,3
3	BRADESCO	305.278,3
4	CAIXA	172.563,3
5	BTG PACTUAL	135.043,5
6	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	123.755,7
7	HSEC	87.143,0
8	CREDIT SUISSE HEDGING-GRIFFO COOR VAL S A	55.195,7
9	J SAFRA ASSET MANAGEMENT	38.398,9
10	VOTORANTIM ASSET	34.872,2
11	LEGG MASON / WESTERN ASSET	26.225,7
12	BNY MELLON ARX INVESTIMENTOS LTDA	24.028,1
13	BNP PARIBAS	21.959,3
14	OPPORTUNITY	19.993,8
15	JP MORGAN	19.817,8
16	VINCI PARTNERS	16.680,2
17	CITIBANK	16.679,5
18	SUL AMERICA INVESTIMENTOS	15.712,3
19	INTRAG	15.538,4
20	BRL DTYM	15.002,4
21	QUANTITAS ASSET MANAGEMENT	10.314,9
22	MORGAN STANLEY	10.172,7
23	BW GESTAO DE INVESTIMENTO LTDA	9.794,3
24	GFS PLANEJAMENTO FINANCEIRO SA	9.233,6
25	JGP LTDA	8.872,7
26	ICATU VANGUARDA	8.740,5
27	SPX	8.292,3
28	PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	7.929,4
29	PATRIA INVESTIMENTOS	7.810,9
30	GAVEA INVESTIMENTOS LTDA	7.494,8
31	INTEGRAL INVESTIMENTOS	7.186,1
32	BANRISUL	6.622,8
33	BRASIL PLURAL GESTAO DE RECURSOS LTDA	6.587,9
34	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	5.548,4
35	MAPFRE DTYM SA	5.448,7
36	OLIVEIRA TRUST DTYM	5.224,7
37	ALFA	5.153,6
38	CREDIT SUISSE	4.779,5
39	FRAGMA	4.674,3
40	BNB	4.414,5
41	DYNAMO ADMINISTRACAO DE RECURSOS LTDA	4.341,1
42	KINEA INVESTIMENTO LTDA	4.118,1
43	KONDOR INVEST	4.035,6
44	PLANNER	3.979,8
45	MODAL	3.854,5
46	MERRILL LYNCH	3.774,5
47	PETRA ASSET GESTAO DE INVESTIMENTOS LTDA	3.725,5
48	BANCO GERACAO FUTURO DE INVESTIMENTO	3.693,4
49	SOLIDUS ADMINISTRADORA DE PATRIMONIO LTD	3.681,7
50	EVEREST	3.648,3
51	RELANCE ASSET	3.628,6
52	GAP PRUDENTIAL LT GESTAO DE REC LTDA	3.400,8
53	GAP GESTORA DE RECURSOS LTDA	3.340,4
54	CONSENSO INVESTIMENTOS LTDA	3.314,7
55	IBIUNA INVESTIMENTOS LTDA	3.314,4
56	GLOBAL EQUITY/GLOBAL CAPITAL	3.297,8



Mercado Secundário de Títulos Públicos

Títulos Públicos Federais										28/Jan/2014
Papel IPCA		NTN-B - Taxa (% a.a.)/252								
Código SELIC	Data Base/Emissão	Data de Vencimento	Tx. Máxima	Tx. Mínima	Tx. Indicativas	PU	Intervalo Indicativo			
							Mínimo (D0)	Máximo (D0)	Mínimo (D+1)	Máximo (D+1)
760199	15/07/2000	15/08/2014	--	4,5000	4,6350	2.449,479035	4,1119	4,9066	4,1923	4,9917
760199	15/07/2000	15/05/2015	5,1900	4,9700	5,1574	2.422,089432	4,6705	5,4866	4,7485	5,5638
760199	15/07/2000	15/08/2016	6,2500	6,0700	6,2002	2.422,485044	5,7067	6,5406	5,7688	6,6031
760199	15/07/2000	15/05/2017	6,4400	6,2700	6,3864	2.373,512093	5,9106	6,6716	5,9931	6,7545
760199	15/07/2000	15/08/2018	6,7000	6,5200	6,6528	2.376,487473	6,2400	6,8953	6,3131	6,9685
760199	15/07/2000	15/05/2019	6,7825	6,6200	6,7500	2.325,567259	6,3503	6,9998	6,4232	7,0727
760199	15/07/2000	15/08/2020	6,8925	6,6900	6,8512	2.332,982019	6,4713	7,1030	6,5463	7,1781
760199	15/07/2000	15/08/2022	6,9341	6,7600	6,8900	2.305,248921	6,5487	7,1417	6,6223	7,2154
760100	15/07/2000	15/03/2023	6,9462	--	6,9087	2.284,764758	6,5683	7,1457	6,6511	7,2287
760199	15/07/2000	15/05/2023	6,9364	--	6,9089	2.260,229719	6,5785	7,1508	6,6536	7,2261
760199	15/07/2000	15/08/2024	6,9900	6,7800	6,9495	2.274,864987	6,6017	7,1854	6,6915	7,2751
760199	15/07/2000	15/08/2030	7,0512	--	7,0193	2.209,302399	6,6661	7,2514	6,7631	7,3478
760199	15/07/2000	15/05/2035	7,0825	--	7,0431	2.139,061168	6,6715	7,2745	6,7696	7,3721
760199	15/07/2000	15/08/2040	--	--	7,0576	2.145,717870	6,6900	7,2970	6,7803	7,3867
760199	15/07/2000	15/05/2045	7,1062	--	7,0665	2.093,321811	6,6994	7,3081	6,7873	7,3953
760199	15/07/2000	15/08/2050	7,1081	6,9400	7,0779	2.112,519643	6,7181	7,3279	6,7974	7,4065

Quando uma taxa for interpolada será apresentada em negrito.

Os preços unitários são calculados a partir da projeção para o IPCA apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA

para o mês, à exceção do período entre o dia de divulgação do IPCA final e o dia 15 do mês corrente, caso em que é utilizado o próprio índice do mês anterior, divulgado pelo IBGE.

Projeção IPCA para Janeiro:

Média apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA: 0,64%

LTN | NTN-C | LFT | NTN-F

m14jan28.xls - Clique aqui para obter a planilha do Mercado Secundário.

m#140128.txt - Clique aqui para obter o arquivo texto do Mercado Secundário.