



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:	097 /2017 - GI	
	OF. Nº:	097 /2017 - GI	
	Data:	11/08/17	
Valor:	Dispositivo da Resolução do CMN		
R\$ 3.161.369,65	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"		
Três milhões, cento e sessenta e um mil, trezentos e sessenta e nove reais e sessenta e cinco centavos			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA		
CNPJ do Fundo:	03.499.367/0001-90		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 3.161.369,65		
Quantidade de Cotas:	286.719,54017776		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 11,02600000		
Data da Operação:	11/08/2017		
Data de Liquidação:	11/08/2017		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.637.788.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,193027%		
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:	21/03/2000		
Taxa Administração do FI (%):	0,40		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado		

WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA
03.499.367/0001-90
Renda Fixa
FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"
Aplicação
R\$ 3.161.369,65
286.719,54017776
R\$ 11,02600000
11/08/2017
11/08/2017
R\$ 1.637.788.000,00
0,193027%
Banco do Brasil S.A. 3234-4 7.909-X
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA
07.437.241/0001-41
22/11/2016
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA
07.437.241/0001-41
22/11/2016
WESTERN ASSET MANAGEMENT - DTVM LTDA
07.437.241/0001-41
22/11/2016
21/03/2000
0,40
Dispensado

Índice de Referência do FI :	CDI	
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	
Segmento:	X-X-X-X-X	
Tipo de Ativo:	X-X-X-X-X	
% Carteira do Fundo:	X-X-X-X-X	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	Para a realização do objetivo do Fundo, o gestor buscará aumentar ou diminuir, conforme o caso, a exposição do Fundo ao mercado de taxas de juros, procurando, conforme o caso, obter ganhos adicionais ou limitar perdas para a carteira mediante o investimento em ativos financeiros com retornos prefixados, ou em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada às taxas de juros de um dia, podendo ainda investir em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação de índices de preços.
	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	25/07/2017
Outras Observações:		
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 LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO: Márcio Araújo Acioli Gerente Administrativo e Financeiro CPF: 111.494.264-20

Recife, 11 de agosto de 2017

Ofício RECIPREV nº 097/2017 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 3.161.369,65 (Três milhões, cento e sessenta e um mil, trezentos e sessenta e nove reais e sessenta e cinco centavos), no fundo **Western Asset Ativo FI Renda Fixa CNPJ: 03.499.367/0001-90**.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através do Banco do Brasil S.A., Agência 3234-4, conta corrente 7.909-X, com os dados a seguir:

Banco: CITIBANK N. 745

Agência: 001

Conta Corrente: 5643740

Favorecido: Western Asset Ativo FI Renda Fixa

CNPJ: 03.499.367/0001-90

Valor: R\$ 3.161.369,65 (Três milhões, cento e sessenta e um mil, trezentos e sessenta e nove reais e sessenta e cinco centavos)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 097/2017

Atenciosamente,

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
Gerente Administrativo e Financeiro

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

*Encaminhado para
11/08/2017*

[Assinatura]

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

Características

CNPJ	03499367000190
Início do Fundo	21/03/2000
Código Anbima	075124
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Livre Grau de I...
Gestão	Western Asset
Custodiante	Citibank Dtm SA
Administrador	Western Asset
Taxa máx. adm. (%)	0,40
Taxa performance	-

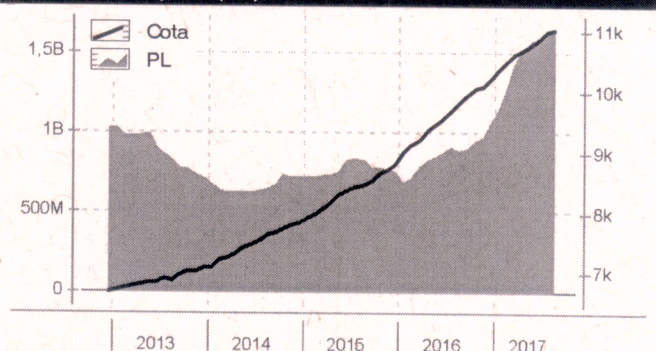
Data da Última Cotação	11/08/2017
Cota	11.026
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.637.788
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.296.536

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	25.000
Aplicação adicional mínima	100
Resgate mínimo	100
Saldo mínimo	10
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+000
Prazo pgto resgate	D+001
Benchmark	CDI

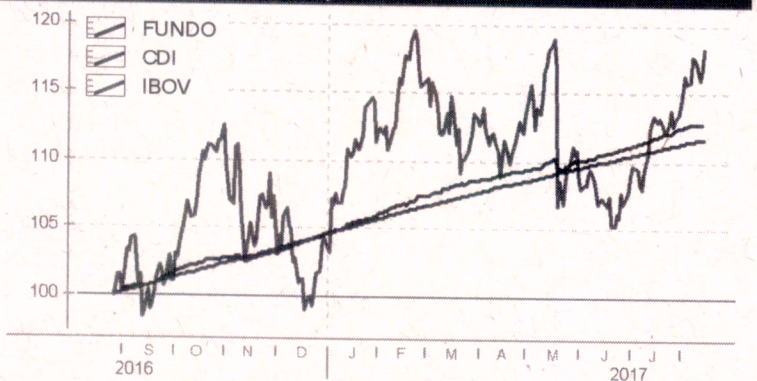
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



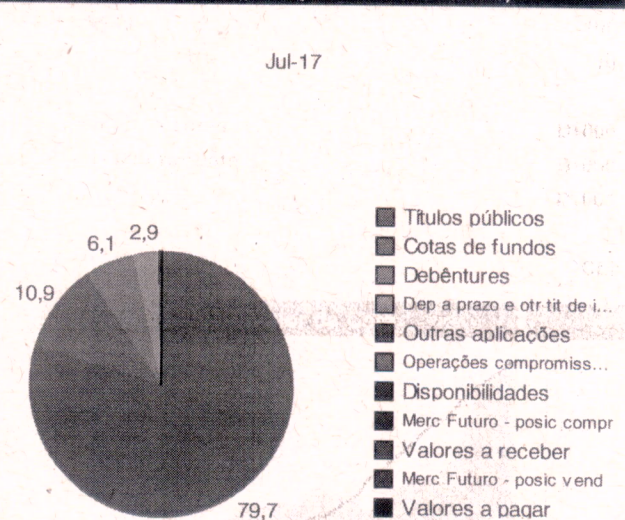
Retornos (%) (até 11/08/2017)

	mar 2017	abr 2017	mai 2017	jun 2017	jul 2017	ago 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,17	0,68	0,69	0,93	1,21	0,31	12,36	16,08	7,86	13,18	31,22	45,41	1.002,65
● CDI	1,05	0,79	0,93	0,81	0,80	0,31	13,24	14,00	6,82	12,33	28,20	43,80	836,52
● IBOV	-2,52	0,64	-4,12	0,30	4,80	2,18	-13,31	38,94	11,84	15,54	37,26	18,98	267,23

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 (%)	1,37
Menor Retorno Mensal (%)	0,31
Retorno Acumulado (%)	13,18
Volatilidade	1,42
Sharpe	0,53
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,67

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.