



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 Unidade Gestora do RPPS: Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13	Nº / ANO: 100/2015
	OF. Nº: 100 e 28A /2015 – GI
	Data: 23/07/2015
VALOR (R\$): 2.995.257,80 (Dois milhões, novecentos e noventa e cinco mil, duzentos e cinquenta e sete reais e oitenta centavos)	Dispositivo da Resolução do CMN: Art. 7º, I, "b"

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO

Descrição da operação:

Resgate total do fundo Humaitá Equity Hedge FI FIM CNPJ: 09.601.197/0001-99, no valor correspondente a R\$ 3.380.964,22 (Três milhões, trezentos e oitenta mil, novecentos e sessenta e quatro reais e vinte e dois centavos).

Pagamento da folha de APO/PPR de julho de 2015, no valor de R\$ 385.706,42 (Trezentos e oitenta e cinco mil, setecentos e seis reais e quarenta e dois centavos).

O resultado de 2.995.257,80 (Dois milhões, novecentos e noventa e cinco mil, duzentos e cinquenta e sete reais e oitenta centavos), foi aplicado no fundo BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos VII Fundo de Investimento CNPJ: 19.523.305/0001-06.

A aplicação no fundo BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos VII Fundo de Investimento CNPJ: 19.523.305/0001-0 , está aderente à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.

O fundo BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos VII Fundo de Investimento CNPJ: 19.523.305/0001-06, encontra-se credenciado pelo Fundo Previdenciário Reciprev.

Por tratar-se de um fundo de longo prazo o fundo BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos VII Fundo de Investimento CNPJ: 19.523.305/0001-06, está sujeito ao Atestado de Compatibilidade de Aplicações de Recursos previsto na Portaria Nº 440, de 09 de outubro de 201, Art. 3º IX § 4º. Referido atestado de compatibilidade encontra-se como anexo desta APR.

O prazo de retorno do fundo BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos VII Fundo de Investimento CNPJ: 19.523.305/0001-06, será 15/08/2022, com pagamento semestral de cupons de juros de meses de fevereiro e agosto de cada ano.

A aplicação e resgate acima foram definidos e autorizados na reunião do Comitê de Investimentos de 17.06.2015.

Anexos: Lâminas, Email e Atestado de Compatibilidade.

CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Renda Fixa – art. 7º, I, "b"

Instituição Financeira: BB Gestão de Recursos DTVM S.A

CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69

Fundo: BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos VII Fundo de Investimento

CNPJ do Fundo: 19.523.305/0001-06

Índice de Referência: IMA-B

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 1.333.695.626,50 (posição de 21/ 07/2015)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,22%

PROPONENTE:

Andreson 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: 13/09/2016

RESPONSÁVEL PELA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO:

Márcio Araújo Acioli

Gefente Administrativo e Financeiro

CPF: 111.494.264-20



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 das: Quantidades de Aposentadorias e Pensões; Despesas; Receitas; Resultados Previdenciários; Saldos Financeiros do Fundo Previdenciário Reciprev até o ano 2032, decorrentes do Estudo Atuarial realizado pela Caixa Econômica Federal em junho/2015.

Ano	Qtde. Aposentadorias e Pensões	Despesas Previdenciárias	Receitas Previdenciárias	Resultado Previdenciário	Saldo Financeiro do Exercício
2015	173	14.653.753,16	125.315.284,81	110.661.531,65	997.514.441,06
2016	370	22.094.567,98	141.188.734,78	119.094.166,80	1.116.608.607,86
2017	677	31.996.743,64	158.570.269,86	126.573.526,22	1.243.182.134,08
2018	802	36.336.702,67	165.392.574,17	129.055.871,50	1.372.238.005,58
2019	872	39.530.918,76	170.141.614,74	130.610.695,98	1.502.848.701,56
2020	933	41.925.194,13	172.184.095,41	130.258.901,28	1.633.107.602,84
2021	1.007	45.141.165,77	177.687.117,42	132.545.951,65	1.765.653.554,49
2022	1.095	49.122.813,76	182.864.751,94	133.741.938,18	1.899.395.492,67
2023	1.204	55.176.964,60	187.223.641,29	132.046.676,69	2.031.442.169,36
2024	1.353	61.836.741,26	191.423.149,47	129.586.408,21	2.161.028.577,57
2025	1.533	70.116.272,72	195.225.241,10	125.108.968,38	2.286.137.545,95
2026	1.815	82.167.698,31	198.705.407,77	116.537.709,46	2.402.675.255,41
2027	2.265	102.002.233,97	201.569.192,58	99.566.958,61	2.502.242.214,02
2028	2.656	118.450.832,89	204.423.104,25	85.972.271,36	2.588.214.485,38
2029	3.075	137.187.014,30	206.975.265,24	69.788.250,94	2.658.002.736,32
2030	3.463	153.072.632,93	209.542.414,53	56.469.781,60	2.714.472.517,92
2031	4.643	192.581.097,64	211.679.735,00	19.098.637,36	2.733.571.155,28
2032	5.092	211.783.369,42	213.774.884,07	1.991.514,65	2.735.562.669,93

Estudo Atuarial 2015 – Realizado pela Caixa Econômica Federal (Base de dados/Dezembro 2014)

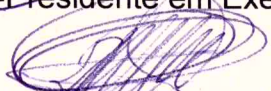
Deste modo, as receitas previdenciárias anuais são suficientes para cobrir as despesas previdenciárias anuais no mínimo até o ano de 2032, justificando-se a realização da aplicação no ativo a seguir, por estar compatível com as obrigações presentes e futuras do Fundo Previdenciário Reciprev.

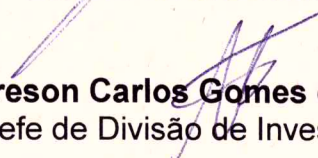


CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS	
Valor da aplicação	R\$ 2.995.257,80 (Dois milhões, novecentos e noventa e cinco mil, duzentos e cinquenta e sete reais e oitenta centavos)
Segmento	Renda Fixa
Tipo de Ativo	Renda Fixa - Art. 7º, I, "b"
Instituição Financeira/Gestor	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.
CNPJ da Instituição Financeira/Gestor	30.822.936/0001-69
Fundo	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO
CNPJ do Fundo	19.523.305/0001-06
Índice de Referência	IMA-B
Patrimônio Líquido do Fundo	R\$ 1.333.695.626,50
% do Patrimônio Líquido do Fundo	0,22% (R\$2.995.257,80/R\$ 1.333.695.626,50)
% da Aplicação – Política de Investimento Art 7º, I, "b"	A soma de todas as aplicações neste artigo, encontram-se enquadradas na Política de Investimentos e na Resolução 3.922 de 25 de novembro de 2010.
Prazo da aplicação	15/08/2022. Com pagamento semestral de CUPONS de juros nos meses de fevereiro e agosto de cada ano.
Justificativas da aplicação	APR 100/2015

Recife (PE), 23 de julho de 2015


Francisco Canindé Antunes F Junior
Diretor-Presidente em Exercício


José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos


Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Divisão de Investimentos

Recife, 23 de julho de 2015

Ofício RECIPREV nº100/2015 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 2.995.257,80 (Dois milhões, novecentos e noventa e cinco mil, duzentos e cinquenta e sete reais e oitenta centavos) , no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 19.523.305/0001-06, e também, transferir da conta 7.909-X, para a conta 10.156-7, para pagamento da folha APO/PPR de julho de 2015, o valor de R\$ 385.706,42 (Trezentos e oitenta e cinco mil, setecentos e seis reais e quarenta e dois centavos).

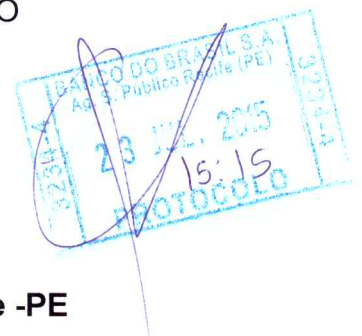
Justificativa da aplicação: APR 100/2015

Atenciosamente,

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilmo Senhor
PEDRO PAULO
Gerente de Relacionamento
Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE
NESTA



Recife, 14 de julho de 2015

Ofício RECIPREV nº 28A/2015 – GI

Prezados Senhores,

Solicitamos efetuar o resgate total do fundo HUMAITÁ EQUITY HEDGE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO 09.601.197/0001-99.

Na oportunidade, solicitamos efetuar TED para :

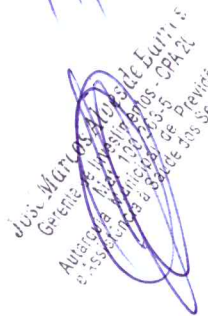
Banco: Banco do Brasil S.A.
Agência: 3234-4
Conta: 7.909-X
Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev
CNPJ: 07.749.668/0001-85

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

*Transmitido por
e-mail em
14/07/2015*


Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev

Ilma Senhora
FREDERICO BERNARDO MESNIK e ARTHUR MEIER MESNIK
HUMAITÁ INVESTIMENTOS LTDA
São Paulo - SP

VALDSON FERREIRA DA SILVA
<valdson@recife.pe.gov.br>

09:10 h
23/07/2015

para mim

Zé, Boa dia!

Vimos solicitar o resgate de aplicações financeiras da C/C 7909-x , nesta data e que sejam transferidos para a C/C **10156-7**, da folha de pagamento de APO/PPR do mês de julho/2015 no valor de R\$ 385.706.42 do Fundo Previdenciário Reciprev.

Atenciosamente,

Valdson Ferreira da Silva

Gestor da Unidade Administrativa e Financeira

BB Prev RF Tit Publ VII FI

Características

Gestão:	BB DtvM S.A
Administrador:	BB DtvM S.A
Taxa máx. de adm. (%):	0,20
Taxa de performance:	-
Classificação Anbima:	Renda Fixa Índices
CNPJ	19523305000106

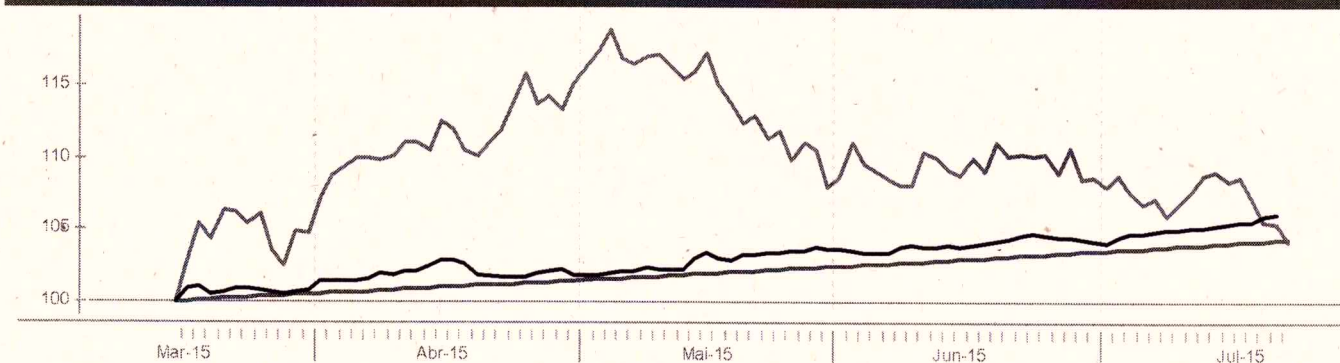
Informações Operacionais

Aplicação mínima (R\$)	300.000
Movimentação mínima (R\$)	0
Saldo mínimo (R\$)	0
Conversão de cota para aplicação:	D+000
Conversão de cota para resgate:	D+000
Disponibilidade dos recursos resgatados:	D+000

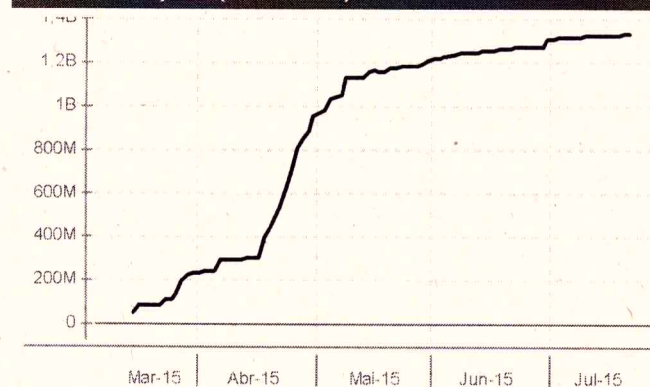
Retorno (%) (até 21/07/2015)

	Jul 2015	Jun 2015	mai 2015	abr 2015	mar 2015	fev 2015	jan 2015	dez 2014	nov 2014	out 2014	set 2014	ago 2014	2015	24m	12m	6m	1m	
● Fundo	1,79	0,57	1,86	0,95	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,72
● CDI	0,76	1,07	0,98	0,95	1,04	0,82	0,93	0,96	0,84	0,94	0,90	0,86	6,73	23,01	11,98	6,08	1,12	
● Dólar	2,54	-2,40	6,19	-6,68	11,46	8,11	0,23	3,75	4,74	-0,28	9,44	-1,23	19,77	42,25	43,06	22,51	3,33	
● Euro	0,46	-0,97	4,56	-3,02	6,76	7,24	-6,73	1,12	4,39	-1,23	5,10	-2,99	7,72	18,27	15,58	15,00	-0,37	
● Ibovespa	-3,03	0,61	-6,17	9,93	-0,84	9,97	-6,20	-8,62	0,18	0,95	-11,70	9,78	2,93	8,59	-10,69	4,57	-4,23	
● IBX	-2,42	0,76	-5,47	9,12	-0,51	9,33	-5,88	-8,26	0,31	0,95	-11,25	9,59	3,84	9,80	-9,14	5,63	-3,48	
● IGP-M	-	0,67	0,41	1,17	0,98	0,27	0,76	0,62	0,98	0,28	0,20	-0,27	-	-	-	-	-	
● Poupança	-	0,68	0,62	0,61	0,63	0,59	-	-	0,62	0,60	0,59	0,56	-	-	-	-	-	

Retorno acumulado desde o início do Fundo



Patrimônio líquido (R\$ milhões)



Histórico (até 21/07/2015)

Cota:	1,0614
Patrimônio Líquido (R\$):	1.333.695.626,50
PL Médio últimos 12 Meses (R\$)	-
Início do Fundo:	16/03/2015
Máximo Retorno Mensal desde o início:	1,86
Mínimo Retorno Mensal desde o início:	0,57
N° de Meses com Retorno Positivo desde o início:	4
N° de Meses com Retorno Negativo desde o início:	0
Retorno Acumulado desde o início:	6,14
Volatilidade desde o início:	3,83

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 avaliação da performance do fundo de Investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Econômica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só devesse ser interpretado como uma recomendação de Investimento.

Fonte: Econômica

Humaita Equity Hedge FICFI Mult

Características

Gestão:	Humaita Investimentos
Administrador:	BNY Mellon Serviços Financeiros Dtv m SA
Taxa máx. de adm. (%):	2,50
Taxa de performance:	20% que exceder 100% do CDI
Classificação Anbima:	Long And Short - Direcional
CNPJ	09601197000199

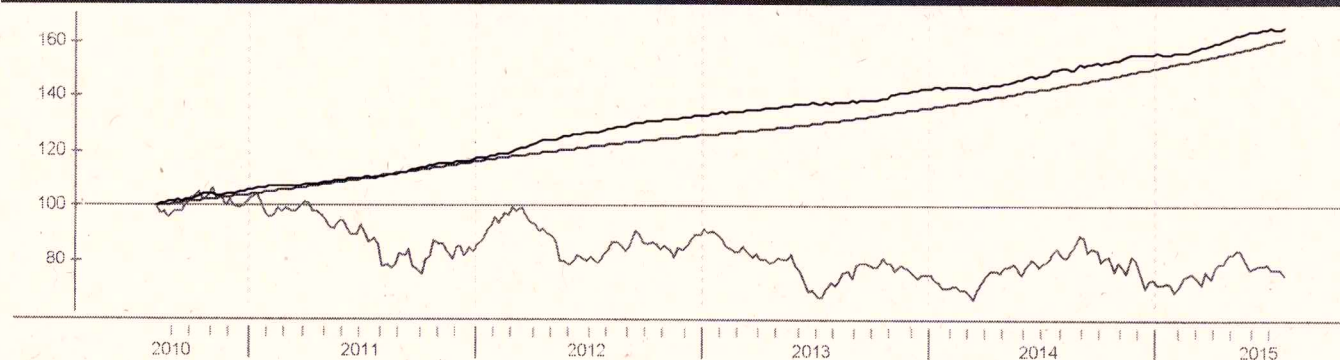
Informações Operacionais

Aplicação mínima (R\$)	5.000
Movimentação mínima (R\$)	1.000
Saldo mínimo (R\$)	0
Conversão de cota para aplicação:	D+001
Conversão de cota para resgate:	D+002
Disponibilidade dos recursos resgatados:	D+005

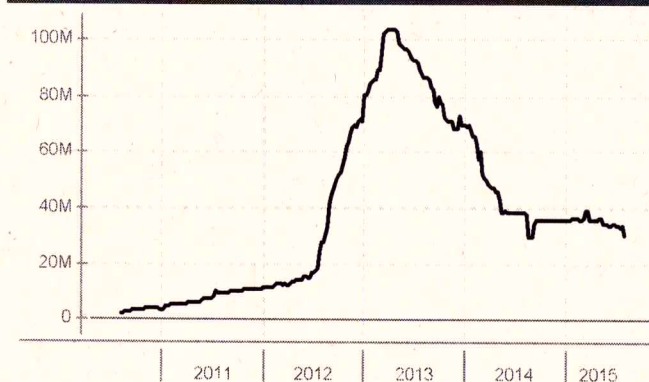
Retorno (%) (até 21/07/2015)

	jul 2015	jun 2015	mai 2015	abr 2015	mar 2015	fev 2015	jan 2015	dez 2014	nov 2014	out 2014	set 2014	ago 2014	2015	24m	12m	6m	1m
● Fundo	-0,06	0,94	1,22	1,46	1,37	0,75	0,01	0,32	1,10	1,08	0,04	1,20	5,82	19,78	9,92	5,99	0,28
● CDI	0,76	1,07	0,98	0,95	1,04	0,82	0,93	0,96	0,84	0,94	0,90	0,86	6,73	23,01	11,98	6,08	1,12
● Dólar	2,54	-2,40	6,19	-6,68	11,46	8,11	0,23	3,75	4,74	-0,28	9,44	-1,23	19,77	42,25	43,06	22,51	3,33
● Euro	0,46	-0,97	4,56	-3,02	6,76	7,24	-6,73	1,12	4,39	-1,23	5,10	-2,99	7,72	18,27	15,58	15,00	-0,37
● Ibovespa	-3,03	0,61	-6,17	9,93	-0,84	9,97	-6,20	-8,62	0,18	0,95	-11,70	9,78	2,93	8,59	-10,69	4,57	-4,23
● IBX	-2,42	0,76	-5,47	9,12	-0,51	9,33	-5,88	-8,26	0,31	0,95	-11,25	9,59	3,84	9,80	-9,14	5,63	-3,48
● IGP-M	-	0,67	0,41	1,17	0,98	0,27	0,76	0,62	0,98	0,28	0,20	-0,27	-	-	-	-	-
● Poupança	-	0,68	0,62	0,61	0,63	0,59	-	-	0,62	0,60	0,59	0,56	-	-	-	-	-

Retorno acumulado desde o início do Fundo



Patrimônio líquido (R\$ milhões)



Histórico (até 21/07/2015)

Cota:	1,6747
Patrimônio Líquido (R\$):	30.343.288,37
PL Médio últimos 12 Meses (R\$)	34.821.153,03
Início do Fundo:	05/08/2010
Máximo Retorno Mensal desde o início:	1,94
Mínimo Retorno Mensal desde o início:	-0,27
Nº de Meses com Retorno Positivo desde o início:	57
Nº de Meses com Retorno Negativo desde o início:	2
Retorno Acumulado desde o início:	65,19
Volatilidade desde o início:	1,77

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 Créditos - 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 Econômica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deve ser interpretado como uma recomendação de Investimento.

Fonte: Econômica