



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: 106/2016
	OF. Nº: 106; 36 A e 37 A/2016 – GI
	Data: 08/08/2016
VALOR (R\$): 10.600.000,00 (Dez milhões e seiscentos mil reais)	Dispositivo da Resolução do CMN: Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, I, "b"; Art. 7º, VII, "b"
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO	
<p>Descrição da operação: Resgate no valor de R\$ 10.600.000,00 (Dez milhões e seiscentos mil reais), do fundo BB Previdenciário RF Fluxo CNPJ: 13.077.415/0001-05, para ser aplicado nos seguintes fundos de investimentos:</p> <p>a) R\$ 4.600.000,00 (Quatro milhões e seiscentos mil reais), no fundo BB Previdenciário RF IMA-B 5 LP FIC FI CNPJ: 03.543.447/0001-03;</p> <p>b) R\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais), no fundo Western Asset IMA B5 Ativo FI RF CNPJ: 17.517.577/0001-78;</p> <p>c) R\$ 2.000.000,00 (Dois milhões de reais), no fundo Sul América Excellence Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado CNPJ: 04.899.128/0001-90.</p> <p>As aplicações nos fundos: BB Previdenciário RF IMA-B 5 LP FIC FI CNPJ: 03.543.447/0001-03; Western Asset IMA B5 Ativo FI RF CNPJ: 17.517.577/0001-78 e Sul América Excellence Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado CNPJ: 04.899.128/0001-90, estão aderentes à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.</p> <p>Os fundos BB Previdenciário RF IMA-B 5 LP FIC FI CNPJ: 03.543.447/0001-03, Western Asset IMA B5 Ativo FI RF CNPJ: 17.517.577/0001-78 e Sul América Excellence Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado CNPJ: 04.899.128/0001-90, encontram-se credenciados pelo Fundo Previdenciário Reciprev.</p> <p>O resgate e as aplicações acima foram definidos e autorizados na reunião do Comitê de Investimentos do dia 27.07.2016</p> <p>Anexo: Lâminas dos fundos e ofícios</p>	

CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Renda Fixa – Art. 7º, IV, "a"

Instituição Financeira: BB Gestão de Recursos DTVM S.A

CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69

Fundo: BB Previdenciário RF Fluxo

CNPJ do Fundo: 13.077.415/0001-05

Índice de Referência: CDI

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 RF IMA-B 5 LP FIC FI

CNPJ do Fundo: 03.543.447/0001-03

Índice de Referência: IMA-B 5

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 1.901.619.000,00 (posição de 04/08/2016)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,24 %

Segmento: Renda Fixa

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

Instituição Financeira: WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA

CNPJ da Instituição Financeira: : 07.437.241/0001-41

Fundo: Western Asset IMA B5 Ativo FI RF

CNPJ do Fundo: 17.517.577/0001-78

Índice de Referência: IMA B 5 Ativo

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 104.302.000,00 (posição de 04/08/2016)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 3,84%

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Renda Fixa – Art. 7º, VII, "b"

Instituição Financeira: SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.

CNPJ da Instituição Financeira: 21.813.291/0001-07

Fundo: Sul América Excellence Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado

CNPJ do Fundo: 04.899.128/0001-90

Índice de Referência: CDI

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 983.267.000,00 (posição de 04 /08/2016)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,20 %

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: 03/05/2019

RESPONSÁVEL PELA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO:

Márcio Araújo Acioli

Gerente Administrativo e Financeiro

CPF: 111.494.264-20

**SAÚDE
RECIFE**

Recife, 08 de agosto de 2016

Ofício RECIprev nº 36A/2016 – 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\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais), no fundo Western Asset IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ: 17.517.577/0001-78.

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 (745)
Agência: 0001
Conta: 34848878
Favorecido: Western Asset IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa
CNPJ: 17.517.577/0001-78
Valor: R\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 106/2016

Atenciosamente,

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
Gerente Administrativo e Financeiro

*Encaminhado por
em 08/08/2016*

[Handwritten signature]

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
Gerente de Investimentos - CPA-20
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência aos Servidores

Prezados (as) Senhores (as)
Elder Andrade/Roberto Teperman
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA
São Paulo - SP



**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

Recife, 08 de agosto de 2016

Ofício RECI PREV nº 37A/2016 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECI PREV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 2.000.000,00 (Dois milhões de reais), no fundo Sul América Excellence Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado CNPJ: 04.899.128/0001-90.

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: Itau (341)
Agência: 2001
Conta: 30630-3
Favorecido: Sul América Excellence Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado
CNPJ: 04.899.128/0001-90
Valor: R\$ 2.000.000,00 (Dois milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 106/2016

Atenciosamente,

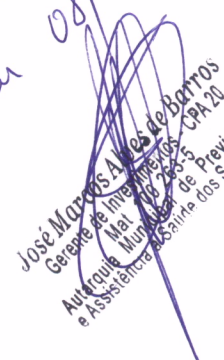

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

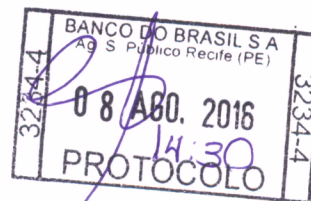

MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
Gerente Administrativo e Financeiro

Prezados (as) Senhores (as)
GIULIANA CRIVELLARO/ RUMIKO GUSHIKEN/ MARIA CAROLINA
MATTOS
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.
São Paulo - SP

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



*Em conformidade por meio
em 08/08/2016*

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife
CNPJ: 07.749.668/0001-85



Recife, 08 de agosto de 2016

Ofício RECIprev nº 106/2016 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 10.600.000,00 (Dez milhões e seiscentos mil reais), do fundo BB Previdenciário RF Fluxo CNPJ: 13.077.415/0001-05, e efetuar as seguintes operações, vinculadas à conta 7.909-X:

- a) Aplicar o valor de R\$ 4.600.000,00 (Quatro milhões e seiscentos mil reais), no fundo BB Previdenciário RF IMA-B 5 LP FIC FI CNPJ: 03.543.447/0001-03;
- b) Efetuar TEDs conforme a seguir:

Banco: Citibank (745)
Agência: 0001
Conta: 34848878
Favorecido: Western Asset IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa
CNPJ: 17.517.577/0001-78
Valor: R\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais)

Banco: Citibank (341)
Agência: 20014
Conta: 30630-3
Favorecido: Sul América Excellence Fundo de Investimento
Renda Fixa Crédito Privado
CNPJ: 04.899.128/0001-90
Valor: R\$ 2.000.000,00 (Dois milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 106/2016
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



Características

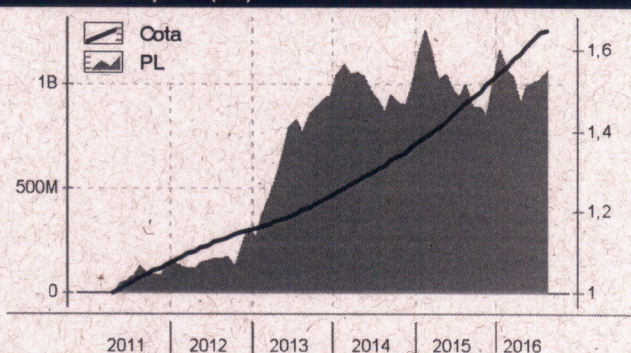
CNPJ	13077415000105
Início do Fundo	28/04/2011
Código Anbima	272604
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Média Grau de L...
Gestão	BB Dtvn S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dtvn S.A
Taxa máx. adm. (%)	1,00
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	05/08/2016
Cota	1,6479
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.065.141
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	989.872
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 **CDI**

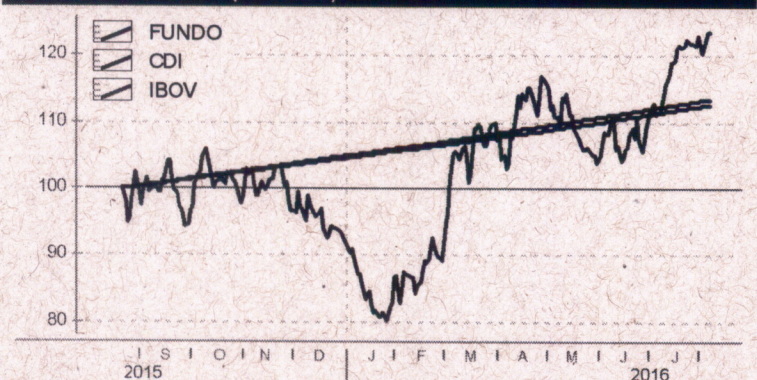
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



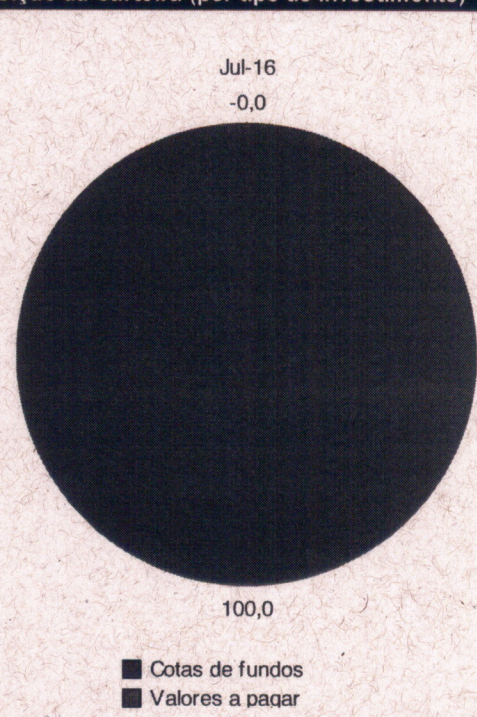
Retornos (%) (até 05/08/2016)

	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,05	0,92	1,07	1,17	1,05	0,26	9,97	12,36	7,66	13,21	25,99	37,43	64,79
● CDI	1,16	1,05	1,11	1,16	1,11	0,26	10,81	13,24	8,19	14,13	27,96	40,71	71,53
● IBOV	16,97	7,70	-10,09	6,30	11,22	0,62	-2,91	-13,31	33,02	14,66	2,60	19,05	-12,20

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 (%)	1,17
Menor Retorno Mensal (%)	0,26
Retorno Acumulado (%)	13,21
Volatilidade	0,08
Sharpe	-10,42
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,04

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.

Características

CNPJ	03543447000103
Início do Fundo	17/12/1999
Código Anbima	358622
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	BB Dsvm S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dsvm S.A

Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-

Data da Última Cotação	04/08/2016
Cota	13,201
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.901.619
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.465.267

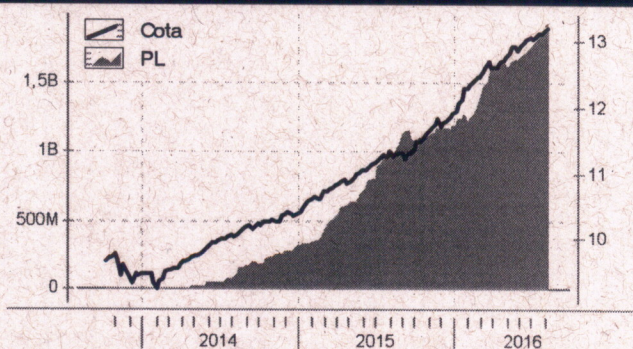
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Inv. Qualificado
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

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+001
Prazo pgto resgate	D+001

Benchmark	IMA-B 5
-----------	---------

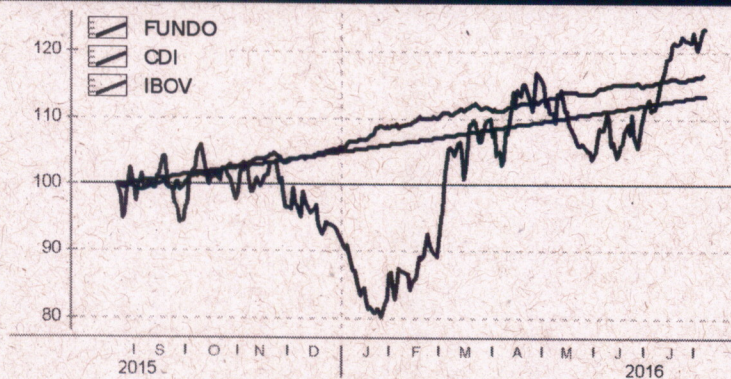
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



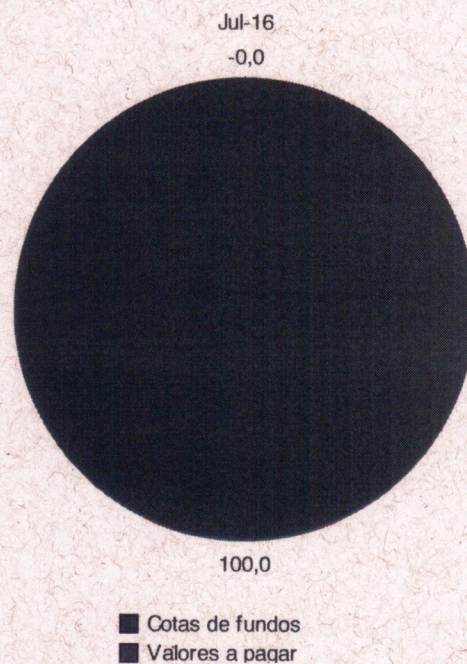
Retornos (%) (até 04/08/2016)

	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,75	1,55	0,79	0,91	1,18	0,49	9,51	14,87	10,56	16,60	31,36	-	36,60
● CDI	1,16	1,05	1,11	1,16	1,11	0,21	10,81	13,24	8,13	14,13	27,95	40,68	38,82
● IBOV	16,97	7,70	-10,09	6,30	11,22	0,50	-2,91	-13,31	32,86	15,05	1,73	18,81	10,04

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 (%)	2,95
Menor Retorno Mensal (%)	0,49
Retorno Acumulado (%)	16,60
Volatilidade	3,40
Sharpe	0,65
VAR de 1 mês - 95% (%)	1,61

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.

Wa Imab5 Ativo FI RF

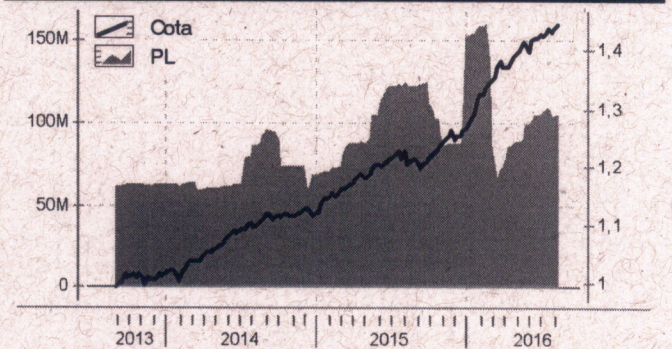
Características

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	-
Data da Última Cotação	04/08/2016
Cota	1,443
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	104.302
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	104.624
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	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+

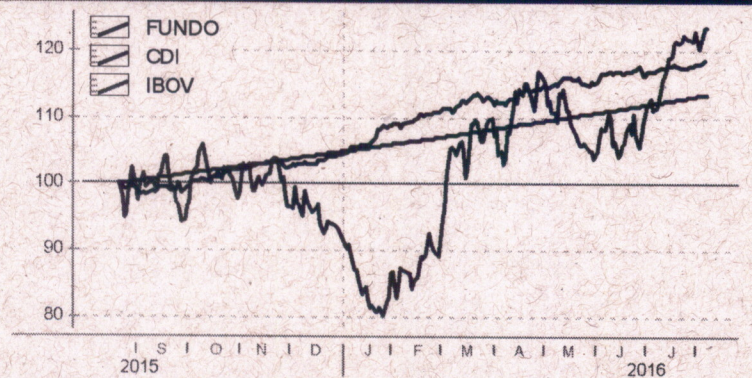
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



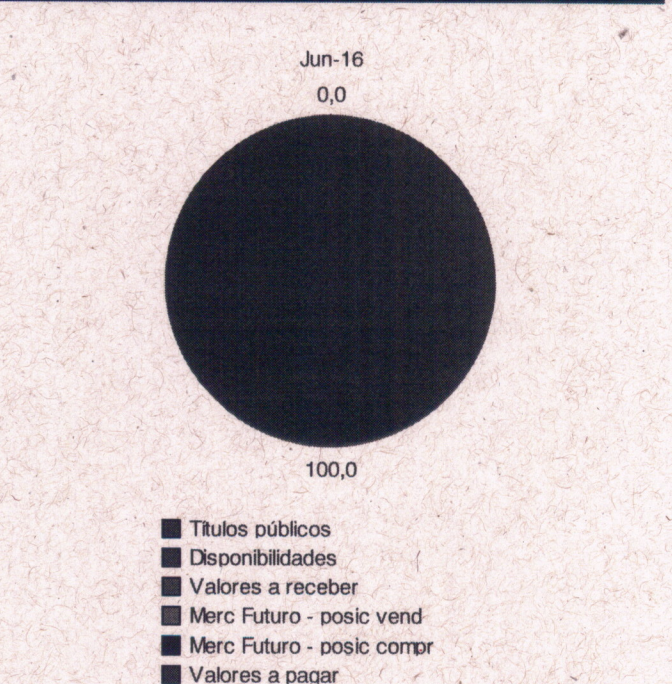
Retornos (%) (até 04/08/2016)

	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,92	2,47	0,38	0,99	1,33	0,54	10,20	13,32	13,45	17,87	31,29	-	44,30
● CDI	1,16	1,05	1,11	1,16	1,11	0,21	10,81	13,24	8,13	14,13	27,95	40,68	39,93
● IBOV	16,97	7,70	-10,09	6,30	11,22	0,50	-2,91	-13,31	32,86	15,05	1,73	18,81	14,98

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 (%)	4,07
Menor Retorno Mensal (%)	0,27
Retorno Acumulado (%)	17,87
Volatilidade	4,41
Sharpe	0,76
VAR de 1 mês - 95% (%)	2,09

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.

Sul America Excellence FI RF Cred Priv *Economática*

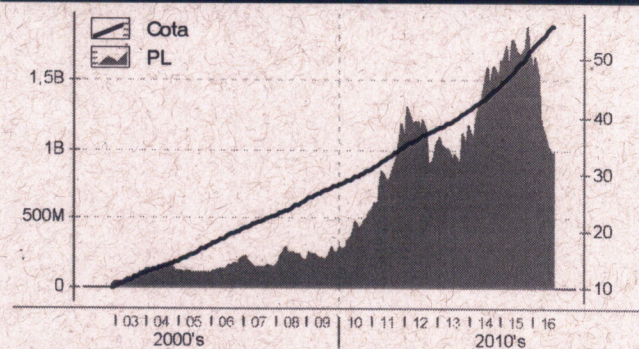
Características

CNPJ	04899128000190
Início do Fundo	11/11/2002
Código Anbima	109215
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Livre Grau de I...
Gestão	Sul America Investimentos Gestor...
Custodiante	Itau Unibanco S/A
Administrador	Sul America Investimentos Dtm
Taxa máx. adm. (%)	0,50
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	04/08/2016
Cota	55,756
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	983.267
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.381.848
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	-

Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	5.000
Aplicação adicional mínima	2.500
Resgate mínimo	2.500
Saldo mínimo	2.500
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+001
Prazo pgto resgate	D+001
Benchmark	CDI

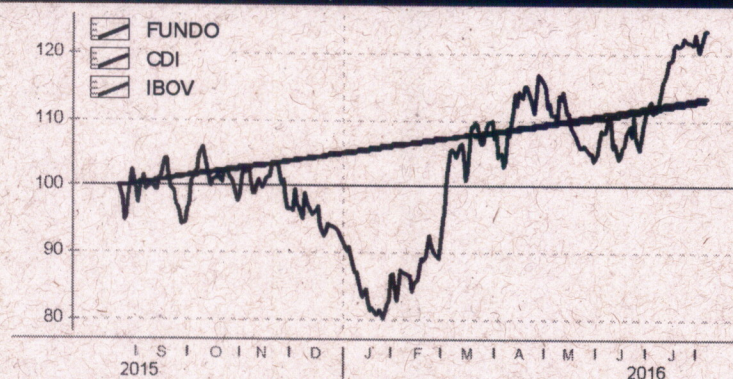
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



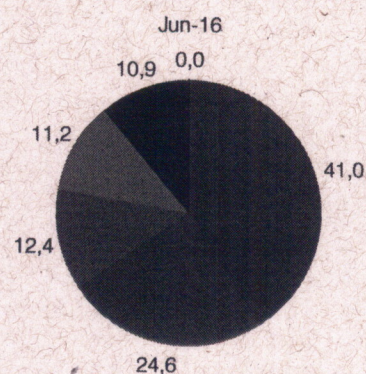
Retornos (%) (até 04/08/2016)

	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,62	1,04	0,87	1,17	1,15	0,22	11,18	13,84	7,35	13,59	27,83	41,00	457,56
● CDI	1,16	1,05	1,11	1,16	1,11	0,21	10,81	13,24	8,13	14,13	27,95	40,68	441,27
● IBOV	16,97	7,70	-10,09	6,30	11,22	0,50	-2,91	-13,31	32,86	15,05	1,73	18,81	482,63

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 (%)	1,28
Menor Retorno Mensal (%)	0,22
Retorno Acumulado (%)	13,59
Volatilidade	0,44
Sharpe	-1,13
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,21

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.