



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 | | Nº / ANO: | 112 /2017 - GI |
| Unidade Gestora do RPPS | | OF. Nº: | 112 /2017 - GI |
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores | | Data: | 12/09/17 |
| CNPJ: 05.244.336/0001-13 | | Dispositivo da Resolução do CMN | |
| Valor: | | FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a" | |
| R\$ 67.455,53 | | | |
| Sessenta e sete mil, quatrocentos e cinquenta e cinco reais e cinquenta e três centavos | | | |
| HISTÓRICO DA OPERAÇÃO /CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS: | | | |
| Fundo: | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | | |
| CNPJ do Fundo: | 10.740.670/0001-06 | | |
| Segmento: | Renda Fixa | | |
| Tipo de Ativo: | FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | | |
| Tipo de operação realizada: | Aplicação | | |
| Valor da operação: | R\$ 67.455,53 | | |
| Quantidade de Cotas: | 31.127,09611924 | | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 2,16710000 | | |
| Data da Operação: | 12/09/2017 | | |
| Data de Liquidação: | 12/09/2017 | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 14.897.615.000,00 | | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,000453% | | |
| Banco/Agência/Conta: | Caixa Econômica Federal | DOS SERV 50-75 | 00000004-5 |
| Administrador: | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | |
| CNPJ do Administrador: | 00.360.305/0001-04 | | |
| Data do Termo de Credenciamento do Administrador: | 06/12/2016 | | |
| Gestor: | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | |
| CNPJ do Gestor: | 00.360.305/0001-04 | | |
| Data do Termo de Credenciamento do Gestor: | 06/12/2016 | | |
| Distribuidor: | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | |
| CNPJ do Distribuidor: | 00.360.305/0001-04 | | |
| Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor: | 06/12/2016 | | |
| Data de Início FI: | 28/05/2010 | | |
| Taxa Administração do FI (%): | 0,20 | | |
| Agência de Classificação de Risco que classificou o FI: | Dispensado | | |
| Índice de Referência do FI: | IRFM-1 | | |
| 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: | 10.740 - Dispensado | | |
| Carência (dias): | 0 | | |
| Data Listagem Bolsa: | Não listado | | |
| Resgate (dias): | Após 90 | | |

10.740.670/0001-06
31.127,09611924
R\$ 14.897.615,00
0,000453%

| | | |
|---|--|--|
| 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: | R\$ 0,00 | |
| Segmento: | R\$ 0,00 | |
| Tipo de Ativo: | R\$ 0,00 | |
| % Carteira do Fundo: | 0,00 | |
| 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: | O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Renda Fixa de Mercado 1 - IRF-M 1, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. |
| | Principais riscos do fundo: | O Cotista está sujeito aos riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO aplica seus |
| | Risco do Fundo atribuído pelo Administrador | Risco Baixo |
| 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 | 15/08/2017 |
| Outras Observações: | Recebimentos de juros/amortização do FIDIC CASAN SANEAMENTO | |
| Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s) | <p>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</p> <p>Gestor/Autorizador Jose Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019</p> | |

Recife, 12 de setembro de 2017


Ofício RECI-REV nº 112/2017 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 67.455,53 (Sessenta e sete mil, quatrocentos e cinquenta e cinco reais cinquenta e três centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 10.740.670/0001-06, vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 112/2017

Atenciosamente,

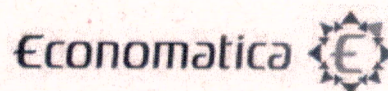

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JUNIOR
DIRETOR EXECUTIVO

Ilma Senhora
MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ - Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA

RECEBIDO
EM 13/09/17

FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF



Características

| | |
|----------------------|-------------------------|
| CNPJ | 10740670000106 |
| Início do Fundo | 28/05/2010 |
| Código Anbima | 248975 |
| Classificação Anbima | Renda Fixa Indexados |
| Gestão | Caixa |
| Custodiante | Caixa Economica Federal |
| Administrador | Caixa |
| Taxa máx. adm. (%) | 0,20 |
| Taxa performance | - |

| | |
|--------------------------------|------------|
| Data da Última Cotação | 12/09/2017 |
| Cota | 2,1671 |
| Patrimônio Líquido (R\$ 000) | 14.897.615 |
| Patrimônio Médio 12m (R\$ 000) | 12.514.119 |

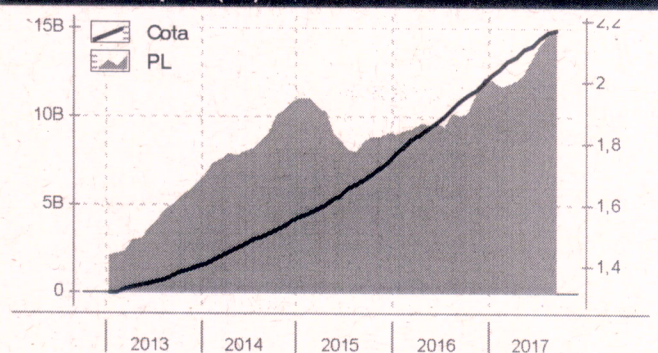
| | |
|--------------------------|------------------|
| Alavancado | Não |
| Investimento no Exterior | Não se Aplica |
| Investidor qualificado | Não |
| Tipo de investidor | Não Há Restrição |
| Resolução 3792 | Sim |
| Resolução 3922 | Sim |

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 | IRF-M 1 |
|-----------|---------|

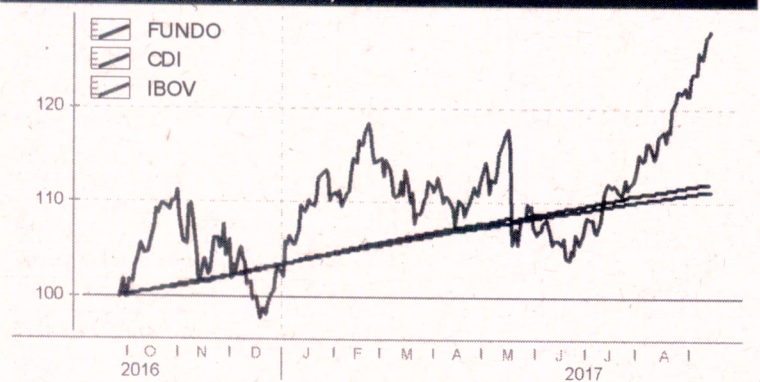
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



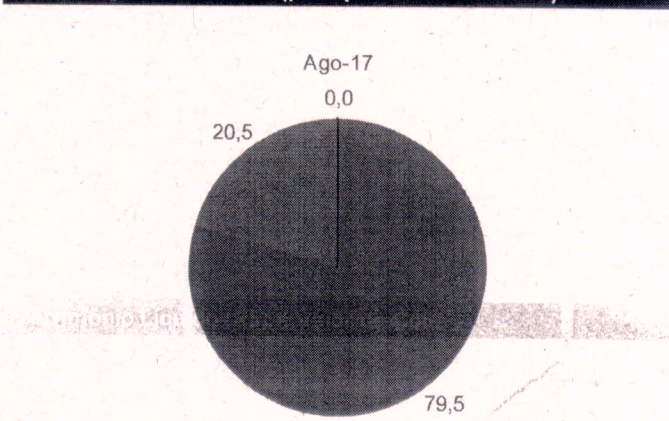
Retornos (%) (até 12/09/2017)

| | abr 2017 | mai 2017 | jun 2017 | jul 2017 | ago 2017 | set 2017 | 2015 | 2016 | 2017 | 12m | 24m | 36m | do início |
|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| ● FUNDO | 0,86 | 0,90 | 0,87 | 1,04 | 0,89 | 0,27 | 12,76 | 14,58 | 8,50 | 12,83 | 29,57 | 44,34 | 116,71 |
| ● CDI | 0,79 | 0,93 | 0,81 | 0,80 | 0,80 | 0,23 | 13,24 | 14,00 | 7,59 | 11,90 | 27,64 | 43,43 | 113,49 |
| ● IBOV | 0,64 | -4,12 | 0,30 | 4,80 | 7,46 | 5,23 | -13,31 | 38,94 | 23,76 | 27,23 | 60,64 | 30,94 | 20,33 |

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 (%) | 1,26 |
| Menor Retorno Mensal (%) | 0,27 |
| Retorno Acumulado (%) | 12,83 |
| Volatilidade | 0,67 |
| Sharpe | 1,25 |
| VAR de 1 mês - 95% (%) | 0,32 |

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

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.