



**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° 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N° 170,  
DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>  <b>Unidade Gestora do RPPS:</b> Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores  <b>CNPJ:</b> 05.244.336/0001-13	<b>Nº / ANO:</b> 113/2016
	<b>OF. Nº:</b> 113/2016 – GI
	<b>Data:</b> 16/08/2016
<b>VALOR (R\$):</b> 80.169.810,00 (Oitenta milhões, oitocentos e sessenta e nove mil, oitocentos e dez reais)	<b>Dispositivo da Resolução do CMN:</b> Art. 7º, I, “b” e Art. 8º, III

**HISTÓRICO DA OPERAÇÃO**

Descrição da operação: Aplicações conforme a seguir:

- Aplicar o valor de R\$ 38.669.810,00 (Quarenta e cinco milhões de reais), no fundo FI Caixa Brasil IMA-B 5 TP RF LP CNPJ: 11.060.913/0001-10;
- Aplicar o valor de R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais), no fundo FI Caixa Brasil IMA-B TP RF LP CNPJ: 10.740.658/0001-93;
- Aplicar o valor de R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais), no fundo FI Caixa Brasil IRF-M 1 TP RF LP CNPJ: 10.740.670/0001-06;
- Aplicar R\$ 1.500.000,00 (Hum milhão e quinhentos mil reais), no fundo AZ Legan Brasil FIA CNPJ: 14.550.994/0001-24.

Os recursos das aplicações acima são decorrentes do resgate total do fundo de Investimento Caixa Brasil 2016 I Títulos Públicos Renda Fixa CNPJ: 20.139.299/0001-77, em 15/08/2016, tendo em vista o encerramento do mesmo em decorrência dos vencimentos dos títulos constantes de sua carteira.

As aplicações nos fundos FI Caixa Brasil IMA-B 5 TP RF LP CNPJ: 11.060.913/0001-10; FI Caixa Brasil IMA-B TP RF LP CNPJ: 10.740.658/0001-93; FI Caixa Brasil IRF-M 1 TP RF LP CNPJ: 10.740.670/0001-06 e AZ Legan Brasil FIA CNPJ: 14.550.994/0001-24, estão aderentes à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.

Os fundos FI Caixa Brasil IMA-B 5 TP RF LP CNPJ: 11.060.913/0001-10; FI Caixa Brasil IMA-B TP RF LP CNPJ: 10.740.658/0001-93; FI Caixa Brasil IRF-M 1 TP RF LP CNPJ: 10.740.670/0001-06 e AZ Legan Brasil FIA CNPJ: 14.550.994/0001-24, encontram-se credenciados pelo Fundo Previdenciário Reciprev.

As aplicações acima foram definidas e autorizadas na reunião do Comitê de Investimentos do dia 27.07.2016.

Anexo: Lâminas dos fundos e ofício

**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:** FI Caixa Brasil IMA-B 5 TP RF LP  
**CNPJ do Fundo:** 11.060.913/0001-10  
**Índice de Referência:** IMA-B 5  
**Patrimônio Líquido do Fundo:** R\$ 5.479.544.000,00 (posição de 12 /08/2016 )  
**% do Patrimônio Líquido do Fundo:** 0,71%

**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:** FI Caixa Brasil IMA-B TP RF LP  
**CNPJ do Fundo:** 10.740.658/0001-93  
**Índice de Referência:** IMA-B  
**Patrimônio Líquido do Fundo:** R\$ 4.309.847.000,00 (posição de 12/08/2016 )  
**% do Patrimônio Líquido do Fundo:** 0,46 %

**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:** FI Caixa Brasil IRF-M 1 TP RF  
**CNPJ do Fundo:** 10.740.670/0001-06  
**Índice de Referência:** IRF M-1  
**Patrimônio Líquido do Fundo:** R\$ 9.387.246.000,00 (posição de 12/08/2016 )  
**% do Patrimônio Líquido do Fundo:** 0,21%


**Segmento:** Renda Variável  
**Tipo de Ativo:** Renda Variável – Art. 8º, III  
**Instituição Financeira:** AZ Legan Administração de Recursos Ltda  
**CNPJ da Instituição Financeira:** 09.468.079/0001-54  
**Fundo:** AZ Legan Brasil FIA  
**CNPJ do Fundo:** 14.550.994/0001-24  
**Índice de Referência:** IBOVESPA  
**Patrimônio Líquido do Fundo:** R\$ 48.572.000,00 (posição de 12 /08/2016 )  
**% do Patrimônio Líquido do Fundo:** 3,09 %

**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

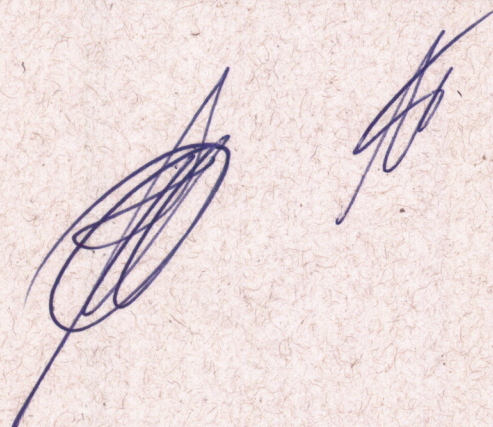
**GESTOR/AUTORIZADOR CERTIFICAÇÃO/VALIDADE**

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



Recife, 16 de agosto de 2016

**Ofício RECIPREV nº 113/2016 – GI**

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar as seguintes operações, vinculado à conta 4-5:

- a) Aplicar o valor de R\$ 38.669.810,00 (Trinta e oito milhões, seiscentos e sessenta e nove mil, oitocentos e dez reais), no fundo FI Caixa Brasil IMA-B 5 TP RF LP CNPJ: 11.060.913/0001-10;
- b) Aplicar o valor de R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais), no fundo FI Caixa Brasil IMA-B TP RF LP CNPJ: 10.740.658/0001-93;
- c) Aplicar o valor de R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais), no fundo FI Caixa Brasil IRF-M 1 TP RF CNPJ: 10.740.670/0001-06;

Efetuar TED conforme a seguir:

Banco: Banco Bradesco S.A (237)  
Agência: 2856-8  
Conta: 13326-4  
Favorecido: AZ Legan Brasil FIA  
CNPJ: 14.550.994/0001-24  
Valor: R\$ 1.500.000,00 (Hum milhão e quinhentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 113/2016

Atenciosamente,

**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

**MÁRCIO ARAUJO ACIOLI**  
Gerente Administrativo e Financeiro

Ilmo Senhor  
**DIOGO OLIVEIRA**  
Gerente de Atendimento PJ – Público  
**Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo**  
**NESTA**

Recebido 16/08  
DIOGO LYRA DE OLIVEIRA  
Gerente de Atendimento PJ  
Mat. 115.088-2  
Ag. Cais do Apolo PE  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Recife, 16 de agosto de 2016

**Ofício RECI-REV nº 38A/2016 – GI**

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECI-REV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 1.500.000,00 (Hum milhão e quinhentos mil reais), no fundo AZ Legan Brasil FIA CNPJ: 14.550.994/0001-24.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através da Caixa Econômica Federal, Agência 50-3, conta corrente, com os dados a seguir:

Banco: Banco Bradesco S.A (237)  
Agência: 2856-8  
Conta: 13326-4  
Favorecido: AZ Legan Brasil FIA  
CNPJ: 14.550.994/0001-24  
Valor: R\$ 1.500.000,00 (Hum milhão e quinhentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 113/2016

Atenciosamente,

**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

**MÁRCIO ARAUJO ACIOLI**  
Gerente Administrativo e Financeiro

*Encaminhado por  
Rev. J. em 16/08/2016*

*Jose Marcos Alves de Barros*  
Gerente de Investimentos  
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife  
CNPJ: 07.749.668/0001-85  
APR 113/2016

Prezados (as) Senhores (as)  
ROGÉRIO ZICO ALMEIDA/ MAURÍCIO GALLEGU AUGUSTO/ JÉSSICA  
DARTORA/ ANA LÚCIA RIBEIRO  
AZ LEGAN ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA  
São Paulo - SP

# FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP

## Características

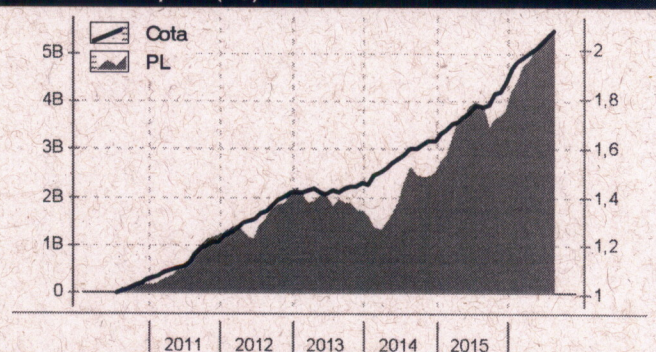
CNPJ	11060913000110
Início do Fundo	09/07/2010
Código Anbima	251496
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	Caixa
Custodiante	Caixa Economica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-

## 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	IMA-B 5

Data da Última Cotação	12/08/2016
Cota	2,0815
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	5.479.544
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	4.500.503

## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota

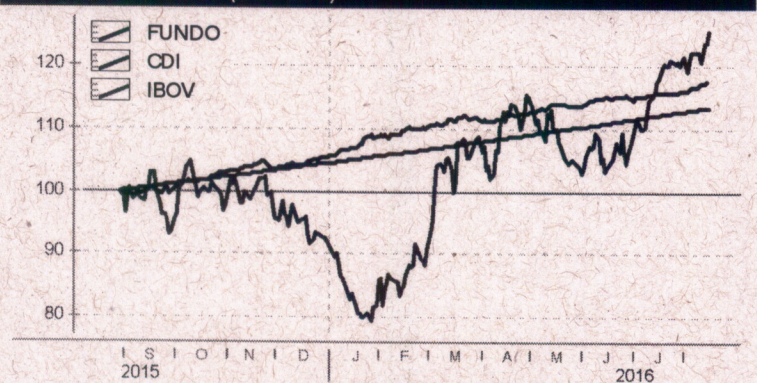


Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

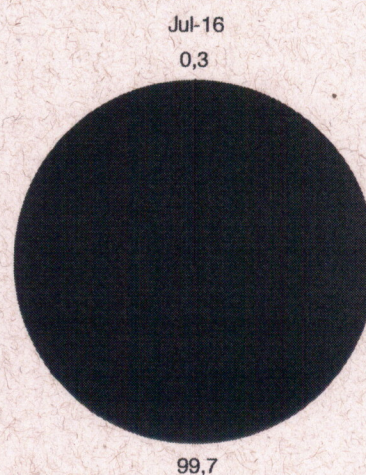
## Retornos (%) (até 12/08/2016)

	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,73	1,53	0,78	0,92	1,19	1,21	11,44	14,86	11,29	17,74	31,88	45,90	108,15
● CDI	1,16	1,05	1,11	1,16	1,11	0,53	10,81	13,24	8,47	14,13	28,04	40,86	86,75
● IBOV	16,97	7,70	-10,09	6,30	11,22	1,73	-2,91	-13,31	34,49	20,48	3,29	15,90	-8,16

## 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 (%)	2,91
Menor Retorno Mensal (%)	0,55
Retorno Acumulado (%)	17,74
Volatilidade	3,31
Sharpe	0,97
VAR de 1 mês - 95% (%)	1,57

- Títulos públicos
- Operações compromissadas
- Valores a receber
- Disponibilidades
- Valores a pagar

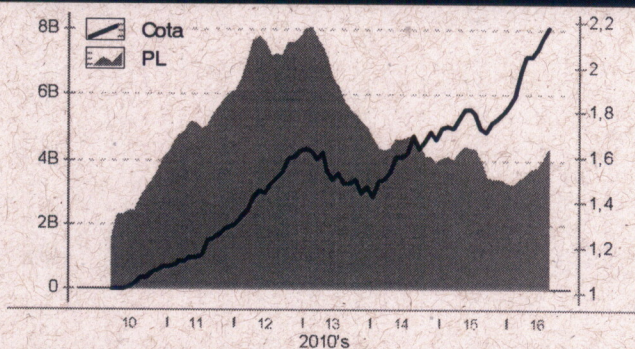
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa 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.

# FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP

Características	
CNPJ	10740658000193
Início do Fundo	08/03/2010
Código Anbima	244120
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	Caixa
Custodiante	Caixa Econômica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	12/08/2016
Cota	2,1736
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	4.309.847
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	3.556.452
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	IMA-B

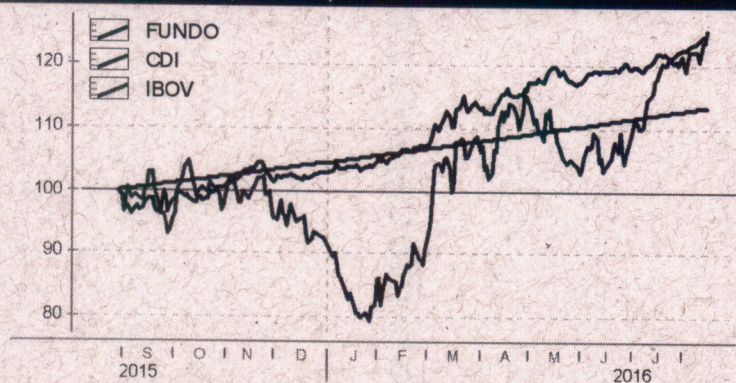
### Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



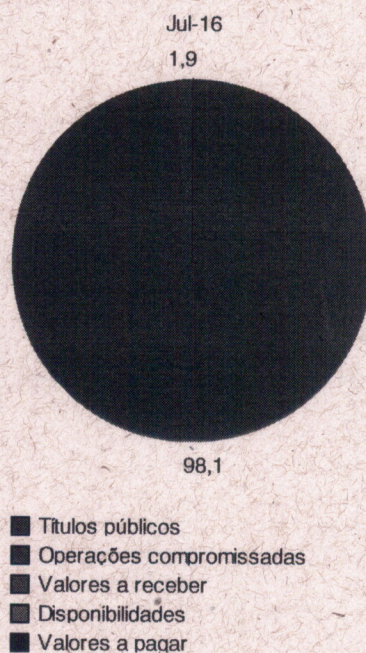
### Retornos (%) (até 12/08/2016)

	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	5,31	3,93	-0,14	1,92	2,48	1,84	14,32	7,27	21,02	23,81	33,57	44,51	117,36
● CDI	1,16	1,05	1,11	1,16	1,11	0,53	10,81	13,24	8,47	14,13	28,04	40,86	92,48
● IBOV	16,97	7,70	-10,09	6,30	11,22	1,73	-2,91	-13,31	34,49	20,48	3,29	15,90	-14,99

### Retorno Acumulado (252 dias)



### Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



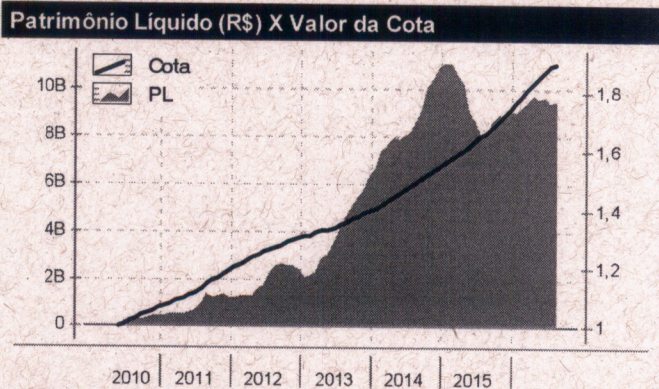
### Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	10
Meses Negativos	2
Maior Retorno Mensal (%)	5,31
Menor Retorno Mensal (%)	-1,09
Retorno Acumulado (%)	23,81
Volatilidade	9,27
Sharpe	0,96
VAR de 1 mês - 95% (%)	4,40

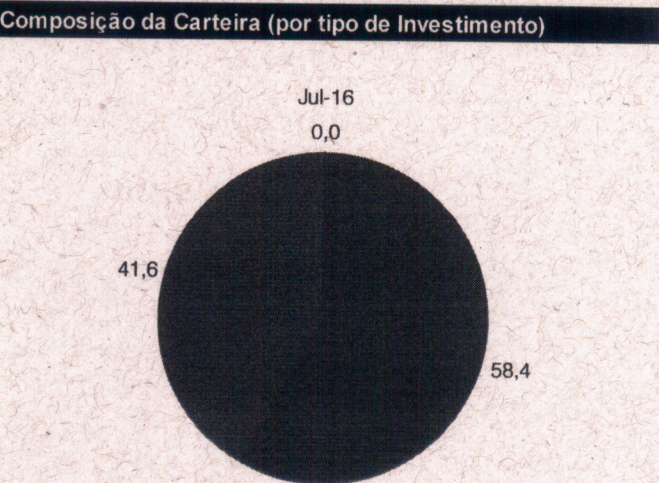
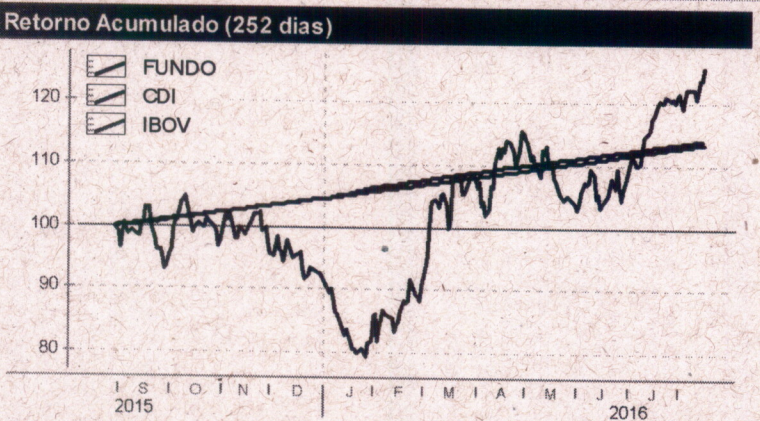
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa 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	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	12/08/2016
Cota	1,9011
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	9.387.246
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	9.185.804
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



Retornos (%) (até 12/08/2016)													
	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,23	1,11	1,05	1,06	1,03	0,53	10,35	12,76	9,07	14,74	27,78	40,17	90,11
● CDI	1,16	1,05	1,11	1,16	1,11	0,53	10,81	13,24	8,47	14,13	28,04	40,86	88,80
● IBOV	16,97	7,70	-10,09	6,30	11,22	1,73	-2,91	-13,31	34,49	20,48	3,29	15,90	-5,89



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)	
Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	1,62
Menor Retorno Mensal (%)	0,53
Retorno Acumulado (%)	14,74
Volatilidade	0,45
Sharpe	1,14
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,22

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	14550994000124
Início do Fundo	16/12/2011
Código Anbima	292966
Classificação Anbima	Ações Índice Ativo
Gestão	Az Legan Administracao de Recurs...
Custodiante	Banco Bradesco S.A.
Administrador	Bem Dtm

Taxa máx. adm. (%)	3,50
Taxa performance	20% que exceder 100% do Ibovespa...

Data da Última Cotação	12/08/2016
Cota	0,96165
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	48.572
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	35.781

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

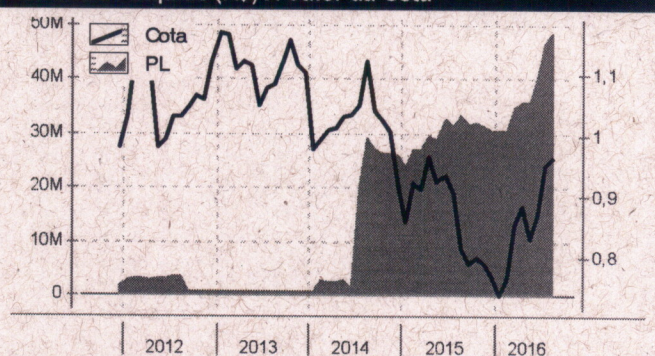
## Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	100
Aplicação adicional mínima	100
Resgate mínimo	100
Saldo mínimo	100

Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+001
Prazo pgto resgate	D+004

Benchmark	CDI
-----------	-----

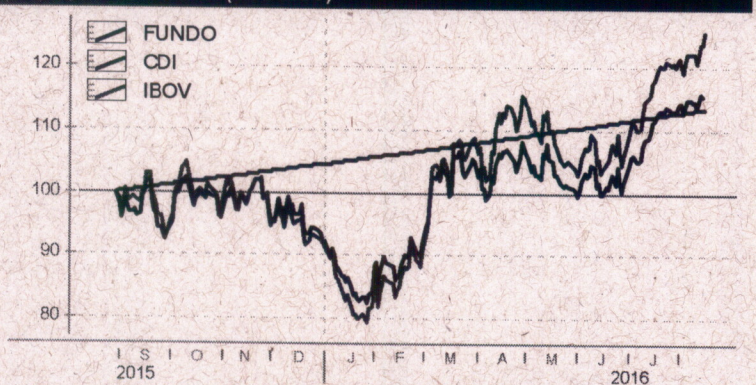
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



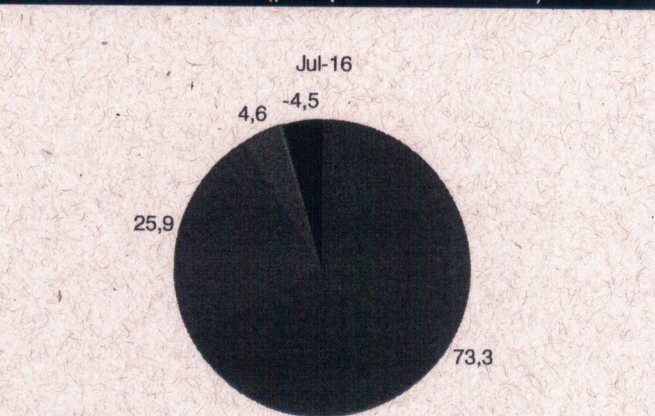
## Retornos (%) (até 12/08/2016)

	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	11,71	3,59	-6,37	5,04	9,21	1,15	-16,36	-16,67	25,14	13,40	-9,50	-11,77	-3,84
● CDI	1,16	1,05	1,11	1,16	1,11	0,53	10,81	13,24	8,47	14,13	28,04	40,86	60,10
● IBOV	16,97	7,70	-10,09	6,30	11,22	1,73	-2,91	-13,31	34,49	20,48	3,29	15,90	3,93

## Retorno Acumulado (252 dias)



## Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



- Emprést -acoes e TVM cedid
- Ações
- Operações compromissadas
- Valores a receber
- Títulos públicos
- Disponibilidades
- Valores a pagar

## Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	7
Meses Negativos	5
Maior Retorno Mensal (%)	11,71
Menor Retorno Mensal (%)	-6,37
Retorno Acumulado (%) *	13,40
Volatilidade	24,78
Sharpe	0,10
VAR de 1 mês - 95% (%)	11,77

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 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.