



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSSITÊNCIA 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

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO: 133/2016
Unidade Gestora do RPPS: Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	OF. Nº: 133/2016 – GI
CNPJ: 05.244.336/0001-13	Data: 10/10/2016
VALOR (R\$): 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais)	Dispositivo da Resolução do CMN: Art. 7º, I, “b”

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO

Descrição da operação: Resgate no valor de R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais), do fundo FI Caixa Brasil IRF-M 1 TP RF CNPJ: 10.740.670/0001-06, para ser aplicado o mesmo valor no fundo FI Caixa Brasil IMA-B TP RF LP CNPJ: 10.740.658/0001-93.

A aplicação no fundo FI Caixa Brasil IMA-B TP RF LP CNPJ: 10.740.658/0001-93, está aderente à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.

O fundo FI Caixa Brasil IMA-B TP RF LP CNPJ: 10.740.658/0001-93, encontra-se credenciado pelo Fundo Previdenciário Reciprev.

O resgate e a aplicação acima foram definidos e autorizados na reunião do Comitê de Investimentos do dia 28.09.2016.

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 IRF-M 1 TP RF

CNPJ do Fundo: 10.740.670/0001-06

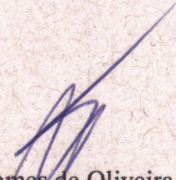
Índice de Referência: IRF-M1

Segmento: Renda Fixa

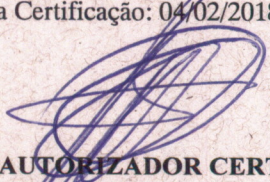
Tipo de Ativo: Renda Fixa – Art. 7º, I, “b”

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\$ 5.240.350.000,00 (posição de 06/10/2016)
% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,38%


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:


Francisco Canindé Antunes Furtado Junior
Diretor Executivo
CPF: 416.004.444-15

Recife, 10 de outubro de 2016

Ofício RECIPREV nº 133/2016 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar as seguintes operações:

- a) Resgatar o valor de R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais), do fundo FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF CNPJ: 10.740.670/0001-06;
- 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.

Todos vinculados à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 133/2016

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

FRANCISCO CANINDÉ A F JUNIOR
Diretor Executivo

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

RECEBIDO EM 10/10/16
ANITA GOLDBERG DA NOVA RIBEIRO
TBN - Matr. 143563-9
AG. Cais do Apolo/PE
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

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	06/10/2016
Cota	2,2041
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	5.240.350
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	3.933.669

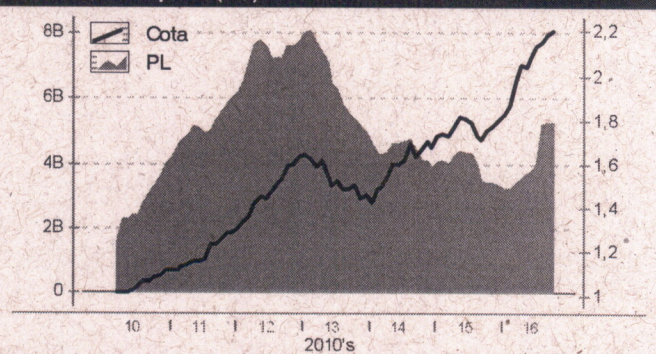
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

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
-----------	-------

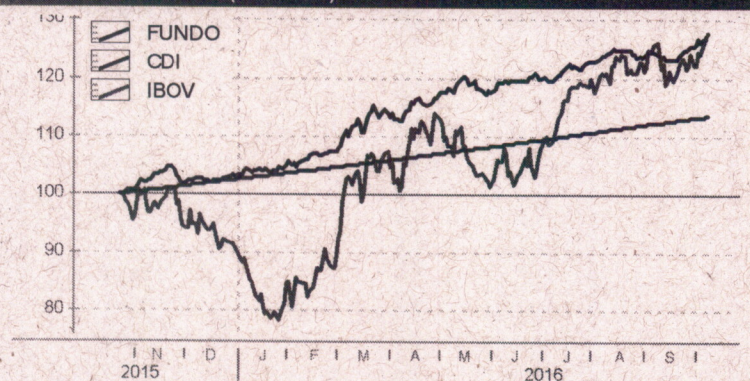
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



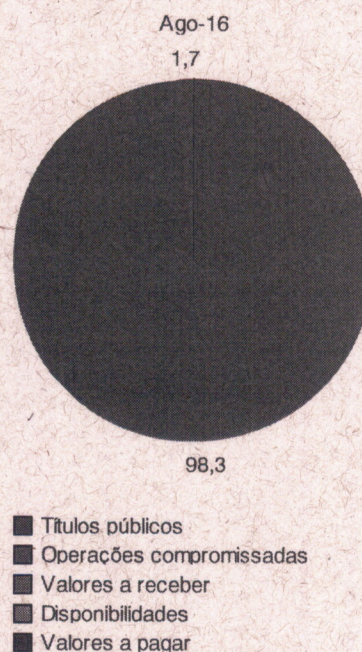
Retornos (%) (até 06/10/2016)

	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	set 2016	out 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	-0,14	1,92	2,48	0,83	1,58	0,82	14,32	7,27	22,72	26,90	31,59	48,07	120,41
● CDI	1,11	1,16	1,11	1,21	1,11	0,21	10,81	13,24	10,65	14,13	28,56	41,87	96,35
● IBOV	-10,09	6,30	11,22	1,03	0,80	3,90	-2,91	-13,31	39,90	27,04	6,18	14,75	-11,57

Retorno Acumulado (252 dias)



Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	11
Meses Negativos	1
Maior Retorno Mensal (%)	5,31
Menor Retorno Mensal (%)	-0,14
Retorno Acumulado (%)	26,90
Volatilidade	7,00
Sharpe	1,63
VAR de 1 mês - 95% (%)	3,32

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 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	-

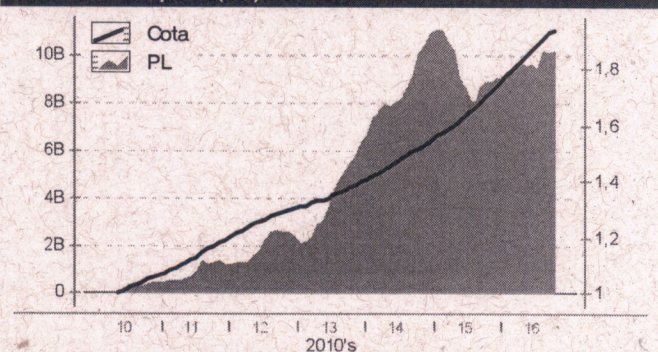
Data da Última Cotação	06/10/2016
Cota	1,9399
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	10.127.708
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	9.474.595

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

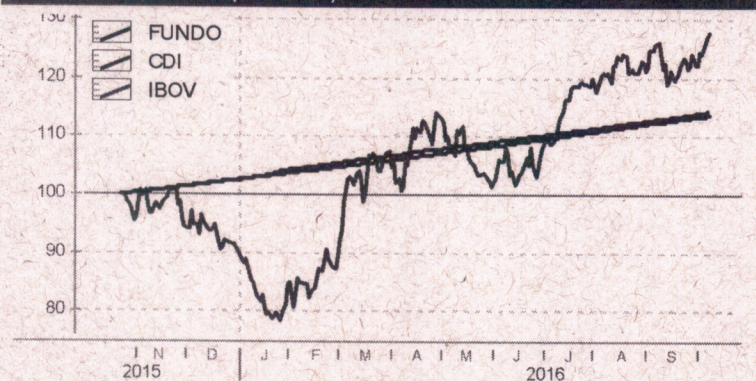
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



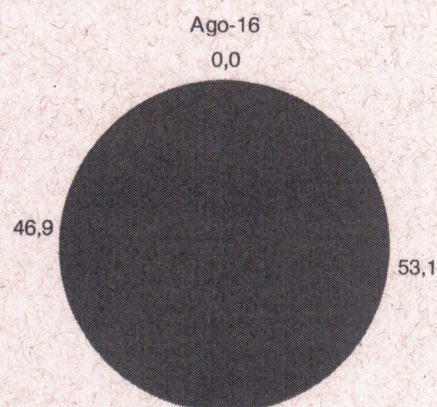
Retornos (%) (até 06/10/2016)

	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	set 2016	out 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,05	1,06	1,03	1,17	1,17	0,22	10,35	12,76	11,29	14,83	28,43	41,39	93,99
● CDI	1,11	1,16	1,11	1,21	1,11	0,21	10,81	13,24	10,65	14,13	28,56	41,87	92,60
● IBOV	-10,09	6,30	11,22	1,03	0,80	3,90	-2,91	-13,31	39,90	27,04	6,18	14,75	-2,10

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 (%)	1,62
Menor Retorno Mensal (%)	0,22
Retorno Acumulado (%)	14,83
Volatilidade	0,38
Sharpe	1,58
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,18

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.

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