



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: 134/2016
	OF. Nº: 134; 39 A e 40 A /2016 – GI
	Data: 11/10/2016
VALOR (R\$): 14.499.410,57 (Quatorze milhões, quatrocentos e noventa e nove mil, quatrocentos e dez reais e cinquenta e sete centavos)	Dispositivo da Resolução do CMN: Art. 7º, IV, “a”
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO	
<p>Descrição da operação: Resgate no valor total do fundo Western Asset DI Referenciado FI CNPJ: 00.819.875/0001-10, correspondente a R\$ 14.499.410,57 (Quatorze milhões, quatrocentos e noventa e nove mil, quatrocentos e dez reais cinquenta e sete centavos), para ser aplicado o mesmo valor no fundo Western Asset Ativo FI Renda Fixa CNPJ: 03.499.367/0001-90.</p> <p>A aplicação no fundo Western Asset Ativo FI Renda Fixa CNPJ: 03.499.367/0001-90, está aderente à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.</p> <p>O fundo Western Asset Ativo FI Renda Fixa CNPJ: 03.499.367/0001-90, encontra-se credenciado pelo Fundo Previdenciário Reciprev.</p> <p>O resgate e a aplicação acima foram definidos e autorizados na reunião do Comitê de Investimentos do dia 28.09.2016.</p> <p>Anexo: Lâminas dos fundos e ofícios</p>	
CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:	
<p>Segmento: Renda Fixa Tipo de Ativo: Renda Fixa – Art. 7º, IV, “a” Instituição Financeira: WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA CNPJ da Instituição Financeira: 07.437.241/0001-41 Fundo: Western Asset DI Referenciado FI CNPJ do Fundo: 00.819.875/0001-10 Índice de Referência: CDI</p>	

Segmento: Renda Fixa

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

Instituição Financeira: WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA

CNPJ da Instituição Financeira: 07.437.241/0001-41

Fundo: Western Asset Ativo FI Renda Fixa

CNPJ do Fundo: 03.499.367/0001-90

Índice de Referência: CDI

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 897.320.000,00 (posição de 07/10/2016)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,62%

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-PE, 11 de outubro de 2016

Ofício RECIPREV nº 134/2016 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos o RESGATE TOTAL do fundo Western Asset DI Referenciado FI CNPJ: 00.819.875/0001-10, em nome do cotista Fundo Previdenciário Reciprev CNPJ: 07.749.668/0001-85.

Na oportunidade, solicitamos que a TED seja encaminhada para:

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

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 134/2016

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JUNIOR
Diretor Executivo

Prezados (as) Senhores (as)

ELDER ANDRADE

WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA
São Paulo - SP

Entremidoado por eu 11/10/2016

*José Marcos Alves
Gerente de Investimentos
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência Social dos Servidores*



**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 11 de outubro de 2016

Ofício RECI PREV nº 39A/2016 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar TED, a débito da conta 7.909-X, conforme dados a seguir:

Banco: CITIBANK N. 745

Agência: 001

Conta Corrente: 5643740

Favorecido: Western Asset Ativo FI Renda Fixa

CNPJ: 03.499.367/0001-90

Valor: R\$ R\$ 14.499.410,57 (Quatorze milhões, quatrocentos e noventa e nove mil, quatrocentos e dez reais e cinquenta e sete centavos)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 134/2016

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JUNIOR
DIRETOR EXECUTIVO

Ilmo Senhor

PEDRO PAULO

Gerente de Relacionamento

Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife

NESTA



Autorarquia 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



**PREFEITURA DO
RECIFE**

Recife-PE, 11 de outubro de 2016

Ofício RECIprev nº 40A/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\$ 14.499.410,57 (Quatorze milhões, quatrocentos e noventa e nove mil, quatrocentos e dez reais e cinquenta e sete centavos), no fundo Western Asset Ativo FI Renda Fixa CNPJ: 03.499.367/0001-90.

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: CITIBANK N. 745
Agência: 001
Conta Corrente: 5643740
Favorecido: Western Asset Ativo FI Renda Fixa
CNPJ: 03.499.367/0001-90
Valor: R\$ R\$ 14.499.410,57 (Quatorze milhões, quatrocentos e noventa e nove mil, quatrocentos e dez reais e cinquenta e sete centavos)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 134/2016

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

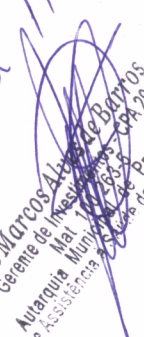
FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JUNIOR
Diretor Executivo

Prezados (as) Senhores (as)

ELDER ANDRADE

WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA

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

Encaminhado por euv-1 em 11.10.2016

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

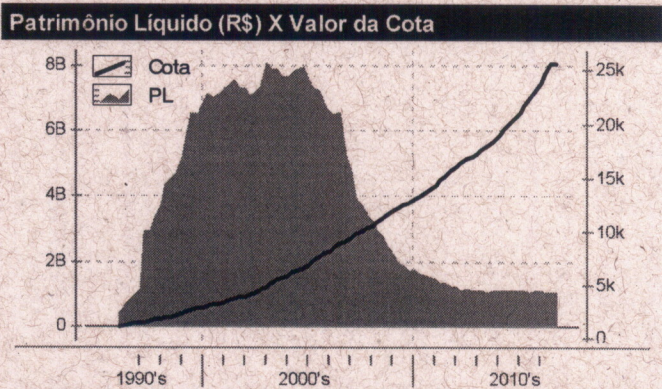


Características	
CNPJ	00819875000110
Início do Fundo	02/10/1995
Código Anbima	017957
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Baixa Grau de I...
Gestão	Western Asset
Custodiante	Citibank Dtm SA
Administrador	Western Asset
Taxa máx. adm. (%)	0,00
Taxa performance	-

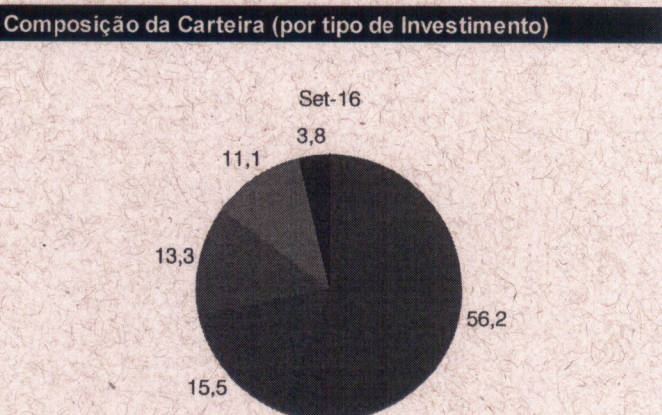
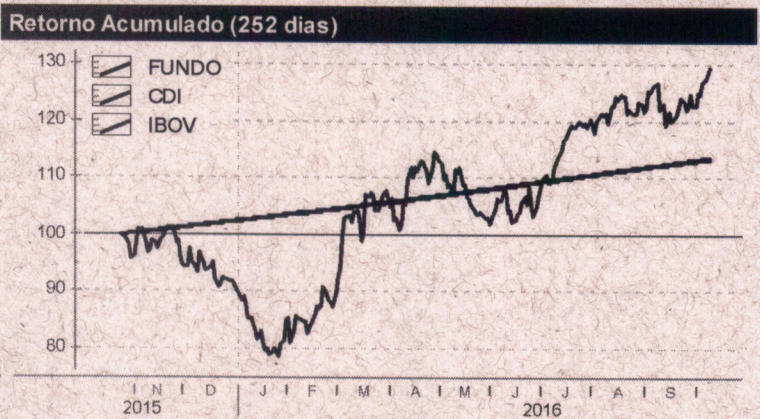
Data da Última Cotação	10/10/2016
Cota	25.633
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.035.659
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.072.424

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	0
Aplicação adicional mínima	0
Resgate mínimo	0
Saldo mínimo	10
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+000
Prazo pgto resgate	D+000
Benchmark	CDI



Retornos (%) (até 10/10/2016)													
	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	set 2016	out 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,13	1,20	1,07	1,22	1,08	0,31	11,10	13,36	10,64	13,82	28,52	42,24	2.253,69
● CDI	1,11	1,16	1,11	1,21	1,11	0,32	10,81	13,24	10,77	14,07	28,48	41,83	2.150,91
● IBOV	-10,09	6,30	11,22	1,03	-0,80	5,66	-2,91	-13,31	42,26	24,99	11,49	16,36	1.304,74



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)	
Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	1,22
Menor Retorno Mensal (%)	0,31
Retorno Acumulado (%)	13,82
Volatilidade	0,13
Sharpe	-1,79
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,06

- Títulos públicos
- Operações compromissadas
- Dep a prazo e otr tit de inst fin
- Cotas de fundos
- Debêntures
- Disponibilidades
- Merc Futuro - posic vend
- 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.

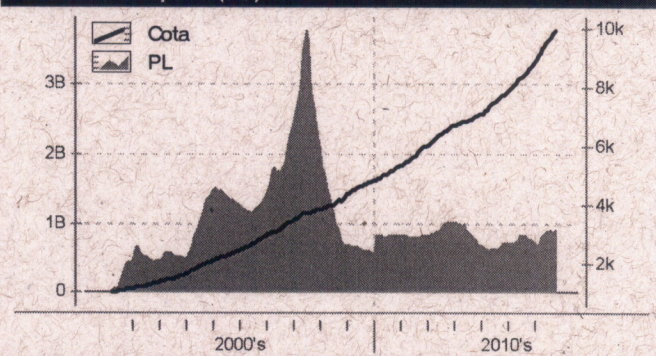
Características

CNPJ	03499367000190
Início do Fundo	21/03/2000
Código Anbima	075124
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Livre Grau de I...
Gestão	Western Asset
Custodiante	Citibank Dtm SA
Administrador	Western Asset
Taxa máx. adm. (%)	0,40
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	07/10/2016
Cota	9.971,63
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	897.320
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	812.150
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	100
Resgate mínimo	100
Saldo mínimo	10
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+000
Prazo pgto resgate	D+001
Benchmark	CDI

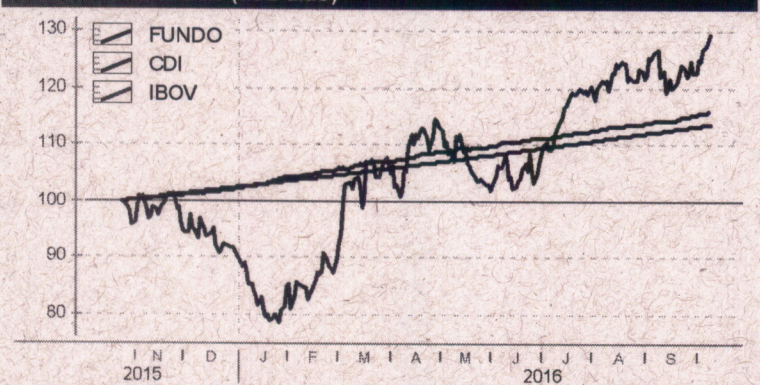
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



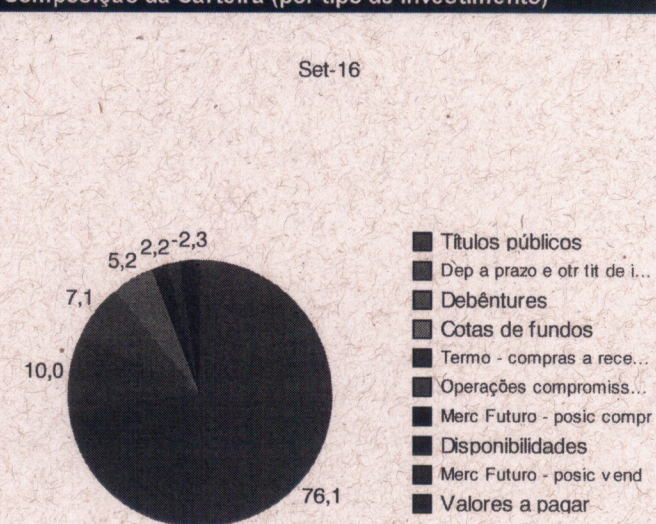
Retornos (%) (até 07/10/2016)

	mai 2016	jun 2016	jul 2016	ago 2016	set 2016	out 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,76	1,30	1,20	1,18	1,33	0,48	10,43	12,36	13,23	16,69	29,37	42,38	897,16
● CDI	1,11	1,16	1,11	1,21	1,11	0,26	10,81	13,24	10,71	14,13	28,57	41,90	751,43
● IBOV	-10,09	6,30	11,22	1,03	0,80	4,70	-2,91	-13,31	40,97	24,93	6,39	16,58	233,16

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 (%)	2,02
Menor Retorno Mensal (%)	0,48
Retorno Acumulado (%)	16,69
Volatilidade	1,16
Sharpe	1,92
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,55

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.