



**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>Nº / ANO: 45/2016</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS:</b> Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	<b>OF. Nº: 45 e 17A/2016 – GI</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>	<b>Data: 04/04/2016</b>
<b>VALOR (R\$): 3.000.000,00</b> (Três milhões de reais)	<b>Dispositivo da Resolução do CMN:</b> Art. 7º, IV, "a" e Art. 7º, I, "b"

**HISTÓRICO DA OPERAÇÃO**

Descrição da operação: Aplicação no valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), no fundo Western Asset IMA B5 Ativo FI RF CNPJ: 17.517.577/0001-78, decorrente do resgate de mesmo valor Western Asset DI Referenciado FI CNPJ: 00.819.875/0001-10.

A aplicação no fundo Western Asset IMA B5 Ativo FI RF CNPJ: 17.517.577/0001-78, está aderente à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.

O fundo Western Asset IMA B5 Ativo FI RF CNPJ: 17.517.577/0001-78, 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 30.03.2016.

Anexo: Lâminas dos fundos e ofício

**CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:**

**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

**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\$ 74.947.000,00 (posição de 31/03/2016)

**% do Patrimônio Líquido do Fundo:** 3,85%

**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: 14/03/2019

**RESPONSÁVEL PELA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO:**

Márcio Araujo Acioli

Gerente Administrativo e Financeiro

CPF: 111.494.264-20

Recife, 04 de abril de 2016

**Ofício RECIPREV nº 45/2016 – GI**

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), do fundo WESTERN ASSET DI REFERENCIADO FI CNPJ: 00.819.875/0001-10, e aplicar o mesmo valor no fundo WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FI RF CNPJ: 17.517.577/0001-78.

Na oportunidade, solicitamos que a TED seja encaminhada para:

Banco: Caixa Econômica Federal  
Agência: 50-7  
Conta: 00000004-5  
CNPJ: 07.749.668/0001-85  
Valor: R\$ 3.000.000,00

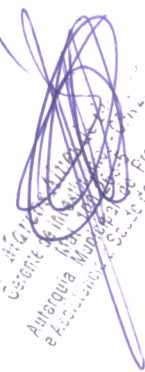
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 45/2016

Atenciosamente,

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

**MÁRCIO ARAUJO ACIOLI**  
Gerente Administrativo e Financeiro

*Em conformidade com  
resol. em 04/04/2016*

  
Gerente Administrativo e Financeiro  
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev

Prezado  
ELDER ANDRADE  
**WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA**  
Av. Presidente Juscelino Kubitschek, 1455 – 15º andar. CEP: 04543-011. Vila Nova Conceição – São Paulo



Recife, 04 de abril de 2016

**Ofício RECIprev nº 17A/2016 – GI**

Senhora Gerente,

Solicitamos transferir via TED, o valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), a débito da conta 4-5, conforme a seguir.

Banco: Citibank (nº 745)  
Agência: 0001  
Conta: 34848878  
Favorecido: WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA  
CNPJ: 17.517.577/0001-78  
Valor: R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais)

Na oportunidade, informamos que ocorrerá um crédito nesta data no valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), na conta 4-5, tendo como origem a própria Western, via Citibank.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 45/2016

Atenciosamente,

  
**JOSÉ MARGOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

**MÁRCIO ARAUJO ACIOLI**  
Gerente Administrativo e Financeiro

Ilma Senhora  
**VERA LUCIA CARVALHO GUIMARAES CAVALCANTI**  
Gerente de Atendimento PJ – Público  
**Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo**  
**NESTA**

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



*Recebido em  
04/04/16 via 11h29*  
  
Vera Lucia S. G. Cavalcanti  
Gerente de Atendimento PJ – Público  
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo

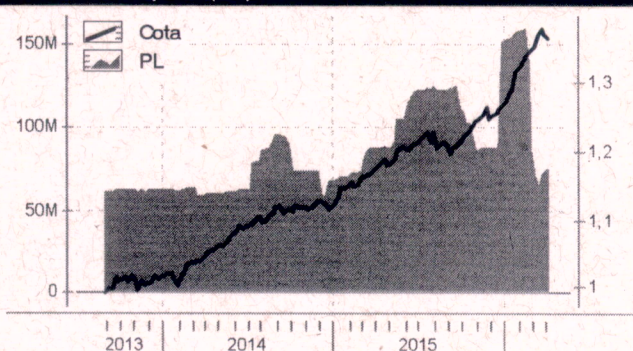
## Características

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	31/03/2016
Cota	1,3637
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	74.947
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	109.617
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+

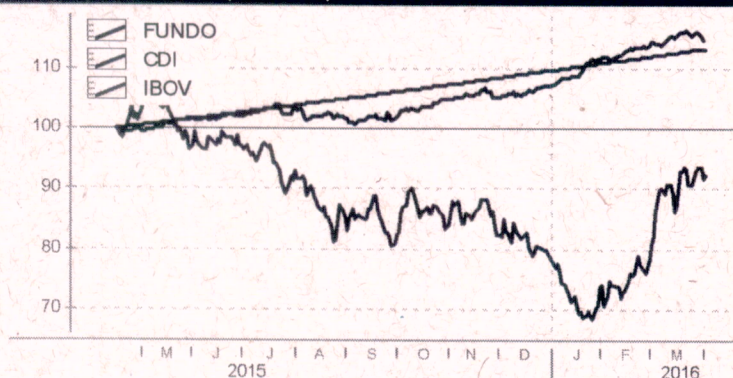
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



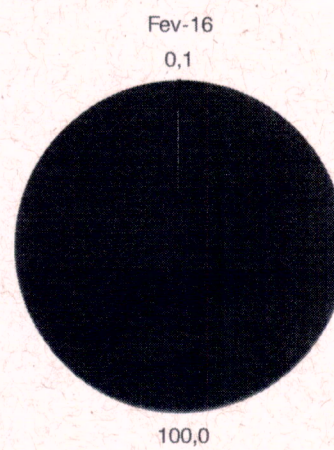
## Rentabilidades (%) (até 31/03/2016)

	out 2015	nov 2015	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	2,63	0,31	1,96	4,07	2,08	0,92	10,20	13,32	7,21	16,13	30,36	-	36,37
● CDI	1,11	1,06	1,16	1,05	1,00	1,16	10,81	13,24	3,25	13,73	26,53	37,79	33,62
● IBOV	1,80	-1,63	-3,93	-6,79	5,91	16,97	-2,91	-13,31	15,47	-2,14	-0,71	-11,17	-0,07

## Retorno Acumulado (252 dias)



## Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



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

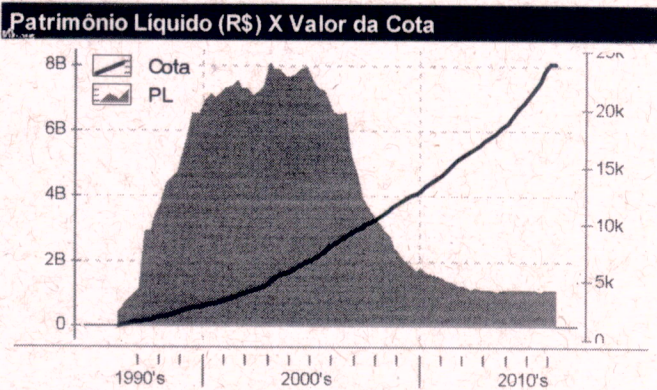
## Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	11
Meses Negativos	1
Maior Retorno Mensal (%)	4,07
Menor Retorno Mensal (%)	-1,67
Retorno Acumulado (%)	16,13
Volatilidade	4,54
Sharpe	0,49
VAR de 1 mês - 95% (%)	2,15

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	00819875000110
Início do Fundo	02/10/1995
Código Anbima	017957
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Baixa Grau de I...
Gestão	Western Asset
Custodiante	Citibank Dsvm SA
Administrador	Western Asset
Taxa máx. adm. (%)	0,00
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	01/04/2016
Cota	23.912
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.102.517
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.100.570
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

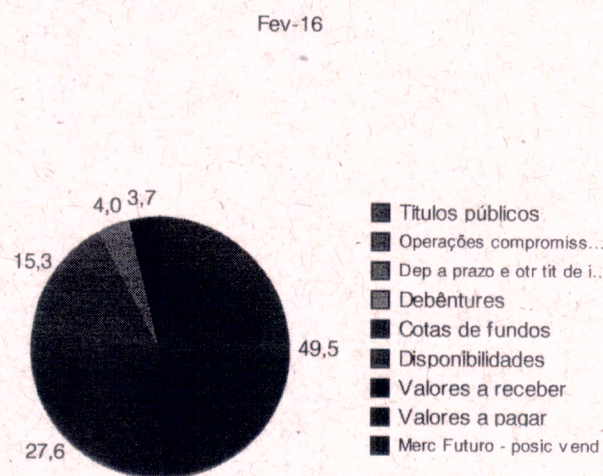
Condições de Investimentos	
Aplicação inicial mínima	0
Aplicação adicional mínima	0
Resgate mínimo	0
Saldo mínimo	10
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+000
Prazo pgto resgate	D+000
Benchmark	CDI



Rentabilidades (%) (até 01/04/2016)													
	nov 2015	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,97	1,17	1,06	0,94	1,12	0,05	11,10	13,36	3,21	13,69	26,81	38,38	2.095,67
● CDI	1,06	1,16	1,05	1,00	1,16	0,05	10,81	13,24	3,31	13,73	26,54	37,82	1.999,25
● IBOV	-1,63	-3,93	-6,79	5,91	16,97	1,01	-2,91	-13,31	16,64	-3,36	0,58	-9,55	1.051,73



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



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)	
Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	1,20
Menor Retorno Mensal (%)	0,05
Retorno Acumulado (%)	13,69
Volatilidade	0,12
Sharpe	-0,46
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,06

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.