



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

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO: 49/2016
Unidade Gestora do RPPS: Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	OF. Nº: 49/2016 – GI
CNPJ: 05.244.336/0001-13	Data: 11/04/2016
VALOR (R\$): 13.000.000,00 (Treze milhões de reais)	Dispositivo da Resolução do CMN: Art. 7º, I, “b” e Art. 7º, IV, “a”

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO

Descrição da operação: Resgate no valor de R\$ 13.000.000,00 (Treze milhões de reais), do fundo FI Caixa Brasil IDKA IPCA 2 A TP RF LP CNPJ: 14.386.926/0001-71, e aplicação nos seguintes fundos de investimentos:

- R\$ 10.000.000,00 (Dez milhões de reais), no fundo FI Caixa Brasil IRF-M1 TP RF CNPJ: 10.740.670/0001-06;
- R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), no fundo FI Caixa Brasil Referenciado DI LP CNPJ: 03.737.206/0001-97.

A aplicação nos fundos FI Caixa Brasil IRF-M1 TP RF CNPJ: 10.740.670/0001-06 e FI Caixa Brasil Referenciado DI LP CNPJ: 03.737.206/0001-97, estão aderentes à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.

Os fundos FI Caixa Brasil IRF-M1 TP RF CNPJ: 10.740.670/0001-06 e FI Caixa Brasil Referenciado DI LP CNPJ: 03.737.206/0001-97, encontram-se credenciados pelo Fundo Previdenciário Reciprev.

O resgate e as aplicações 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, I, “b”

Instituição Financeira: Caixa Econômica Federal

CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04

Fundo: FI Caixa Brasil IDKA IPCA 2 A TP RF LP

CNPJ do Fundo: 14.386.926/0001-71

Índice de Referência: IDKA IPCA 2

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

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 9.538.303.000,00 (posição de 07/04/2016)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,10 %

Segmento: Renda Fixa

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

Instituição Financeira: Caixa Econômica Federal

CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04

Fundo: Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo

CNPJ do Fundo: 03.737.206/0001-97

Índice de Referência: CDI

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 4.489.728.000,00 (posição de 07/04/2016)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,07 %

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 Araújo Acioli

Gerente Administrativo e Financeiro

CPF: 111.494.264-20

Recife, 11 de abril de 2016

Ofício RECIPREV nº 49/2016 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 13.000.000,00 (Treze milhões de reais), do fundo FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP CNPJ: 14.386.926/0001-71, e aplicar conforme a seguir:

- a) R\$ 10.000.000,00 (Dez milhões de reais), no fundo FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF CNPJ: 10.740.670/0001-06;
- b) R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), no fundo FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP CNPJ: 03.737.206/0001-97.

Todos vinculados à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 49/2016

Atenciosamente,

JOSÉ MARCOS 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 11/04/16

Vera Lucia Carvalho G. Cavalcanti
Gerente de Atendimento PJ
Caixa Econômica Federal

Características

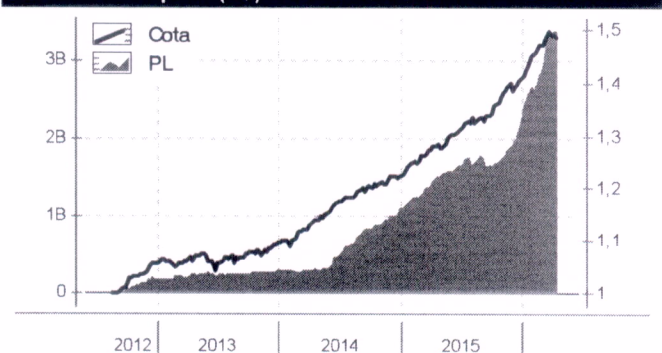
CNPJ	14386926000171
Início do Fundo	16/08/2012
Código Anbima	310638
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	Caixa
Custodiante	Caixa Economica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	07/04/2016
Cota	1,4847
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	3.365.233
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	2.220.028
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 IDKA IPCA 2A

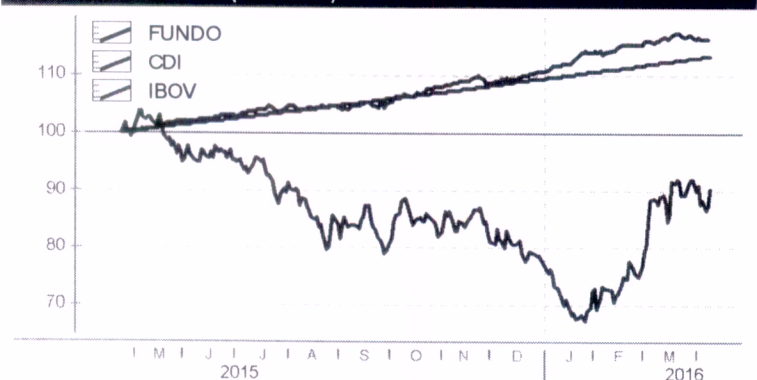
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



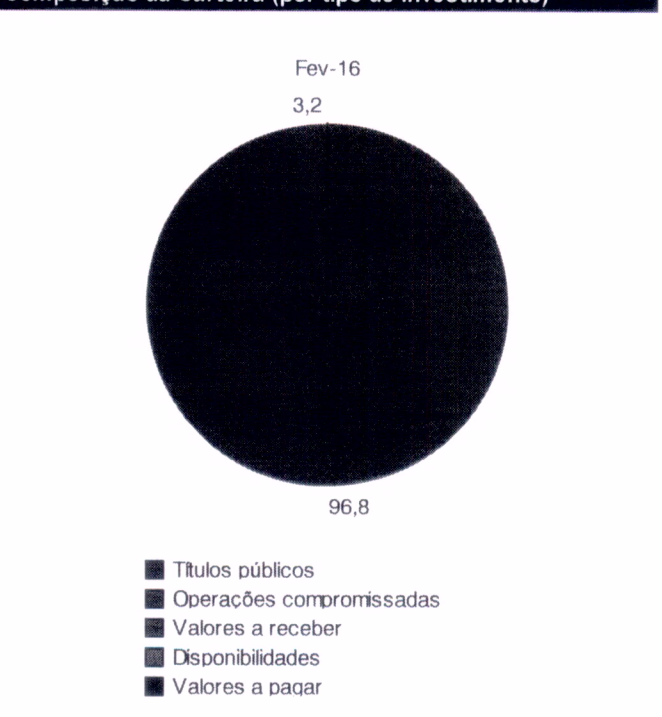
Rentabilidades (%) (até 07/04/2016)

	nov 2015	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,51	1,96	2,87	1,37	0,62	0,07	11,50	15,50	5,00	16,01	30,83	39,22	48,47
● CDI	1,06	1,16	1,05	1,00	1,16	0,26	10,81	13,24	3,52	13,81	26,60	37,97	44,00
● IBOV	-1,63	-3,93	-6,79	5,91	16,97	-3,08	-2,91	-13,31	11,91	-9,71	-6,98	-11,87	-18,39

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 (%)	2,87
Menor Retorno Mensal (%)	-0,30
Retorno Acumulado (%)	16,01
Volatilidade	3,12
Sharpe	0,63
VAR de 1 mês - 95% (%)	1,48

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 Econom ica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-

Data da Última Cotação	07/04/2016
Cota	1,8171
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	9.538.303
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	8.832.051

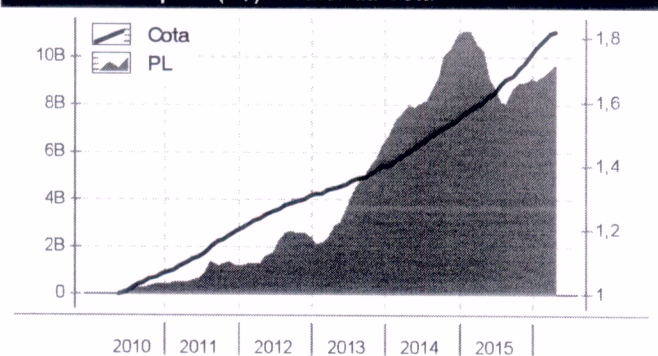
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

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

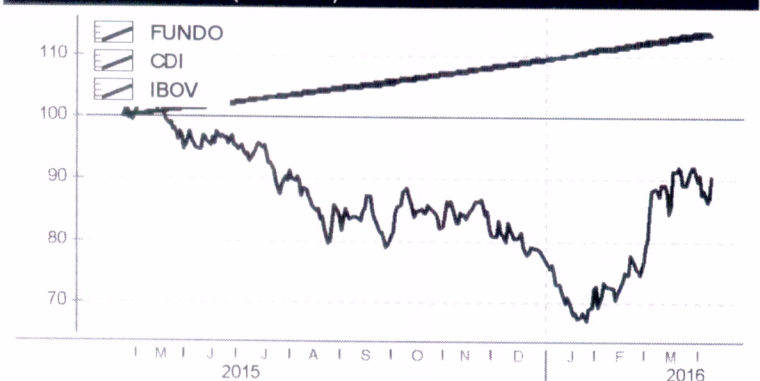
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



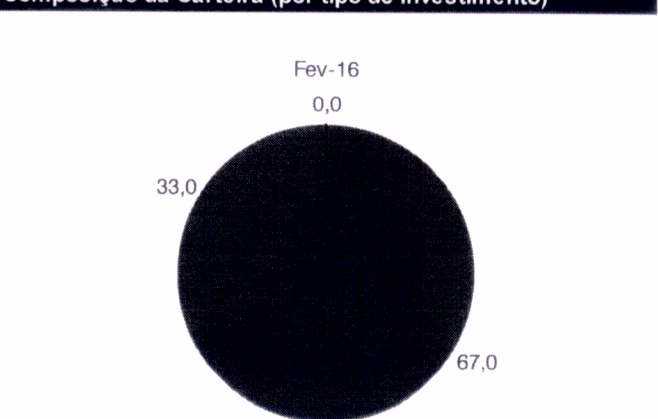
Rentabilidades (%) (até 07/04/2016)

	nov 2015	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,05	1,16	1,62	1,10	1,23	0,24	10,35	12,76	4,25	14,17	26,63	37,04	81,71
● CDI	1,06	1,16	1,05	1,00	1,16	0,26	10,81	13,24	3,52	13,81	26,60	37,97	80,19
● IBOV	-1,63	-3,93	-6,79	5,91	16,97	-3,08	-2,91	-13,31	11,91	-9,71	-6,98	-11,87	-21,69

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 (%)	0,24
Retorno Acumulado (%)	14,17
Volatilidade	0,51
Sharpe	0,60
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,24

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

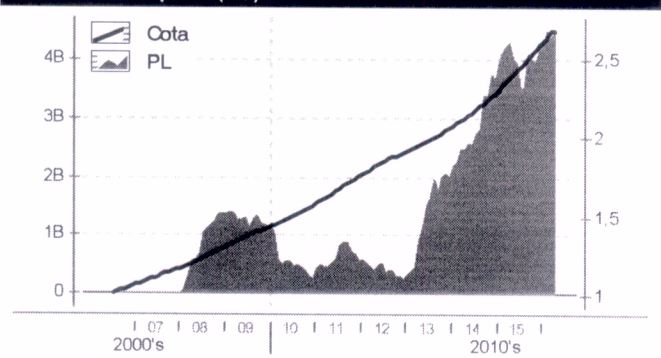
Características

CNPJ	03737206000197
Início do Fundo	05/07/2006
Código Anbima	163821
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Baixa Grau de I...
Gestão	Caixa
Custodiante	Caixa Economica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	07/04/2016
Cota	2,6858
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	4.489.728
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	4.063.234
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	CDI

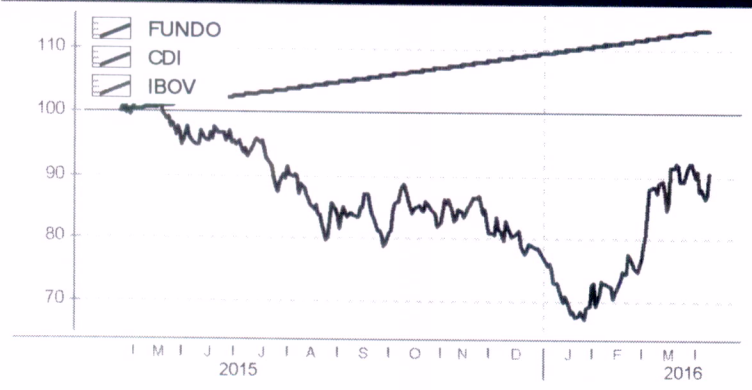
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



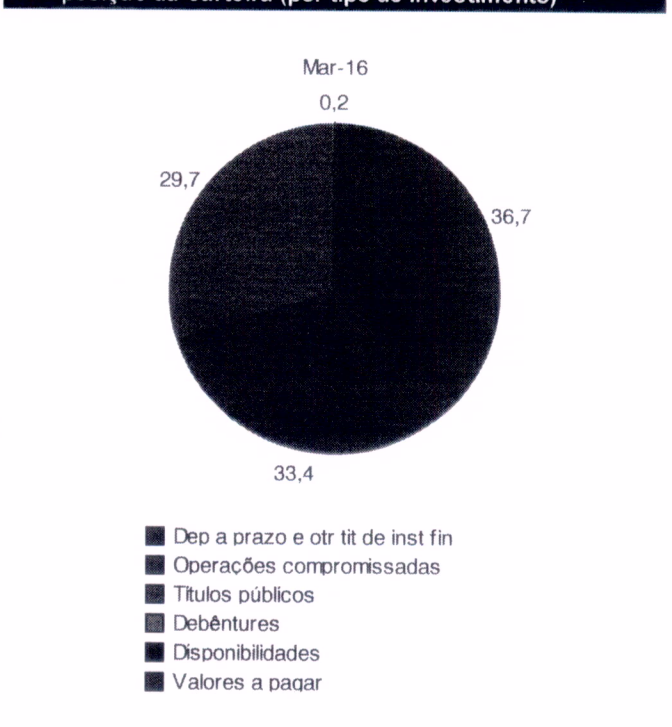
Rentabilidades (%) (até 07/04/2016)

	nov 2015	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,05	1,16	1,05	0,99	1,18	0,27	10,88	13,32	3,53	13,87	26,78	38,14	168,58
● CDI	1,06	1,16	1,05	1,00	1,16	0,26	10,81	13,24	3,52	13,81	26,60	37,97	174,22
● IBOV	-1,63	-3,93	-6,79	5,91	16,97	-3,08	-2,91	-13,31	11,91	-9,71	-6,98	-11,87	33,36

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 (%)	1,19
Menor Retorno Mensal (%)	0,27
Retorno Acumulado (%)	13,87
Volatilidade	0,07
Sharpe	0,57
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,03

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.