

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: 57/2016
Unidade Gestora do RPPS: Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13	OF. Nº: 57/2016 – GI
	Data: 27/04/2016
VALOR (R\$): 35.000.000,00 (Trinta e cinco milhões de reais)	Dispositivo da Resolução do CMN: Art. 7º, I, “b”

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO

Descrição da operação: Resgate no valor de R\$ 35.000.000,00 (Trinta e cinco milhões de reais), do fundo FI Caixa Brasil IMA-B 5 TP RF LP CNPJ: 11.060.913/0001-10, 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 27.04.2016.

Anexo: Lâminas dos fundo 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 TP RF LP

CNPJ do Fundo: 10.740.658/0001-93

Índice de Referência: IMA B

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 3.435.118.000,00 (posição de 25/04/2016)
% do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,02 %

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, 27 de abril de 2016


Ofício RECIPREV nº 57/2016 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 35.000.000,00 (Trinta e cinco milhões de reais), do fundo FI Caixa Brasil IMA-B 5 TP RF LP CNPJ: 11.060.913/0001-10 e aplicar o mesmo valor no fundo FI Caixa Brasil IMA-B TP RF LP CNPJ: 10.740.658/0001-93 , vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 57/2016

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
Gerente Administrativo e Financeiro

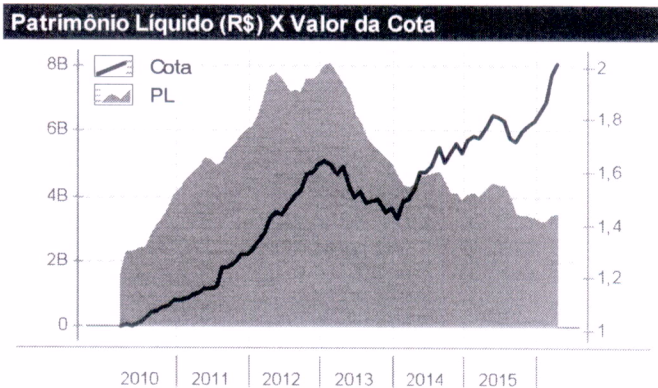
Ilma Senhora
VERA LUCIA CARVALHO GUIMARAES CAVALCANTI
Gerente de Atendimento PJ – Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA

CARNELO FERNANDES DA SILVA
TBN
Matr. 099.739-3
Ag. Cais do Apolo/PE
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

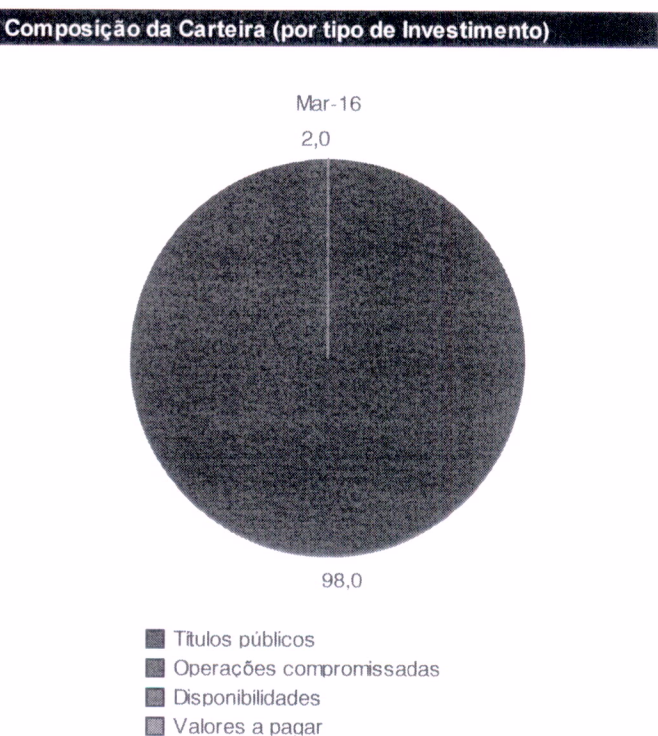
27/04/16

Características	
CNPJ	10740658000193
Início do Fundo	08/03/2010
Código Anbima	244120
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	Caixa
Custodiante	Caixa Economica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	25/04/2016
Cota	2,0122
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	3.435.118
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	3.656.369
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



Rentabilidades (%) (até 25/04/2016)													
	nov 2015	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,02	1,46	1,78	2,27	5,31	2,20	14,32	7,27	12,03	13,85	31,38	24,82	101,22
● CDI	1,06	1,16	1,05	1,00	1,16	0,84	10,81	13,24	4,12	13,82	26,72	38,24	84,76
● IBOV	-1,63	-3,93	-6,79	5,91	16,97	3,61	-2,91	-13,31	19,64	-8,36	0,90	-5,64	-24,37

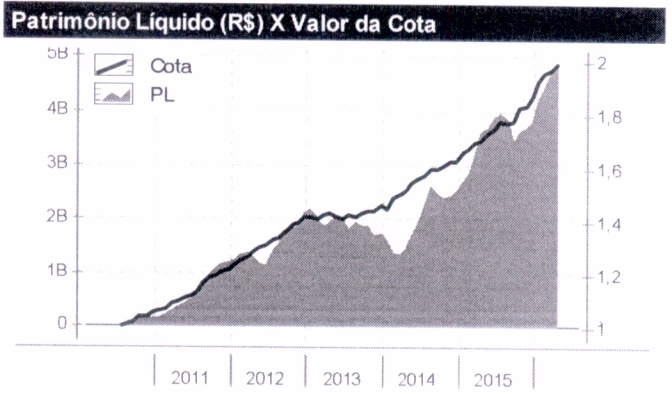


Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)	
Meses Positivos	8
Meses Negativos	4
Maior Retorno Mensal (%)	5,31
Menor Retorno Mensal (%)	-3,39
Retorno Acumulado (%)	13,85
Volatilidade	9,80
Sharpe	0,05
VAR de 1 mês - 95% (%)	4,65

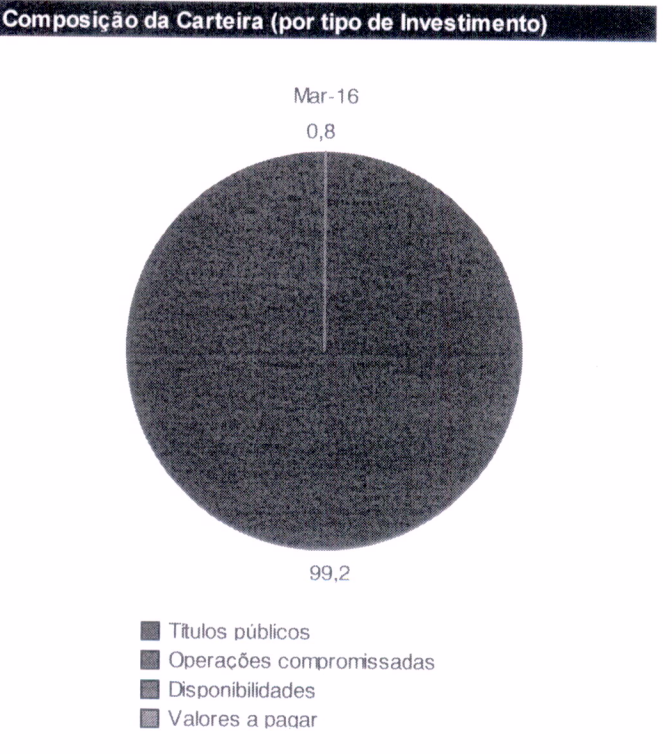
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa 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	11060913000110
Início do Fundo	09/07/2010
Código Anbima	251496
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	Caixa
Custodiante	Caixa Econômica Federal
Administrador	Caixa
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	25/04/2016
Cota	1,9906
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	4.867.662
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	4.008.275
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 5



Rentabilidades (%) (até 25/04/2016)													
	nov 2015	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,55	2,04	2,91	1,51	0,73	1,13	11,44	14,86	6,43	17,02	30,96	38,68	99,06
● CDI	1,06	1,16	1,05	1,00	1,16	0,84	10,81	13,24	4,12	13,82	26,72	38,24	79,26
● IBOV	-1,63	-3,93	-6,79	5,91	16,97	3,61	-2,91	-13,31	19,64	-8,36	0,90	-5,64	-18,30



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)	
Meses Positivos	11
Meses Negativos	1
Maior Retorno Mensal (%)	2,91
Menor Retorno Mensal (%)	-0,51
Retorno Acumulado (%)	17,02
Volatilidade	3,51
Sharpe	0,82
VAR de 1 mês - 95% (%)	1,66

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.