



**RECIFE**  
PREFEITURA DA CIDADE

**RECI  
PREV**

**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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>	<b>Nº / ANO: 70 /2016</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS:</b> Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	<b>OF. Nº: 70 e 25A /2016 – GI</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>	<b>Data: 17/05/2016</b>
<b>VALOR (R\$): 5.200.000,00</b> (Cinco milhões e duzentos mil reais)	<b>Dispositivo da Resolução do CMN:</b> Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, I, "b" e Art. 7º, VII, "b"

**HISTÓRICO DA OPERAÇÃO**

Descrição das operações: Resgate no valor de R\$ 5.200.000,00 (Cinco milhões e duzentos mil reais), do fundo BB Previdenciário RF Fluxo CNPJ: 13.077.415/0001-05, para ser aplicado conforme a seguir:

- R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), no fundo BB Previdenciário RF IMA-B TP FI CNPJ: 07.442.078/0001-05;
- R\$ 2.200.000,00 (Dois milhões e duzentos mil reais), no fundo AZ Legan Valore FI RF –CP CNPJ: 19.782.311/0001-88.

As aplicações nos fundos BB Previdenciário RF IMA-B TP FI CNPJ: 07.442.078/0001-05 e AZ Legan Valore FI RF –CP CNPJ: 19.782.311/0001-88; estão aderentes à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.

Os fundos BB Previdenciário RF IMA-B TP FI CNPJ: 07.442.078/0001-05 e AZ Legan Valore FI RF –CP CNPJ: 19.782.311/0001-88, encontram-se credenciado pelo Fundo Previdenciário Reciprev.

O resgate e as aplicações acima foram definidos e autorizados na reunião do Comitê de Investimentos do dia 27.04.2016.

Anexo: Lâminas dos fundos e ofícios

**CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:**

**Segmento:** Renda Fixa

**Tipo de Ativo:** Renda Fixa – Art. 7º, IV, "a"

**Instituição Financeira:** BB Gestão de Recursos DTVM S.A

**CNPJ da Instituição Financeira:** 30.822.936/0001-69

**Fundo:** BB Previdenciário RF Fluxo

**CNPJ do Fundo:** 13.077.415/0001-05

**Índice de Referência:** CDI

**Segmento:** Renda Fixa

**Tipo de Ativo:** Renda Fixa – Art. 7º, I, "b"

**Instituição Financeira:** BB Gestão de Recursos DTVM S.A

**CNPJ da Instituição Financeira:** 30.822.936/0001-69

**Fundo:** BB Previdenciário RF IMA-B TP FI

**CNPJ do Fundo:** 07.442.078/0001-05

**Índice de Referência:** IMA-B

**Patrimônio Líquido do Fundo:** R\$ 962.161.000,00 (posição de 13 /05/2016)

**% do Patrimônio Líquido do Fundo:** 0,31 %

**Segmento:** Renda Fixa

**Tipo de Ativo:** Renda Fixa – Art. 7º, VII, " b"

**Instituição Financeira:** AZ Legan Administração de Recursos Ltda

**CNPJ da Instituição Financeira:** 09.468.079/0001-54

**Fundo:** AZ Legan Valore FI RF CP

**CNPJ do Fundo:** 19.782.311/0001-88

**Índice de Referência:** CDI

**Patrimônio Líquido do Fundo:** R\$ 73.210.000,00 (posição de 13/05/2016)

**% do Patrimônio Líquido do Fundo:** 3,00%

**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:**

Márcio Araújo Acioli

Gerente Administrativo e Financeiro

CPF: 111.494.264-20

Recife, 17 de maio de 2016

**Ofício RECIPREV nº 70/2016 – GI**

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar as seguintes operações, vinculadas a conta 7.909-X:

a) Resgatar o valor de R\$ 5.200.000,00 (Cinco milhões e duzentos mil reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO CNPJ: CNPJ: 13.077.415/0001-05;

b) Aplicar o valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI CNPJ: 07.442.078/0001-05;

c) Efetuar TED conforme a seguir:

Banco: Banco BTG Pactual S.A. (208)

Agência: 0001

Conta Corrente:185655

Favorecido: AZ Legan Valore FI RF CP

CNPJ: 19.782.311/0001-88

Valor: 2.200.000,00 (Dois milhões e duzentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 70/2016

Atenciosamente,

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

**MÁRCIO ARAUJO ACIOLI**  
Gerente Administrativo e Financeiro

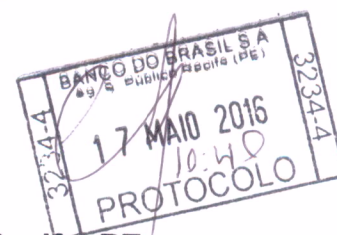
Ilmo Senhor

**PEDRO PAULO**

Gerente de Relacionamento

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

NESTA



Recife, 17 de maio de 2016

**Ofício RECIprev nº 25A/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\$ 2.200.000,00 (Dois milhões e duzentos mil reais), no fundo **AZ Legan Valore FI RF CP CNPJ: 19.782.311/0001-88**.

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: Banco BTG Pactual S.A. (208)  
Agência: 0001  
Conta Corrente:185655  
Favorecido: AZ Legan Valore FI RF CP  
CNPJ: 19.782.311/0001-88  
Valor: 2.200.000,00 (Dois milhões e duzentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 70/2016

Atenciosamente,

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

**MÁRCIO ARAUJO ACIOLI**  
Gerente Administrativo e Financeiro

*Encaminhado por  
euv.fern em  
17/05/2016*

*[Assinatura]*  
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência Social - Reciprev

Prezados (as) Senhores (as)  
**ROGÉRIO ZICO ALMEIDA / MAURÍCIO GALLEGO AUGUSTO/  
JÉSSICA DARTORA/ ANA LÚCIA RIBEIRO**  
**AZ LEGAN ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA**  
**São Paulo - SP**

## Características

CNPJ	13077415000105
Início do Fundo	28/04/2011
Código Anbima	272604
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Média Grau de I...
Gestão	BB Dtm S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dtm S.A
Taxa máx. adm. (%)	1,00
Taxa performance	-

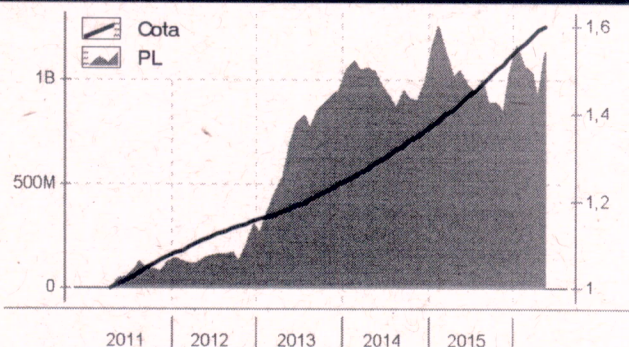
Data da Última Cotação	16/05/2016
Cota	1,5998
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.131.548
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	986.183

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

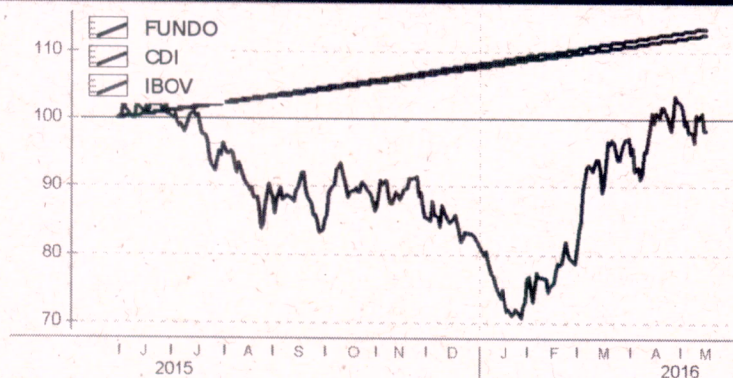
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



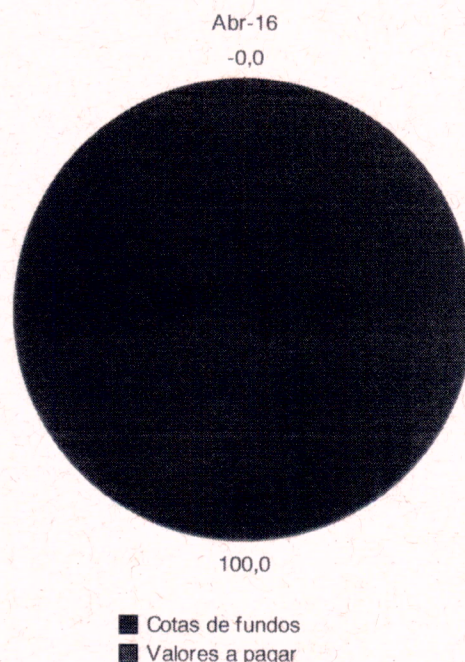
## Rentabilidades (%) (até 16/05/2016)

	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	mai 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,08	0,98	0,91	1,05	0,92	0,57	9,97	12,36	4,52	12,92	24,92	35,43	59,98
● CDI	1,16	1,05	1,00	1,16	1,05	0,58	10,81	13,24	4,94	13,94	26,99	38,79	66,39
● IBOV	-3,93	-6,79	5,91	16,97	7,70	-3,91	-2,91	-13,31	19,50	-9,51	-4,03	-5,42	-21,12

## Retorno Acumulado (252 dias)



## Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



■ Cotas de fundos  
■ Valores a pagar

## Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	1,11
Menor Retorno Mensal (%)	0,57
Retorno Acumulado (%)	12,92
Volatilidade	0,04
Sharpe	-22,13
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,02

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	07861554000122
Início do Fundo	09/03/2006
Código Anbima	242896
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	BB Dtvn S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dtvn S.A
Taxa máx. adm. (%)	0,60
Taxa performance	-

Data da Última Cotação	13/05/2016
Cota	3,2751
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	962.161
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.018.972

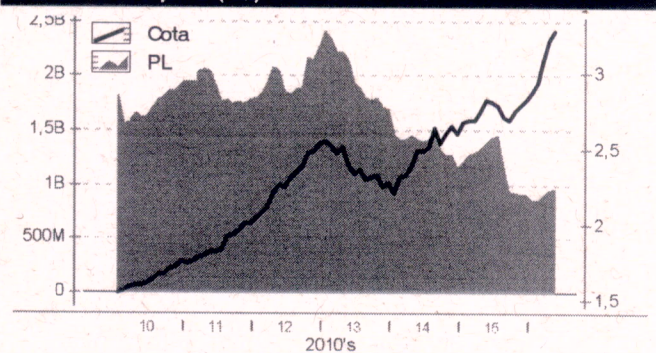
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

## Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	10.000
Aplicação adicional mínima	0
Resgate mínimo	0
Saldo mínimo	0
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+001
Prazo pgto resgate	D+001

Benchmark	IMA-B
-----------	-------

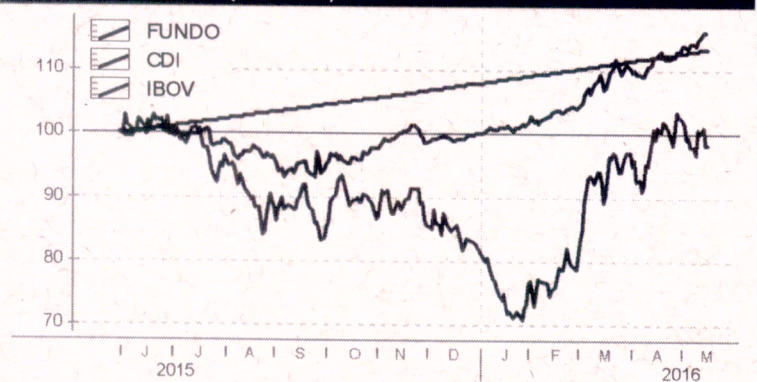
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



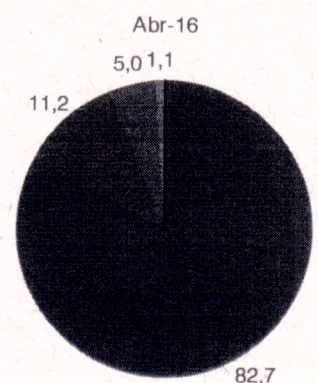
## Rentabilidades (%) (até 13/05/2016)

	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	mai 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,50	1,88	2,21	5,16	3,89	2,04	14,45	8,62	16,07	18,25	35,96	30,23	112,66
● CDI	1,16	1,05	1,00	1,16	1,05	0,53	10,81	13,24	4,89	14,00	27,08	38,83	88,03
● IBOV	-3,93	-6,79	5,91	16,97	7,70	-3,91	-2,91	-13,31	19,50	-8,10	-3,90	-4,85	-24,04

## Retorno Acumulado (252 dias)



## Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



## Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

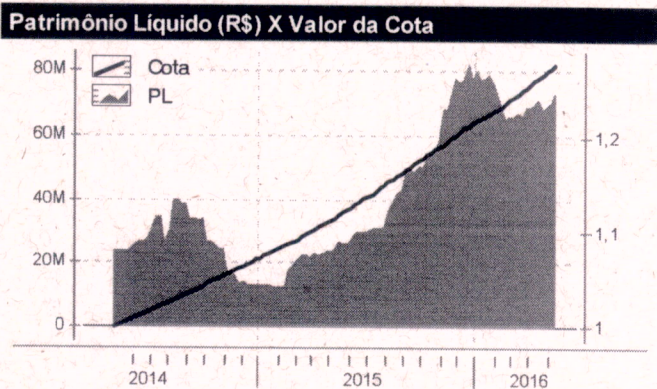
Meses Positivos	8
Meses Negativos	4
Maior Retorno Mensal (%)	5,16
Menor Retorno Mensal (%)	-3,06
Retorno Acumulado (%)	18,25
Volatilidade	9,70
Sharpe	0,43
VAR de 1 mês - 95% (%)	4,61

- Títulos públicos
- Debêntures
- Dep a prazo e otr tit de inst fin
- Operações compromissadas
- Valores a receber
- Disponibilidades
- Valores a pagar

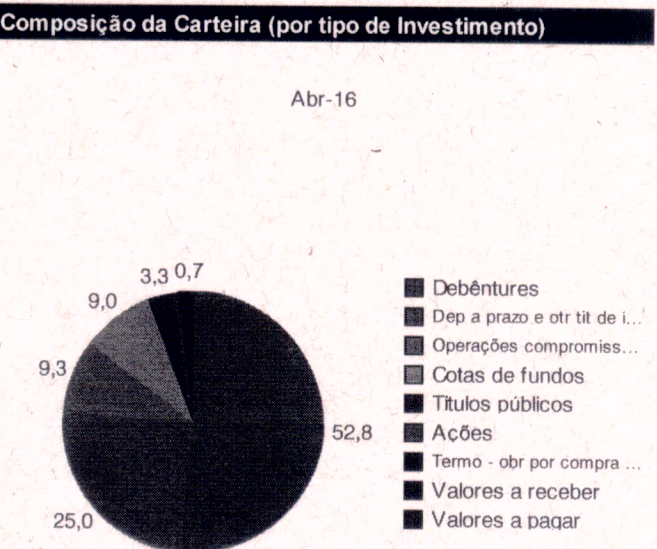
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa 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	19782311000188
Início do Fundo	28/04/2014
Código Anbima	369888
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Livre Grau de I...
Gestão	Az Legan Administracao de Recurs...
Custodiante	Banco BTG Pactual S/A
Administrador	BTG Pactual Servicos Financeiros S...
Taxa máx. adm. (%)	3,00
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	13/05/2016
Cota	1,276
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	73.210
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	60.425
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	-
Resolução 3922	Sim

Condições de Investimentos	
Aplicação inicial mínima	5.000
Aplicação adicional mínima	300
Resgate mínimo	300
Saldo mínimo	0
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+004
Prazo pgto resgate	D+005
Benchmark	CDI



Rentabilidades (%) (até 13/05/2016)													
	dez 2015	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	mai 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,17	0,84	0,99	1,22	1,11	0,54	-	13,51	4,79	14,24	27,20	-	27,60
● CDI	1,16	1,05	1,00	1,16	1,05	0,53	10,81	13,24	4,89	14,00	27,08	38,83	27,60
● IBOV	-3,93	-6,79	5,91	16,97	7,70	-3,91	-2,91	-13,31	19,50	-8,10	-3,90	-4,85	0,82



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)	
Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	1,25
Menor Retorno Mensal (%)	0,54
Retorno Acumulado (%)	14,24
Volatilidade	0,18
Sharpe	1,07
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,09

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.