

RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE

**RECI
PREV**

PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS
SERVIDORES
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: 77 /2016
	OF. Nº: 77 /2016 – GI
	Data: 08/06/2016
VALOR (R\$): 12.000.000,00 (Doze milhões de reais)	Dispositivo da Resolução do CMN: Art. 7º, IV, "a" e Art. 8º, IV

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO

Descrição da operação: Resgate no valor de R\$ 12.000.000,00 (Doze milhões de reais), do fundo BB Previdenciário RF Fluxo CNPJ: 13.077.415/0001-05, para ser aplicado conforme a seguir:

- R\$ 6.000.000,00 (Seis milhões de reais), no fundo BB Previdenciário RF Perfil FIC FI CNPJ: 13.077.418/0001-49;
- R\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais), no fundo XP Long Short FIC FIM CNPJ: 11.616.403/0001-86;
- R\$ 2.000.000,00 (Dois milhões de reais), no fundo Western Asset DI Referenciado FI CNPJ: 00.819.8975/0001-10.

As aplicações nos fundos BB Previdenciário RF Perfil FIC FI CNPJ: 13.077.418/0001-49, XP Long Short FIC FIM CNPJ: 11.616.403/0001-86 e Western Asset DI Referenciado FI CNPJ: 00.819.8975/0001-10, estão aderente à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.

Os fundos BB Previdenciário RF Perfil FIC FI CNPJ: 13.077.418/0001-49, XP Long Short FIC FIM CNPJ: 11.616.403/0001-86 e Western Asset DI Referenciado FI CNPJ: 00.819.8975/0001-10, 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 25.05.2016.

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, IV, "a"

Instituição Financeira: BB Gestão de Recursos DTVM S.A

CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69

Fundo: BB Previdenciário RF Perfil FIC FI

CNPJ do Fundo: 13.077.418/0001-49

Índice de Referência: CDI

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 6.038.311.000,00 (posição de 06/06/2016)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,10%

Segmento: Renda Variável

Tipo de Ativo: Renda Variável – Artigo 8º, IV

Instituição Financeira: XP Gestão de Recursos Ltda

CNPJ da Instituição Financeira: 07.625.200/0001-89

Fundo: XP Long Short FIM

CNPJ do Fundo: 11.616.403/0001-86;

Índice de Referência: CDI

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 530.038.000,00 (posição de 06/06/2016)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,75%

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Renda Fixa – Artigo 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

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 1.061.690.000,00 (posição de 07/06 /2016)

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,19%

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 Azeiteiro

Gerente Administrativo e Financeiro

CPF: 111.494.264-20

Recife, 08 de junho de 2016

Ofício RECIPREV nº 77/2016 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 12.000.000,00 (Doze milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO CNPJ: CNPJ: 13.077.415/0001-05, vinculado à conta 7.909-X, e efetuar as seguintes operações:

- a) Aplicar o valor de R\$ 6.000.000,00 (Seis milhões de reais), no fundo BB Previdenciário RF Perfil FIC FI CNPJ: 13.077.418/0001-49;
- b) Encaminhar TEDs conforme a seguir:

Banco: Banco Mellon (17)
Agência: 1
Conta: 1221-1
Favorecido: XP Long Short
CNPJ: 11.616.403/0001-86
Valor: R\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais)

Banco: Banco Citibank (745)
Agência: 0001
Conta: 01452720
Favorecido: Western Asset DI Referenciado FI
CNPJ: 00.819.875/0001-10
Valor: R\$ 2.000.000,00 (Dois milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 77/2016

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, 08 de junho de 2016

Ofício RECI-REV nº 27A/2016 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECI-REV CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais), no fundo XP Long Short FIC FIM CNPJ: 11.616.403/0001-86.

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 Mellon (17)
Agência: 1
Conta: 1221-1
Favorecido: XP Long Short
CNPJ: 11.616.403/0001-86
Valor: R\$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais)

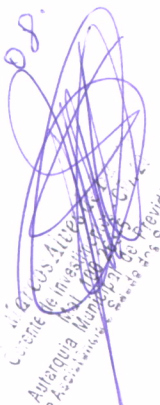
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 77/2016

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
Gerente Administrativo e Financeiro

Encaminhado por e-mail em 08.06.2016


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

Prezados (as) Senhores (as)
Lauter Ferreira/Caroline Sampaio
XP Investimentos
São Paulo - SP

Recife, 08 de junho de 2016

Ofício RECIprev nº 28A/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\$ 2.000.000,00 (Dois milhões de reais), no fundo Western Asset DI Referenciado FI CNPJ: 00.819.875/0001-10.

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 Citibank (745)
Agência: 0001
Conta: 01452720
Favorecido: Western Asset DI Referenciado FI
CNPJ: 00.819.875/0001-10
Valor: R\$ 2.000.000,00 (Dois milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 77/2016

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
Gerente Administrativo e Financeiro

Comunicado em 08/06/2016

Western Asset
Conta de Investimento
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência Social - Recife

Prezados (as) Senhores (as)
Elder Andrade
Western Asset
São Paulo - SP

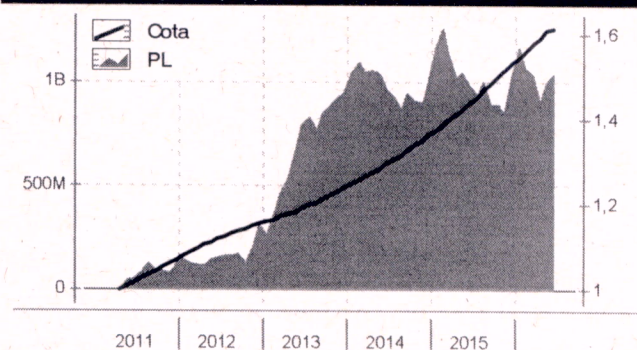
Características

CNPJ	13077415000105
Início do Fundo	28/04/2011
Código Anbima	272604
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Média Grau de I...
Gestão	BB Dsvm S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dsvm S.A
Taxa máx. adm. (%)	1,00
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	07/06/2016
Cota	1,6118
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.038.046
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	979.764
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

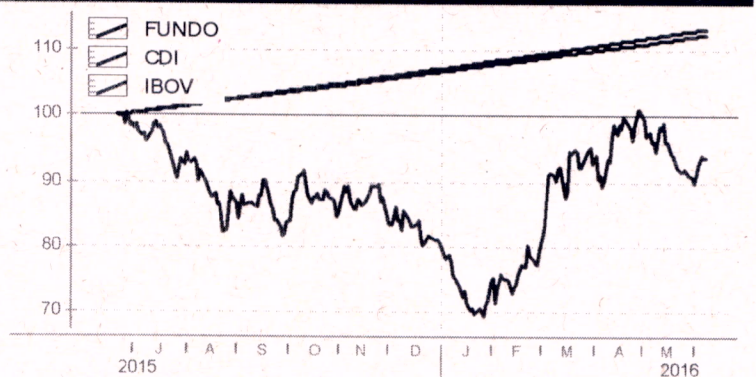
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



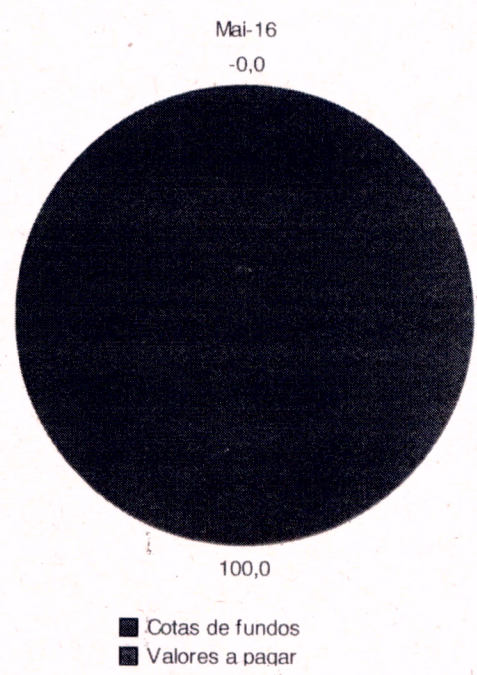
Retornos (%) (até 07/06/2016)

	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,98	0,91	1,05	0,92	1,07	0,25	9,97	12,36	5,30	13,03	25,14	35,93	61,18
● CDI	1,05	1,00	1,16	1,05	1,11	0,26	10,81	13,24	5,77	14,06	27,21	39,29	67,70
● IBOV	-6,79	5,91	16,97	7,70	-10,09	4,16	-2,91	-13,31	16,47	-4,69	-4,97	-2,19	-23,12

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 (%)	1,11
Menor Retorno Mensal (%)	0,25
Retorno Acumulado (%)	13,03
Volatilidade	0,04
Sharpe	-22,03
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.

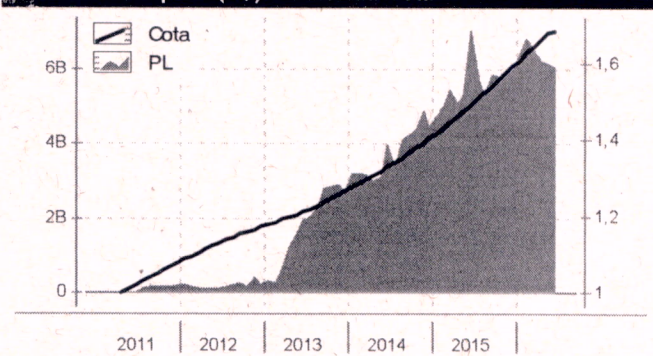
Características

CNPJ	13077418000149
Início do Fundo	28/04/2011
Código Anbima	272493
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Média Grau de I...
Gestão	BB Dsvm S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dsvm S.A
Taxa máx. adm. (%)	0,30
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	06/06/2016
Cota	1,684
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	6.038.311
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	6.044.132
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

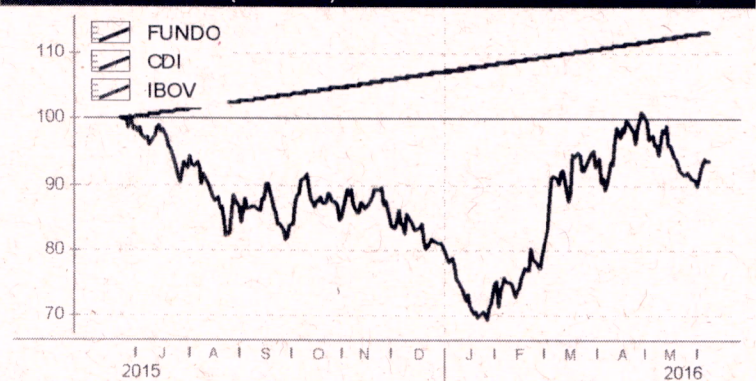
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



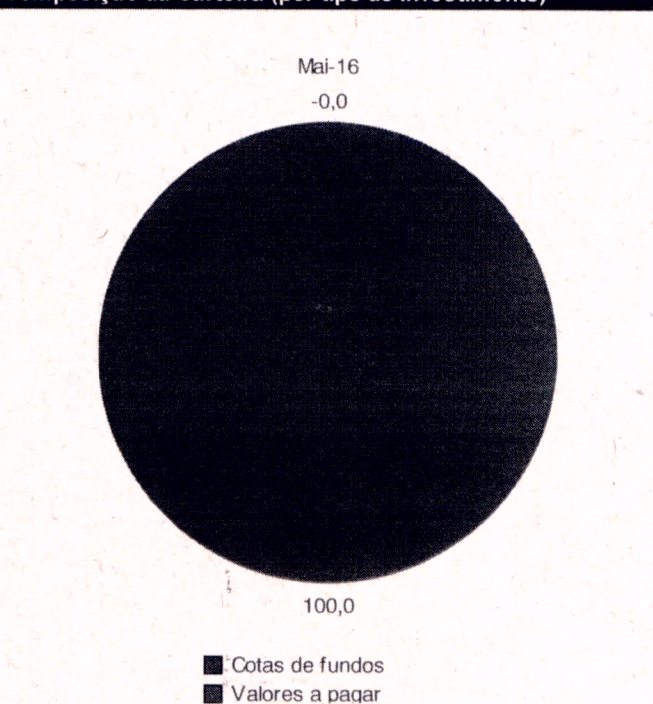
Retornos (%) (até 06/06/2016)

	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,05	0,97	1,11	0,98	1,14	0,22	11,02	13,46	5,60	13,97	27,39	39,54	68,40
● CDI	1,05	1,00	1,16	1,05	1,11	0,21	10,81	13,24	5,72	14,00	27,15	39,26	67,62
● IBOV	-6,79	5,91	16,97	7,70	-10,09	4,04	-2,91	-13,31	16,34	-4,80	-5,08	-4,64	*~23,21

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 (%)	1,20
Menor Retorno Mensal (%)	0,22
Retorno Acumulado (%)	13,97
Volatilidade	0,05
Sharpe	-0,84
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	11616403000186
Início do Fundo	12/03/2010
Código Anbima	244139
Classificação Anbima	Multimercados L/S - Neutro
Gestão	Xp Gestao de Recursos
Custodiante	BNY Mellon Banco S.A.
Administrador	BNY Mellon Servicos Financeiros Dt...
Taxa m.áx. adm. (%)	2,50
Taxa performance	20% que exceder 100% do CDI

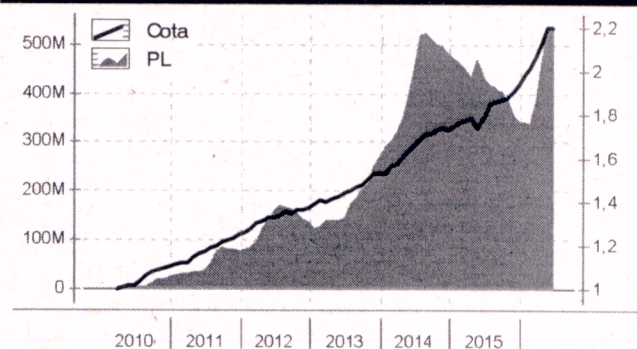
Data da Última Cotação	06/06/2016
Cota	2,1986
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	530.038
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	407.626

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

Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	10.000
Aplicação adicional mínima	1.000
Resgate mínimo	1.000
Saldo mínimo	1.000
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+001
Prazo pgto resgate	D+002
Benchmark	CDI

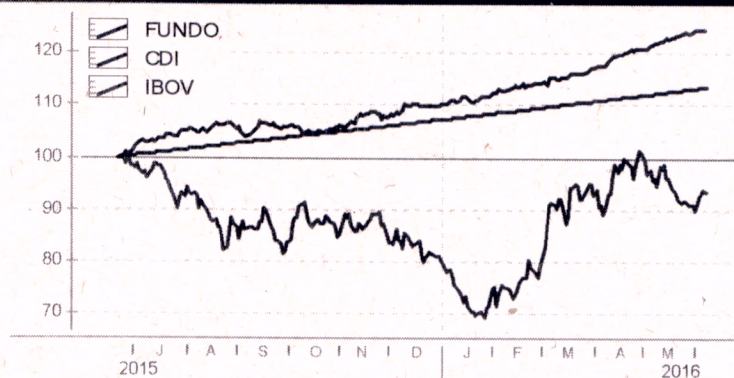
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



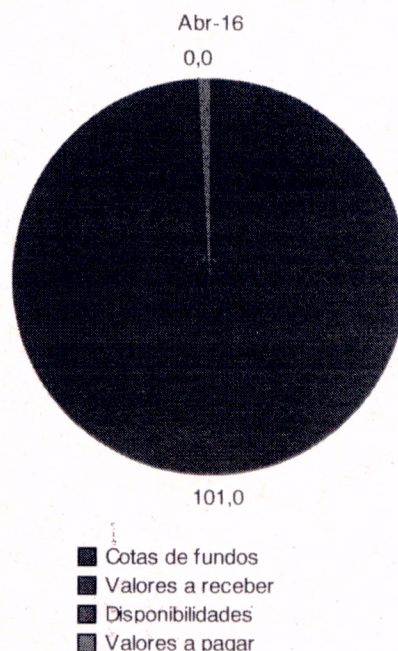
Retornos (%) (até 06/06/2016)

	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,97	1,85	2,64	3,03	2,94	0,19	13,34	12,01	13,28	25,85	34,05	54,24	119,86
● CDI	1,05	1,00	1,16	1,05	1,11	0,21	10,81	13,24	5,72	14,00	27,15	39,26	87,35
● IBOV	-6,79	5,91	16,97	7,70	-10,09	4,04	-2,91	-13,31	16,34	-4,80	-5,08	-4,64	-27,27

Retorno Acumulado (252 dias)



Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



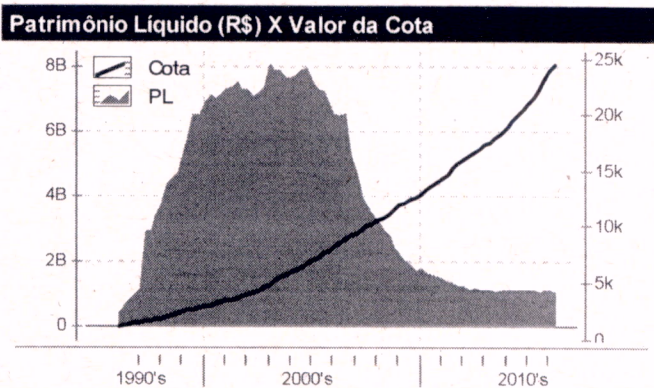
Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	3,62
Menor Retorno Mensal (%)	0,19
Retorno Acumulado (%)	25,85
Volatilidade	5,16
Sharpe	2,05
VAR de 1 mês - 95% (%)	2,44

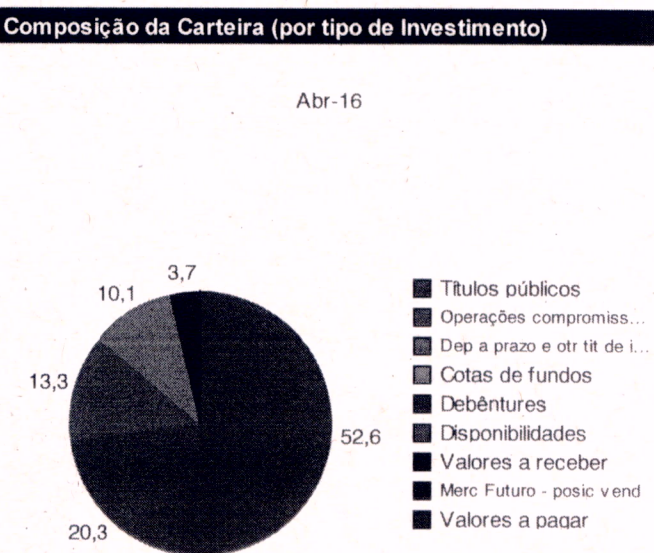
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa 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 Dtvn SA
Administrador	Western Asset
Taxa máx. adm. (%)	0,00
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	07/06/2016
Cota	24.486
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.061.690
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.090.824
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 07/06/2016)													
	jan 2016	fev 2016	mar 2016	abr 2016	mai 2016	jun 2016	2014	2015	2016	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,06	0,94	1,12	1,04	1,13	0,27	11,10	13,36	5,69	13,98	27,42	39,82	2.148,36
● CDI	1,05	1,00	1,16	1,05	1,11	0,26	10,81	13,24	5,77	14,06	27,21	39,29	2.049,38
● IBOV	-6,79	5,91	16,97	7,70	-10,09	4,16	-2,91	-13,31	16,47	-4,69	-4,97	-2,19	f.050,05



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)	
Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	1,20
Menor Retorno Mensal (%)	0,27
Retorno Acumulado (%)	13,98
Volatilidade	0,12
Sharpe	-0,65
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.