



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:</b>	<b>081 /2020 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>	<b>OF. Nº:</b>	<b>081 /2020 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores <b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>	<b>Data:</b>	<b>27/05/20</b>
<b>Valor:</b>		
R\$ 140.185.092,50	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Ceento e quarenta milhões, cento e oitenta e cinco mil, noventa e dois reais e cinquenta centavos		

Sim para todos os fundos desta APR

**HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:**

<b>Fundo:</b>	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	25.078.994/0001-90		
<b>Segmento:</b>	FI 100% Títulos Públicos		
<b>Tipo de Ativo:</b>	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Aplicação		
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 119.479.211,02		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	81.577.313,74436340		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$	1,4646132060	
<b>Data da Operação:</b>	27/05/2020		
<b>Data de Liquidação:</b>	27/05/2020		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 10.667.612.300,00		
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	1,120%		
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>	15,00%		
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
<b>Administrador:</b>	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	30.822.936/0001-69		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	08/10/2019		
<b>Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Administrador com RPPS</b>	R\$ 58.868.039.000,00		
<b>% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.</b>	5,58%		
<b>Gestor:</b>	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	30.822.936/0001-69		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	08/10/2019		
<b>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	R\$	57.097.246.960,66	
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>	5,41%		
<b>Empresa de Rating</b>	Fitch Ratings		
<b>Conceito</b>	Excelente		
<b>Representação do conceito</b>	Excelente		
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN</b>	Sim		
<b>Distribuidor:</b>	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	00.000.000/0001-91		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	16/10/2019		

Data de Início FI:	29/08/2016	
Taxa Administração do FI (%):	0,30 a 0,50	
Índice de Referência do FI :	IMA GERAL EX-C	
Tx Performance do FI (%):	Não possui	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0 dias	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	3	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Sim	
CNPJ do Fundo:	11.839.250/0001-36;05.949.051/0001-88;07.995.631/0001-37;07.442.078/0001-05 ;18.027.394/0001-37	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
% Carteira do Fundo:	35,95;35,24;21,85;5,13	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	Proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em carteira composta por ativos financeiros de renda fixa, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou OBJETIVOS DO FUNDO: proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em carteira composta por ativos financeiros de renda fixa, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA), não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Taxa de Juros (Risco 5)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal	0,85%	
Retorno Médio Anual	10,66%	
Retorno Total	44,99%	

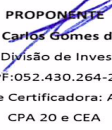
Maior Retorno	3,50%
Menor Retorno	-2,10%
Qtde. mês Positivo	37
Qtde. mês Negativo	7
Qtde. mês acima do Benchmark	25
Qtde. mês abaixo do Benchmark	19
Risco Mensal Período	1,04%
Risco Mensal 12 MESES	1,24%
Risco Anual do Período	3,60%
Retorno Relativo ao Benchmark	-0,68%
Sharpe	0,83
Information Ratio	-0,57
Tracking Error	0,36%
VAR HISTÓRICO (95%)	2,56%
VAR 12 MESES (95%)	2,40%
Sharpe Modificado	1,07
Beta (12 meses)	1,00
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,10%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos 19/05/2020
Outras Observações:	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo


O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI
CNPJ do Fundo:	11.328.882/0001-35
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 20.705.881,48
Quantidade de Cotas:	7.697.227,35246741
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,6900441590
Data da Operação:	27/05/2020
Data de Liquidação:	27/05/2020
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 7.656.027.570,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,270%
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A. 3234-4 7.909-X
Administrador:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Administrador:	30.822.936/0001-69
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	08/10/2019
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 58.868.039.000,00
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	5,58%
Gestor:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	08/10/2019
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$ 57.097.246.960,66
% Recursos do Gestor com RPPS	5,41%
Empresa de Rating	Fitch Ratings
Conceito	Excelente
Representação do conceito	Excelente
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	08/10/2019
Data de Início FI:	08/12/2009
Taxa Administração do FI (%):	0,30
Índice de Referência do FI:	IRFM-1
Tx Performance do FI (%):	Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado
Carência (dias):	0 dias
Data Listagem Bolsa:	Não listado
Resgate (dias):	0
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Sim
CNPJ do Fundo:	11.839.250/0001-36
Segmento:	Renda Fixa
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
% Carteira do Fundo:	100,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.

Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O fundo busca retorno compatível com o do sub-índice IRFM-1. Para isso, aplica seus recursos em fundos que apliquem exclusivamente em títulos públicos federais, devendo, ainda, manter 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou índices de preços.	
	Principais riscos do fundo:	Risco de Taxa de Juros (Risco 1)	
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Baixo	
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo		
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>			
Retorno Médio Mensal	0,78%		
Retorno Médio Anual	9,81%		
Retorno Total	139,46%		
Maior Retorno	1,62%		
Menor Retorno	0,18%		
Qtde. mês Positivo	112		
Qtde. mês Negativo	0		
Qtde. mês acima do Benchmark	6		
Qtde. mês abaixo do Benchmark	106		
Risco Mensal Período	0,27%		
Risco Mensal 12 MESES	0,13%		
Risco Anual do Período	0,95%		
Retorno Relativo ao Benchmark	-2,51%		
Sharpe	0,24		
Information Ratio	-5,66		
Tracking Error	0,05%		
VAR HISTÓRICO (95%)	1,23%		
VAR 12 MESES (95%)	0,96%		
Sharpe Modificado	1,81		
Beta (12 meses)	0,93		
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,03%		
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate		
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações		
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	19/05/2020	
Outras Observações:			
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>			
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"			
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo		
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo		
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo		
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo		
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo		
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo		
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>			
Art. 7º, VII, "a"			
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo		
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo		
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo		
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo		
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo		
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>			
Art. 8º, IV, "a"			

O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo

Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)

**PROPOSTANTE**  
  
Andresson Carlos Gomes de Oliveira  
Chefe de Divisão de Investimentos  
CPF: 052.430.264-25  
Entidade Certificadora: ANBIMA  
CPA 20 e CEA  
Validade da Certificação: 05/12/2020

**GESTOR AUTORIZADO**  
  
José Carlos Gomes de Barros  
Chefe de Investimentos  
CPF: 334.326.354-00  
Entidade Certificadora: ANBIMA  
CPA 20 e CEA  
Validade da Certificação: 21/11/2021

Recife, 27 de maio de 2020

Ofício nº 081/2020 G

Ilmo Senhor  
**PEDRO PAULO**  
Gerente de Relacionamento  
**Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE**  
NESTA

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar as seguintes aplicações, vinculado à conta 7.909-X.

- a) Aplicar o valor de R\$ 119.479.211,02 (Cento de dezenove milhões, quatrocentos e setenta e nove mil, duzentos e onze reais e dois centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 25.078.994/0001-90;
- b) Aplicar o valor de R\$ 20.705.881,48 (Vinte milhões, setecentos e cinco mil, oitocentos e oitenta e um reais e quarenta e oito centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 11.328.882/0001-35.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 081/2020

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

  
**ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES**  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO





Datas e horários baseados no fuso horário (GMT -3:00) em Brasília, Brasil  
**Sincronizado com o NTP.br e Observatório Nacional (ON)**  
Certificado de assinatura gerado em 27/05/2020 às 09:46:47 (GMT -3:00)

Ofício 081 27.05.2020.pdf

ID única do documento: #0b61cc8b-38ec-4bdb-ae31-d4376112638f

Hash do documento original (SHA256): 7be4eb9792a72fbc0e2a0313107348b69a067e850f6bddd11bbe5111aefe3e

Este Log é exclusivo ao documento número #0b61cc8b-38ec-4bdb-ae31-d4376112638f e deve ser considerado parte do mesmo, com os efeitos prescritos nos Termos de Uso.

## Assinaturas (2)

- ✓ José Marcos Alves de Barros (Participante)  
Assinou em 27/05/2020 às 09:47:11 (GMT -3:00)
- ✓ Elcio Guimaraes (Participante)  
Assinou em 27/05/2020 às 10:39:09 (GMT -3:00)

## Histórico completo

Data e hora	Evento
27/05/2020 às 09:46:47 (GMT -3:00)	José Marcos Alves de Barros solicitou as assinaturas.
27/05/2020 às 10:39:09 (GMT -3:00)	Elcio Guimaraes E-mail elcio.guimaraes@recife.pe.gov.br, IP: 179.181.54.11 assinou.
27/05/2020 às 09:47:11 (GMT -3:00)	José Marcos Alves de Barros E-mail zemarcos@recife.pe.gov.br, IP: 187.105.9.46 assinou.



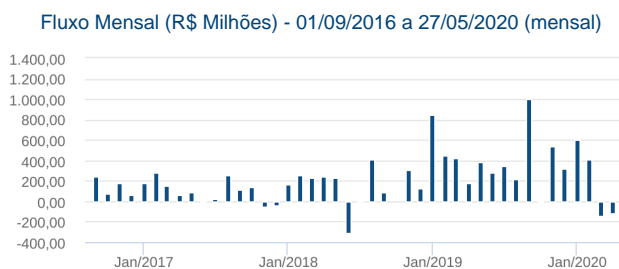
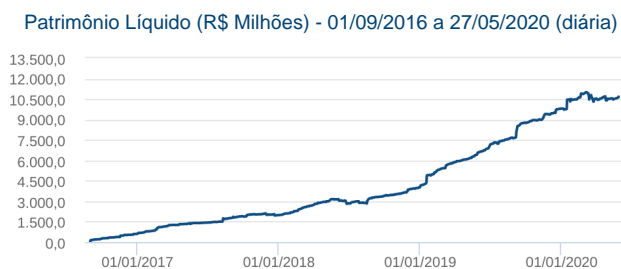
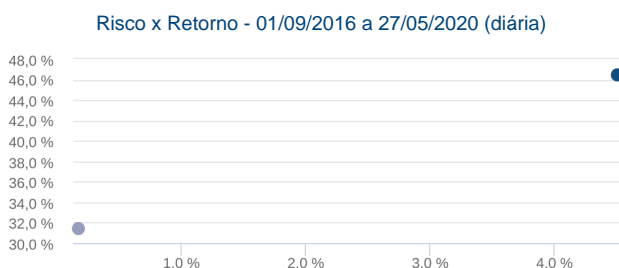
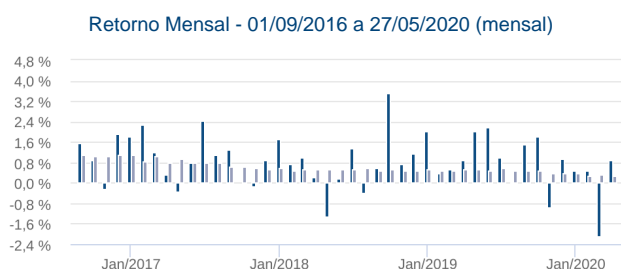
Características	Informações Operacionais
CNPJ: 25.078.994/0001-90	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 300.000,00
Taxa de Administração: 0,30%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+3 du
Código de Referência: 423041	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du
Início do Fundo: 31/08/2016	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19
Fundo	46,46	0,74	8,13	21,84	35,59	0,91	-2,10	0,46	0,49	0,96	-0,94	1,80	1,50	0,08	1,02	2,17	2,02
% do CDI	148,19	48,83	165,13	187,72	174,22	320,29	-620,99	155,24	129,00	255,89	-246,60	375,35	323,21	16,89	179,14	462,90	371,55
CDI	31,35	1,52	4,92	11,64	20,43	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54
Ibovespa	51,89	-23,95	-8,76	9,76	42,60	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70
IBX	54,60	-23,68	-7,52	12,76	45,33	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14
IGP-M	19,00	2,76	6,55	14,94	19,18	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,464613206	10.667.612,30	9.126.436,62	6,06%	-5,49%	2,88%	3,83	6,05%	2,17%	-2,10%	8
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,28%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI



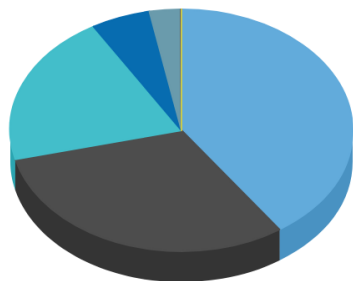
Composição da Carteira

abr/2020

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
BB TOP RF AGRESSIVO PRÉ FI RENDA FIXA LP	40,30	1,23	574,99	639,35	136,01	639,35	136,01	639,35	136,01	-	
BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA	30,85	0,34	160,56	7,90	119,93	7,90	119,93	7,90	119,93	-	
BB TOP RF ÍNDICE DE PREÇO FI RENDA FIXA LP	20,26	1,49	697,21	369,47	156,01	369,47	156,01	369,47	156,01	-	
BB TOP IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	5,59	1,25	587,11	4,06	83,34	4,06	83,34	4,06	83,34	-	
BB TOP IMA-B 5 ALOCAÇÃO FI RENDA FIXA	2,94	1,92	899,97	9,07	186,04	9,07	186,04	9,07	186,04	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	
Cotas de Fundos	99,95%	99,99%	99,93%	99,99%	100,00%	100,00%	100,00%	99,96%	
Valores a receber	0,05%	0,01%	0,07%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,04%	
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	10.512.346,44	10.536.452,77	10.908.803,62	10.446.730,36	9.800.245,40	9.385.285,18	8.931.824,90	8.760.808,47	
Data da Divulgação	07/05/2020	08/04/2020	06/03/2020	05/02/2020	06/01/2020	05/12/2019	05/11/2019	03/10/2019	
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)									abr/2020



■ Cotas de BB TOP RF AGRESSIVO PRÉ FI RENDA FIXA LP	40,30 %
■ Cotas de BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA	30,85 %
■ Cotas de BB TOP RF ÍNDICE DE PREÇO FI RENDA FIXA LP	20,26 %
■ Cotas de BB TOP IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	5,59 %
■ Cotas de BB TOP IMA-B 5 ALOCAÇÃO FI RENDA FIXA	2,94 %
■ Outros Valores a receber	0,05 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Controladoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 11.328.882/0001-35	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,10%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,30%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 239003	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 08/12/2009	

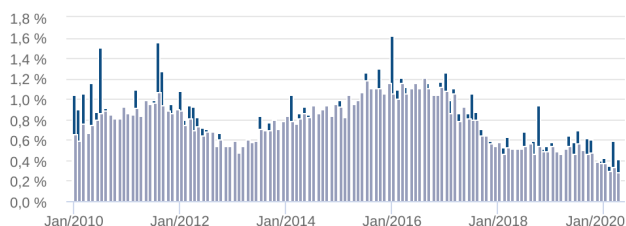
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19
Fundo	169,00	2,14	6,08	13,39	22,96	0,41	0,60	0,35	0,42	0,40	0,31	0,60	0,62	0,52	0,70	0,57	0,65
% do CDI	105,88	140,91	123,49	115,07	112,43	144,71	176,61	120,16	111,34	106,06	80,68	124,93	133,55	103,03	123,14	122,12	118,92
CDI	159,62	1,52	4,92	11,64	20,43	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54
Ibovespa	29,85	-23,95	-8,76	9,76	42,60	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70
IBX	72,72	-23,68	-7,52	12,76	45,33	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14
IGP-M	92,54	2,76	6,55	14,94	19,18	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2.690044159	7.656.027,57	7.696.718,49	0,54%	-0,26%	0,26%	0,95	0,54%	0,70%	0,31%	10
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,28%	0

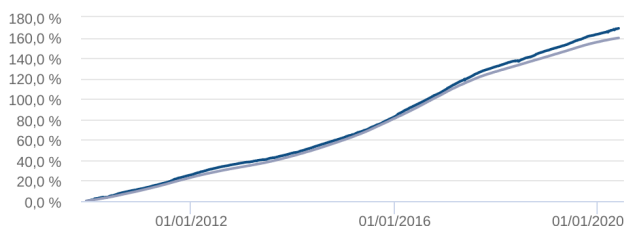
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

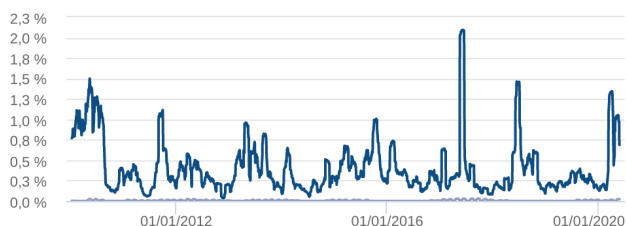
Retorno Mensal - 09/12/2009 a 27/05/2020 (mensal)



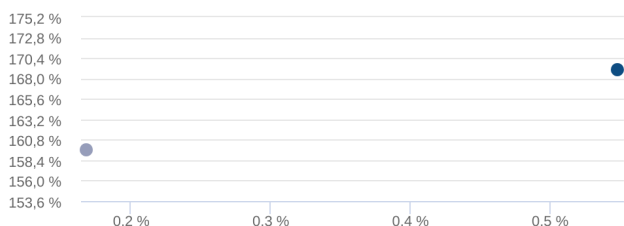
Retorno Acumulado - 09/12/2009 a 27/05/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 09/12/2009 a 27/05/2020 (diária)



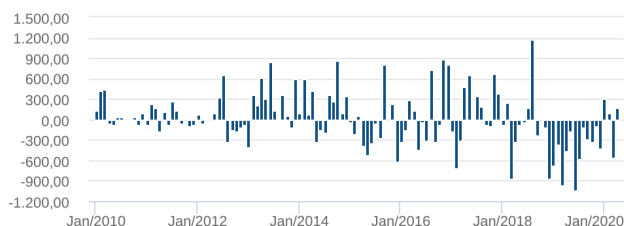
Risco x Retorno - 09/12/2009 a 27/05/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 09/12/2009 a 27/05/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 09/12/2009 a 27/05/2020 (mensal)



Composição da Carteira

abr/2020

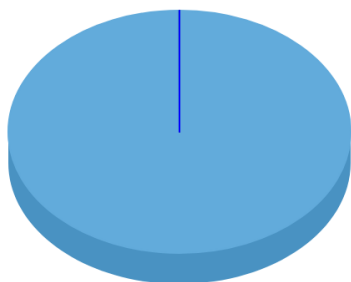
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

**:: BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

27/05/2020

Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	100,00	0,34	161,15	152,87	105,04	152,87	105,04	152,87	105,04	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)										
Tipo de Aplicação	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19		
Cotas de Fundos	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%		
Valores a pagar	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%		
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	7.168.032,69	6.969.533,40	7.492.585,72	7.374.284,21	7.033.827,03	7.434.585,42	7.511.019,29	7.803.027,91		
Data da Divulgação	05/05/2020	03/04/2020	04/03/2020	04/02/2020	03/01/2020	04/12/2019	04/11/2019	03/10/2019		
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)										abr/2020



■ Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	100,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Anbid	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.  
Fonte: Quantum Axis.



Datas e horários baseados no fuso horário (GMT -3:00) em Brasília, Brasil  
**Sincronizado com o NTP.br e Observatório Nacional (ON)**  
Certificado de assinatura gerado em 29/05/2020 às 11:15:02 (GMT -3:00)

APR 081 2020.pdf

 ID única do documento: #645e2831-7a80-4a69-bb9e-b791f552c1ee

Hash do documento original (SHA256): f8aab91430f8a5cb31d4569f8e02c76ff48abdc004118cb3573a15f15e2bd12d

Este Log é exclusivo ao documento número #645e2831-7a80-4a69-bb9e-b791f552c1ee e deve ser considerado parte do mesmo, com os efeitos prescritos nos Termos de Uso.

---

## Assinaturas (2)

- ✓ José Marcos Alves de Barros (Participante)  
Assinou em 29/05/2020 às 11:17:39 (GMT -3:00)
- ✓ Andreson C G Oliveira (Participante)  
Assinou em 29/05/2020 às 11:16:48 (GMT -3:00)

---

## Histórico completo

Data e hora	Evento
29/05/2020 às 11:17:39 (GMT -3:00)	José Marcos Alves de Barros E-mail zemarcos@recife.pe.gov.br, IP: 187.105.9.46 assinou.
29/05/2020 às 11:15:02 (GMT -3:00)	José Marcos Alves de Barros solicitou as assinaturas.
29/05/2020 às 11:16:48 (GMT -3:00)	Andreson C G Oliveira E-mail andreson@recife.pe.gov.br, IP: 179.54.208.120 assinou.