



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

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR		Nº / ANO:	248 /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	248 /2019 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:	08/11/2019		
R\$ 5.681,57	FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"		
Cinco mil, seiscentos e oitenta e um reais e cinquenta e sete centavos	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSECTORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)		
CNPJ do Fundo:	13.633.964/0001-19		
Segmento:	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior		
Tipo de Ativo:	FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 5.681,57		
Quantidade de Cotas:	2.809,79734665		
Valor da Cota (R\$):	R\$	2,02	
Data da Operação:	08/11/2019		
Data de Liquidação:	08/11/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	43.168,36	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	13,161%		
Limite Máximo por PL do fundo	5,00%		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.		
CNPJ do Administrador:	62.285.390/0001-40		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	24/09/2019		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 64.500.000,00		
% 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.	0,20%		
Gestor:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.		
CNPJ do Gestor:	62.285.390/0001-40		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	24/09/2019		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	64.500.000,00	
% Recursos do Gestor com RPPS	1,87%		
Empresa de Rating	Standard&Poor's		
Conceito	AMP-3		
Representação do conceito	Bom		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Não		
Distribuidor:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.		
CNPJ do Distribuidor:	62.285.390/0001-40		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	24/09/2019		

Data de Início FI:		18/05/2012
Taxa Administração do FI (%):		0,20
Índice de Referência do FI :		125% do DI
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:		Sem rating
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		Sem rating
Carência (dias):		Pagamento em regime de caixa
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		Pagamento em regime de caixa
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR QUALIFICADO
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Não
CNPJ do Fundo:		0,00
Segmento:		R\$ 0,00
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		0,00
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:	Fundo em processo de recuperação dos valores aplicados em decorrência de diversos fatos, dentre eles, inadimplência elevada.
	Principais riscos do fundo:	O principal fato de risco do Fundo é a liquidez dos direitos creditórios que está ligado diretamente a atividade econômica dos Cedentes e Sacados envolvidos na operação comercial, fato gerador dos direitos creditórios. (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	Médio Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	3,17%	
Retorno Médio Anual	45,49%	
Retorno Total	763,64%	

Maior Retorno	740,83%
Menor Retorno	-73,86%
Qtde. mês Positivo	59
Qtde. mês Negativo	10
Qtde. mês acima do Benchmark	45
Qtde. mês abaixo do Benchmark	23
Risco Mensal Período	108,74%
Risco Mensal 12 MESES	233,22%
Risco Anual do Período	376,68%
Retorno Relativo ao Benchmark	330,77%
Sharpe	0,09
Information Ratio	0,10
Tracking Error	339,88%
VAR HISTÓRICO (95%)	199,91%
VAR 12 MESES (95%)	299,88%
Sharpe Modificado	0,09
Beta (12 meses)	1.710,27
Erro Quadrático Médio (EQM)	98,42%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recursos em razão do longo prazo de carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECI/REV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos 22/10/2019
Outras Observações:	Amortização
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
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?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Sim
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Sim
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Sim
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Sim
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Sim
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Não comprovado
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Não
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Sim
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
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 FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
CNPJ do Fundo:	13.077.415/0001-05
Segmento:	FI Renda Fixa - Geral
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 5.681,57
Quantidade de Cotas:	2.744,81957101
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,069924763
Data da Operação:	08/11/2019
Data de Liquidação:	08/11/2019
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.363.818.550,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,00%
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\$ 63.575.332.000,00
% 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.	6,04%
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\$ 62.097.658.012,54
% Recursos do Gestor com RPPS	5,88%
Empresa de Rating	Fitch Ratings
Conceito	Excelente
Representação do conceito	Excelente
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	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:	16/10/2019
Data de Início FI:	28/04/2011
Taxa Administração do FI (%):	1,00
Índice de Referência do FI:	CDI
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

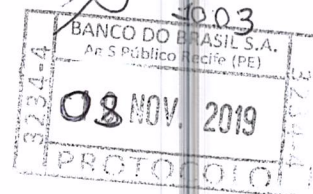
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	0	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Sim	
CNPJ do Fundo:	27.146.328/0001-77	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
% 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 tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento que atendam aos limites e garantias exigidas pela Resolução 3922/10 do CMN. O fundo deve manter 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou índices de preços. Para tanto, irá aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento de renda fixa com essas mesmas características e em títulos públicos federais e/ou em suas operações compromissadas, no limite de 5% do patrimônio líquido.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Taxa de Juros (Risco 2)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco 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	
Dados com base desde 2011 ou início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,71%	
Retorno Médio Anual	8,92%	
Retorno Total	106,73%	
Maior Retorno	1,17%	
Menor Retorno	0,37%	
Qtde. mês Positivo	102	
Qtde. mês Negativo	0	
Qtde. mês acima do Benchmark	1	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	100	
Risco Mensal Período	0,23%	
Risco Mensal 12 MESES	0,03%	
Risco Anual do Período	0,80%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-7,01%	
Sharpe	-1,30	
Information Ratio	-13,73	
Tracking Error	0,07%	
VAR HISTÓRICO (95%)	1,09%	
VAR 12 MESES (95%)	0,79%	
Sharpe Modificado	-44,90	
Beta (12 meses)	0,81	
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,07%	
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 RECPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	22/10/2019
Outras Observações:		

Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
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?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
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
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
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)	
<p>PROponente José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF:334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</p>	<p>Gestor/Autorizador José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF:334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021</p>

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife-PE, 08 de novembro de 2019




Ofício RECI PREV nº 248/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 5.681,57 (Cinco mil, seiscentos e oitenta e um reais e cinquenta e sete centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05; vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 248/2019

Atenciosamente,



JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

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



**PREFEITURA DO
RECIFE**
SECRETARIA DE ADMINISTRAÇÃO

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

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 13.077.415/0001-05	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: 1,00%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 272604	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 28/04/2011	

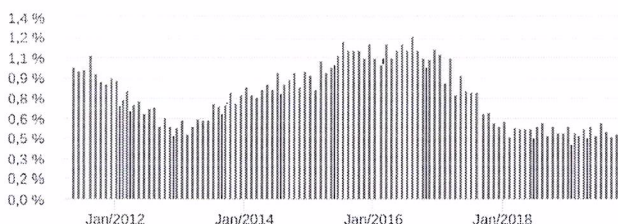
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18
Fundo	106,99	4,31	5,03	10,74	21,82	0,38	0,37	0,41	0,47	0,39	0,45	0,43	0,39	0,41	0,45	0,41	0,41
% do CDI	87,26	81,52	81,52	81,59	85,08	80,14	80,30	81,14	82,14	82,36	82,70	82,88	82,41	82,54	82,50	82,32	82,55
CDI	122,62	5,28	6,17	13,16	25,64	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49	0,54	0,49	0,49
Ibovespa	63,89	22,46	25,67	48,63	74,73	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38
IBX	110,46	23,52	27,58	50,52	77,38	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66
IGP-M	60,28	4,92	3,43	14,32	12,82	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	2,069924763	1.363.818,55	1.300.288,52	0,02%	-	0,01%	0,85	0,01%	0,47%	0,37%	0
CDI	-	-	-	0,02%	-	0,01%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

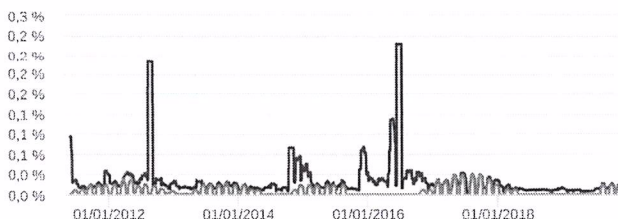
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 08/11/2019 (mensal)



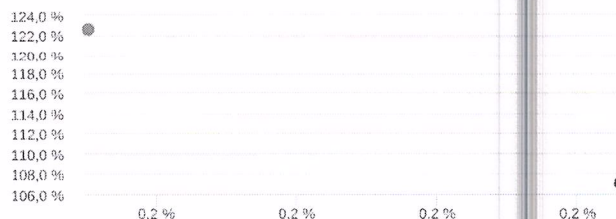
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 08/11/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 08/11/2019 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 08/11/2019 (diária)



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.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 08/11/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 08/11/2019 (mensal)



Composição da Carteira

out/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

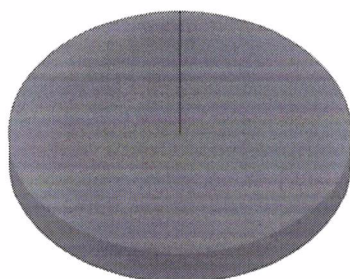
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses PL Médio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,11	97,93	18,31	98,36	18,31	98,36	18,31	98,36	-	R\$ 1.299.947.549,9

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.271.131,29	1.489.281,05	1.111.950,35	1.113.168,70	1.335.732,61	1.201.824,73	1.248.000,72	1.204.603,03
Data da Divulgação	04/11/2019	03/10/2019	03/09/2019	02/08/2019	02/07/2019	05/06/2019	06/05/2019	02/04/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2019



■ Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Anbid	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.



JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>

Acertos

SANDRA MARIA GOMES GALINDO <sandra.galindo@recife.pe.gov.br>

11 de novembro de 2019 09:45

Para: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>

Cc: ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA <annap@recife.pe.gov.br>

Zé Marcos, bom dia!

Solicitamos o resgate de aplicações financeira da conta 65000-5 do Bradesco no valor de **R\$ 29.403,72**(vinte e nove mil, quatrocentos e três reais e setenta e dois centavos), referente acertos(**CENSO**) de junho a setembro/19 de **APO/PPR**, transmitido eletronicamente pela EMPREL com data de pagamento para **11/11/2019, FUNDO RECIPREV.**

Sandra Galindo
3355-1645

Código	Nome do Ativo	Data	Cota/Preço de Fechamento Ajustado	PI
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	01/11/2019	2,66278188	R\$ 56.847,03
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	04/11/2019	1,77408434	R\$ 37.874,46
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	05/11/2019	1,72484115	R\$ 36.823,18
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	06/11/2019	5,09758635	R\$ 108.827,03
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	07/11/2019	2,10526178	R\$ 44.944,68
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	08/11/2019	2,02205686	R\$ 43.168,36
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	11/11/2019	2,96613613	R\$ 63.323,26
378402	INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	12/11/2019	2,91456587	R\$ 62.222,30