



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



**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:	252 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	252 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	18/11/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13		Valor:		
		18/11/2019		
R\$ 8.766.054,40		Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, "a"		
Oito milhões, setecentos e sessenta e seis mil, cinquenta e quatro reais e quarenta centavos		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Sim para todos os fundos desta APR				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219 (7604)			
CNPJ do Fundo:	-			
Segmento:	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)			
Tipo de Ativo:	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, "a"			
Tipo de operação realizada:	Resgate			
Valor da operação:	R\$ 958.153,00			
Quantidade de Cotas:	-			
Valor da Cota (R\$):	-			
Data da Operação:	18/11/2019			
Data de Liquidação:	18/11/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	-			
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	-			
Limite Máximo por PL do fundo	-			
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X	
Administrador:	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)			
CNPJ do Administrador:	-			
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	-			
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	-			
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 0,00			
% 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.	0,00%			
Gestor:	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)			
CNPJ do Gestor:	-			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	-			
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	-			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	-			
% Recursos do Gestor com RPPS	0,00%			
Empresa de Rating	-			
Conceito	-			
Representação do conceito	-			
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	-			
Distribuidor:	TESOURO NACIONAL			
CNPJ do Distribuidor:	-			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	-			

Data de Início FI:	02/10/2008	
Taxa Administração do FI (%):	Tarifa de custódia + Custo Selic	
Índice de Referência do FI :	IPCA+7.002299%%	
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):	Até o dia 15/05/2045	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	1	
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:	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:	Títulos Públicos do Governo Federal
	Principais riscos do fundo:	Risco de volatilidade dos títulos (Risco: 1)
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	0,66%	
Retorno Médio Anual	8,22%	
Retorno Total	100,91%	

Maior Retorno	11,73%
Menor Retorno	-22,16%
Qtde. mês Positivo	66
Qtde. mês Negativo	40
Qtde. mês acima do Benchmark	53
Qtde. mês abaixo do Benchmark	52
Risco Mensal Período	4,38%
Risco Mensal 12 MESES	6,71%
Risco Anual do Período	15,19%
Retorno Relativo ao Benchmark	-32,60%
Sharpe	-0,12
Information Ratio	-0,32
Tracking Error	15,26%
VAR HISTÓRICO (95%)	7,97%
VAR 12 MESES (95%)	6,31%
Sharpe Modificado	-0,12
Beta (12 meses)	-2,01
Erro Quadrático Médio (EQM)	4,39%
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 22/10/2019
Outras Observações:	Pagamento de juros
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?	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
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
Fundo:	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220 (7608)
CNPJ do Fundo:	-
Segmento:	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)
Tipo de Ativo:	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, "a"
Tipo de operação realizada:	Resgate
Valor da operação:	R\$ 2.060.028,95
Quantidade de Cotas:	-
Valor da Cota (R\$):	-
Data da Operação:	18/11/2019
Data de Liquidação:	18/11/2019
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	-
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	-
Limite Máximo por PL do fundo	-
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A. 3234-4 7.909-X
Administrador:	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Administrador:	-
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	-
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	-
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 0,00
% 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.	0,00%
Gestor:	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Gestor:	-
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	-
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	-
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	-
% Recursos do Gestor com RPPS	-
Empresa de Rating	-
Conceito	-
Representação do conceito	-
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	-
Distribuidor:	TESOURO NACIONAL
CNPJ do Distribuidor:	-
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	-
Data de Início FI:	06/10/2008
Taxa Administração do FI (%):	Tarifa de custódia + Custo Selic
Índice de Referência do FI :	IPCA+7.002655%
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):	Até o dia 15/05/2045
Data Listagem Bolsa:	Não listado

Resgate (dias):		1
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:		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:	Títulos Públicos do Governo Federal
	Principais riscos do fundo:	Risco de volatilidade dos títulos (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		Médio Prazo
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal		0,66%
Retorno Médio Anual		8,22%
Retorno Total		100,90%
Maior Retorno		11,73%
Menor Retorno		-22,17%
Qtde. mês Positivo		66
Qtde. mês Negativo		40
Qtde. mês acima do Benchmark		53
Qtde. mês abaixo do Benchmark		52
Risco Mensal Período		4,38%
Risco Mensal 12 MESES		6,72%
Risco Anual do Período		15,19%
Retorno Relativo ao Benchmark		-32,60%
Sharpe		-0,12
Information Ratio		-0,32
Tracking Error		15,26%
VAR HISTÓRICO (95%)		7,97%
VAR 12 MESES (95%)		6,31%
Sharpe Modificado		-0,12
Beta (12 meses)		-2,01
Erro Quadrático Médio (EQM)		4,39%
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 22/10/2019	
Outras Observações:	Pagamento de juros	
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?		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
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, mantém 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)			
Fundo:	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 (7647)		
CNPJ do Fundo:	-		
Segmento:	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)		
Tipo de Ativo:	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 958.153,00		
Quantidade de Cotas:	-		
Valor da Cota (R\$):	-		
Data da Operação:	18/11/2019		
Data de Liquidação:	18/11/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	-		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	-		
Limite Máximo por PL do fundo	-		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)		
CNPJ do Administrador:	-		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	-		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	-		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 0,00		
% 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.	0,00%		
Gestor:	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)		
CNPJ do Gestor:	-		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	-		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	-		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	-		

% Recursos do Gestor com RPPS	-	
Empresa de Rating	-	
Conceito	-	
Representação do conceito	-	
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	-	
Distribuidor:	TESOURO NACIONAL	
CNPJ do Distribuidor:	-	
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	-	
Data de Início FI:	09/02/2009	
Taxa Administração do FI (%):	Tarifa de custódia + Custo Selic	
Índice de Referência do FI :	IPCA+6.261127%	
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):	Até o dia 15/05/2045	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	1	
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:	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:	Títulos Públicos do Governo Federal
	Principais riscos do fundo:	Risco de volatilidade dos títulos (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	Médio Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,74%	
Retorno Médio Anual	9,26%	
Retorno Total	118,70%	
Maior Retorno	11,73%	
Menor Retorno	-14,83%	
Qtde. mês Positivo	66	
Qtde. mês Negativo	40	
Qtde. mês acima do Benchmark	57	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	48	
Risco Mensal Período	4,06%	
Risco Mensal 12 MESES	4,59%	
Risco Anual do Período	14,08%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-22,00%	
Sharpe	-0,05	
Information Ratio	-0,22	
Tracking Error	14,16%	
VAR HISTÓRICO (95%)	7,51%	
VAR 12 MESES (95%)	6,35%	
Sharpe Modificado	-0,05	
Beta (12 meses)	-1,40	
Erro Quadrático Médio (EQM)	4,07%	

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 Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos : 22/10/2019
Outras Observações:	Pagamento de juros
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?	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
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

Fundo:	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571 (7632)		
CNPJ do Fundo:	-		
Segmento:	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)		
Tipo de Ativo:	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 958.153,00		
Quantidade de Cotas:	-		
Valor da Cota (R\$):	-		
Data da Operação:	18/11/2019		
Data de Liquidação:	18/11/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	-		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	-		
Limite Máximo por PL do fundo	-		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)		
CNPJ do Administrador:	-		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	-		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	-		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 0,00		
% 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.	0,00%		
Gestor:	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)		
CNPJ do Gestor:	-		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	-		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	-		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	-		
% Recursos do Gestor com RPPS	-		
Empresa de Rating	-		
Conceito	-		
Representação do conceito	-		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	-		
Distribuidor:	TESOURO NACIONAL		
CNPJ do Distribuidor:	-		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	-		
Data de Início FI:	09/02/2009		
Taxa Administração do FI (%):	Tarifa de custódia + Custo Selic		
Índice de Referência do FI :	IPCA+6.269771%		
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):	Até o dia 15/05/2045		
Data Listagem Bolsa:	Não listado		
Resgate (dias):	1		
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:	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:	Títulos Públicos do Governo Federal
	Principais riscos do fundo:	Risco de volatilidade dos títulos (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	Médio Prazo	

Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior

Retorno Médio Mensal	0,74%
Retorno Médio Anual	9,25%
Retorno Total	118,48%
Maior Retorno	11,73%
Menor Retorno	-14,92%
Qtde. mês Positivo	66
Qtde. mês Negativo	40
Qtde. mês acima do Benchmark	56
Qtde. mês abaixo do Benchmark	49
Risco Mensal Período	4,07%
Risco Mensal 12 MESES	4,62%
Risco Anual do Período	14,09%
Retorno Relativo ao Benchmark	-22,13%
Sharpe	-0,05
Information Ratio	-0,22
Tracking Error	14,17%
VAR HISTÓRICO (95%)	7,51%
VAR 12 MESES (95%)	6,35%
Sharpe Modificado	-0,06
Beta (12 meses)	-1,41
Erro Quadrático Médio (EQM)	4,07%
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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos : 22/10/2019
Outras Observações:	Pagamento de juros

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?	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
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
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO
CNPJ do Fundo:	15.486.093/0001-83
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
Tipo de operação realizada:	Resgate
Valor da operação:	R\$ 603.698,89
Quantidade de Cotas:	268.082,46518303
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,2519148710
Data da Operação:	18/11/2019
Data de Liquidação:	18/11/2019
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 336.617.640,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	-
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:	08/10/2019	
Data de Início FI:	23/01/2014	
Taxa Administração do FI (%):	0,15	
Índice de Referência do FI :	IPCA + 6,00%	
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):	16/05/2023	
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:	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:	O fundo tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em carteira diversificada de ativos financeiros de renda fixa, obtendo níveis de rentabilidade compatíveis com o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo - IPCA + 6,0% a.a.. Para isso, aplica seus recursos, exclusivamente, em títulos públicos federais registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC) e/ou em suas operações comprometidas.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Taxa de Juros (Risco 4)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco 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	1,17%	
Retorno Médio Anual	14,97%	
Retorno Total	125,61%	
Maior Retorno	5,14%	
Menor Retorno	-3,13%	
Qtde. mês Positivo	55	
Qtde. mês Negativo	15	
Qtde. mês acima do Benchmark	38	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	31	
Risco Mensal Período	1,58%	
Risco Mensal 12 MESES	0,86%	
Risco Anual do Período	5,46%	
Retorno Relativo ao Benchmark	17,47%	

Sharpe	0,85
Information Ratio	0,56
Tracking Error	5,54%
VAR HISTÓRICO (95%)	3,77%
VAR 12 MESES (95%)	3,93%
Sharpe Modificado	1,01
Beta (12 meses)	0,46
Erro Quadrático Médio (EQM)	1,61%
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 RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos : 22/10/2019
Outras Observações:	Pagamento de juros
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?	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
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
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:	Resgate
Valor da operação:	R\$ 8.766.054,40
Quantidade de Cotas:	4.231.832,33863933
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,0714559790
Data da Operação:	18/11/2019
Data de Liquidação:	18/11/2019
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.594.094.650,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,550%
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 RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	22/10/2019
Outras Observações:	Decorrente do pagamento dos juros das NTN-B 2045 R\$ R\$ 4.934.487,95. Pagamento de restos deixados R\$ 4.241,24 e pagamento de R\$ 603.698,89, DO BB PCA	

Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco

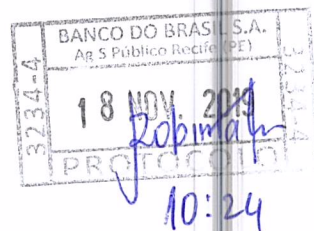
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros 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, mantém 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 Andreson 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/AUTORIZADOR José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF:384.326.394-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife-PE, 18 de novembro de 2019

Ofício RECIprev nº 252/2019 – GI



Senhor Gerente,

Aplicar o resgatar o valor de R\$ 8.766.054,40 (Oito milhões, setecentos e sessenta e seis mil, cinquenta e quatro reais e quarenta centavos), do 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, e efetuar a TED a seguir:

Banco: Banco Bradesco S.A. (237)
Agência: 0286-0
Conta Corrente: 65.000-5
Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev
CNPJ: 07.749.668/0001-85
Valor: R\$ 14.300.000,00 (Quatorze milhões e trezentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR²⁵²/2019

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

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



**PREFEITURA DO
RECIFE**
SECRETARIA DE ADMINISTRAÇÃO



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

Pagamento de restos deixados

GERSON CRUZ SANTOS <gerson.santos@recife.pe.gov.br>

18 de novembro de 2019 12:33

Para: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>, ELCIO RICARDO LEITE GUIMARAES <elcio.guimaraes@recife.pe.gov.br>, AMERICO DE OLIVEIRA MACHADO JUNIOR <americo.machado@recife.pe.gov.br>, ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA <annap@recife.pe.gov.br>

Boa tarde Zé Marcos! Solicito resgatar o valor de R\$ 4.241,24, da conta 7909-X -RECIPREV ,para pagamento da verba de restos deixados.

ATT

Gerson Cruz Santos

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	

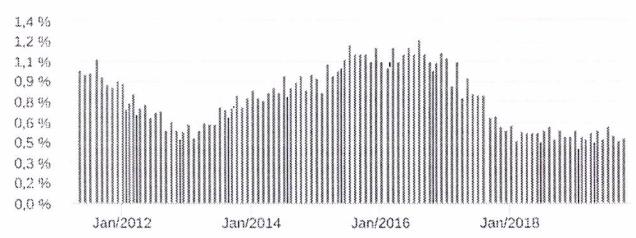
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18
Fundo	107,15	4,38	5,00	10,68	21,61	0,38	0,37	0,41	0,47	0,39	0,45	0,43	0,39	0,41	0,45	0,41	0,41
% do CDI	87,23	81,44	81,44	81,53	84,95	80,14	80,30	81,14	82,14	82,36	82,70	82,88	82,41	82,54	82,50	82,32	82,55
CDI	122,83	5,38	6,14	13,11	25,44	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	61,82	20,92	20,90	50,04	79,56	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	107,96	22,06	22,76	51,99	82,83	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	60,42	5,01	3,65	14,28	12,93	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	2,071455979	1.594.094,65	1.304.097,41	0,03%	-	0,01%	0,86	0,01%	0,47%	0,37%	0
CDI	-	-	-	0,03%	-	0,01%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

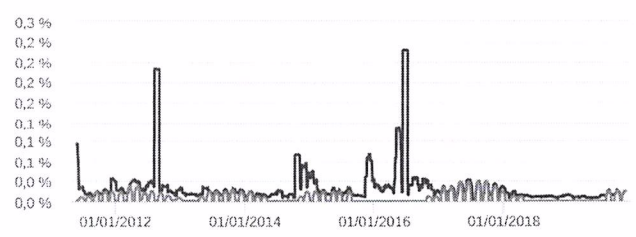
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 18/11/2019 (mensal)



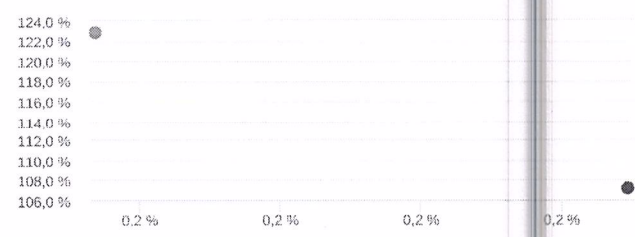
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 18/11/2019 (diária)



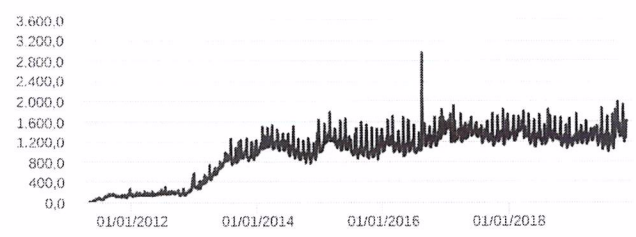
Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 18/11/2019 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 18/11/2019 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 18/11/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 18/11/2019 (mensal)



Composição da Carteira

out/2019

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 FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

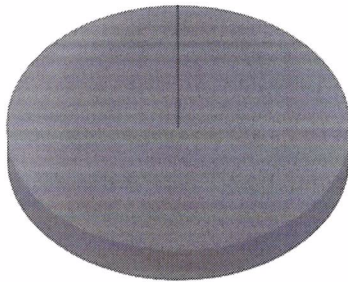
18/11/2019

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	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,21	98,43	18,42	98,36	18,42	98,36	18,42	98,36	-	R\$ 1.302.859.340,9

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%	100,01%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-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.

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 15.486.093/0001-83	Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
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: 0,15%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 358721	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 23/01/2014	

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	125,19	14,51	16,63	29,06	49,35	1,98	2,11	-0,06	1,08	2,37	1,98	1,12	1,01	0,33	2,14	1,91	0,13
% do CDI	166,26	269,47	270,93	221,73	194,00	412,42	453,93	-11,63	190,35	505,40	364,42	215,70	214,45	66,30	393,21	386,92	25,36
CDI	75,30	5,38	6,14	13,11	25,44	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	119,93	20,92	20,90	50,04	79,56	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	124,90	22,06	22,76	51,99	82,83	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	37,53	5,01	3,65	14,28	12,93	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	2,251914871	336.617,64	324.764,62	2,80%	-1,29%	1,33%	-0,22	2,80%	2,37%	-0,06%	9
CDI	-	-	-	0,03%	-	0,01%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

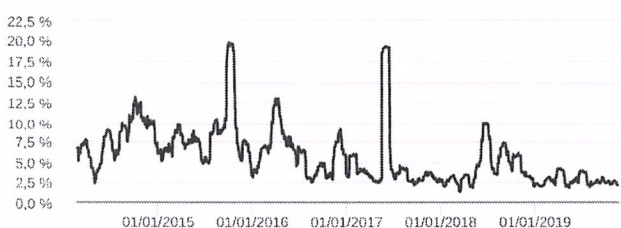
Retorno Mensal - 24/01/2014 a 18/11/2019 (mensal)



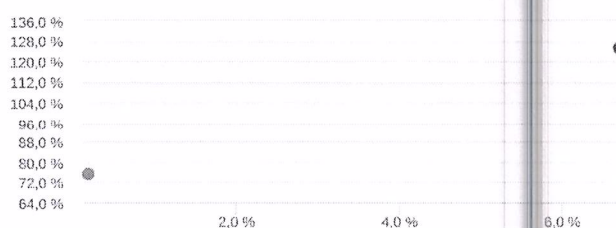
Retorno Acumulado - 24/01/2014 a 18/11/2019 (diária)



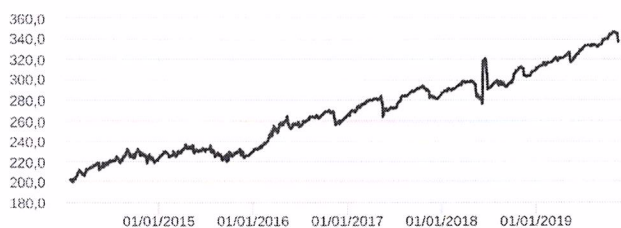
Volatilidade Anualizada - 24/01/2014 a 18/11/2019 (diária)



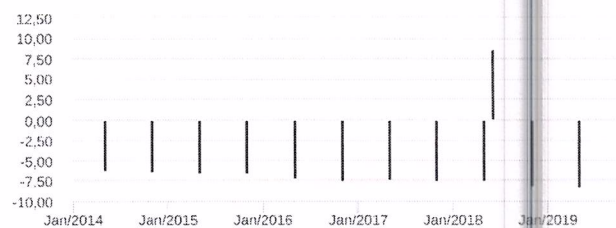
Risco x Retorno - 24/01/2014 a 18/11/2019 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 24/01/2014 a 18/11/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 24/01/2014 a 18/11/2019 (mensal)



Composição da Carteira

out/2019

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

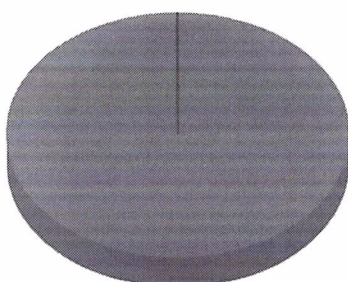
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

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
Títulos Públicos	99,94%	99,92%	99,90%	99,89%	99,87%	99,85%	99,93%	99,92%
Operações Compromissadas	0,06%	0,08%	0,10%	0,11%	0,13%	0,15%	0,07%	0,08%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
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)	346.236,62	339.525,62	332.525,56	332.719,66	329.162,08	321.543,40	323.587,43	320.009,81
Data da Divulgação	06/11/2019	04/10/2019	03/09/2019	05/08/2019	05/07/2019	04/06/2019	06/05/2019	03/04/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2019



■ NTN-B - Venc.: 15/05/2023	99,94 %
■ Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	0,06 %
■ Outros Valores a receber	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Prov. Audit 29/03/2020	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Data de Emissão: 19/11/2019 17:25:06
 Data da Posição: 18/11/2019
 Moeda da Carteira: R\$ - REAL - Taxa de Câmbio: - R\$ 1,00
 Cliente: FUNDO PREVIDENCIARIO - RECIPREV [90310]

001/002



RENTA FIXA MERCADO NACIONAL

Codigo	Aplicação	Emissor	Papel	MTM %AA	Tx Over	Taxa %AA	Index	Emissao	Venc.	Quantidade	PU Atual	Valor da Aplicação	Vf Resgate	Valor Bruto	Impostos	Valor Líquido	% S/ RF	% S/ Total
NTN-B PU ANDIMA																		
Operações à Vista																		
10399219	02/10/08	TESOURO	78004	0,000000%	-95,837265%	7,002299%	ipca	15/08/04	15/05/45	10,000,0000	2,875,40002101	15,862,114,34	0,00	28,754,000,21	0,00	28,754,000,21	18,74%	18,74%
10399220	06/10/08	TESOURO	78004	0,000000%	-95,841173%	7,002555%	ipca	15/08/04	15/05/45	21,500,0000	2,875,27885882	34,128,371,40	0,00	61,818,495,46	0,00	61,818,495,46	40,28%	40,28%
669570	09/02/09	TESOURO	78004	0,000000%	-87,852909%	6,261127%	ipca	15/08/04	15/05/45	10,000,0000	3,146,50535023	17,631,110,00	0,00	31,465,053,50	0,00	31,465,053,50	20,50%	20,50%
669571	09/02/09	TESOURO	78004	0,000000%	-87,917649%	6,269771%	ipca	15/08/04	15/05/45	10,000,0000	3,143,12036095	17,610,000,00	0,00	31,431,203,06	0,00	31,431,203,06	20,48%	20,48%
TOTAL OPERAÇÕES À VISTA										51,500,0000		85,231,595,74	0,00	153,468,752,23	0,00	153,468,752,23	100,00%	100,00%
TOTAL NTN-B PU ANDIMA										51,500,0000		85,231,595,74	0,00	153,468,752,23	0,00	153,468,752,23	100,00%	100,00%
TOTAL MERCADO NACIONAL										51,500,0000		85,231,595,74	0,00	153,468,752,23	0,00	153,468,752,23	100,00%	100,00%
TOTAL										51,500,0000		85,231,595,74	0,00	153,468,752,23	0,00	153,468,752,23	100,00%	100,00%

TESOURARIA

Descrição	Valor	% S/ TES	% S/ Total
Saldo em Tesouraria	0,00	0,00%	0,00%
Saldo em Tesouraria RESERVA	0,00	0,00%	0,00%
TOTAL	0,00	0,00%	0,00%

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Data de Emissão: 19/11/2019 17:25:06
Data da Posição: 18/11/2019
Moeda da Carteira: R\$ - REAL - Taxa de Câmbio: - R\$ 1,00
Cliente: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - RECIPIREV [90310] []

PATRIMÔNIO

133.468.752,23

002/002



RENTABILIDADE ACUMULADA

Indexador	Benchmark	Ren. Real	Varição Diária	Varição Mensal	Varição Anual	Últimos 6 meses	Últimos 12 meses
Data Inicial							
Data Final							
COTA BRUTA			0,0300960%	0,3416%	-13,0244%	3,4948%	-11,2513%
COTA LÍQUIDA			0,0300955%	0,3416%	-13,0244%	3,4948%	-11,2513%

Quantidade de Cotas (Líquida)	18.100,095.934354
Valor da cota unitária (Líquida)	8,478891
Quantidade de Cotas (Bruta)	18.100,095.934354
Valor da cota unitária (Bruta)	8,478891
Valor da cota bruta de performance	8,478891

* Este fundo de investimento possui custódia e controladoria no Banco do Brasil

Ouvvidoria BB 0800 729 5678 - Para revisão de reclamações não solucionadas no atendimento habitual. Deficientes auditivos ou de fala: 0800 729 0088