



PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

ART. 3º - B DA PORTARIA MPS N º 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N º 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR		Nº / ANO:	009 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	009 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	17/01/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 50.000.000,00		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Cinquenta milhões de reais				
Sim para todos os fundos desta APR				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO			
CNPJ do Fundo:	13.322.205/0001-35			
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\$ 50.000.000,00			
Quantidade de Cotas:	20.641.622,97842050			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,42229015			
Data da Operação:	17/01/2019			
Data de Liquidação:	18/01/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	6.817.731.940,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,733%			
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:	25/10/2018			
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 55.097.167.000,00			
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	5,81%			
Gestor:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)			
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	25/10/2018			
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	53.111.188.016,71		
% Recursos do Gestor com RPPS	5,69%			
Empresa de Rating	Fitch Ratings			
Conceito	Excelente			
Representação do conceito	Excelente			
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	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:	30/10/2018			

Data de Início FI:	28/04/2011
Taxa Administração do FI (%):	0,20%
Índice de Referência do FI:	IDKA IPCA 2A
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):	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)	<p>Objetivos:</p> <p>O fundo tem como objetivo proporcionar rentabilidade de suas cotas compatível com o do sub-índice IDKA 2A. Para atingir esse objetivo, aplica a totalidade de seus recursos exclusivamente em títulos públicos federais, registrados no SELIC e/ou em suas operações compromissadas. Deverá, ainda, manter no mínimo 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou índices de preços</p> <p>Principais riscos do fundo:</p> <p>Risco de Taxa de Juros (Risco 1)</p> <p>Risco do Fundo atribuído pelo Administrador</p> <p>Risco Muito Baixo</p>
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	0,96%
Retorno Médio Anual	12,14%
Retorno Total	140,73%

Maior Retorno	3,50%
Menor Retorno	-0,91%
Qtde. mês Positivo	82
Qtde. mês Negativo	10
Qtde. mês acima do Benchmark	34
Qtde. mês abaixo do Benchmark	58
Risco Mensal Período	0,79%
Risco Anual do Período	2,74%
Retorno Relativo ao Benchmark	-4,72%
Sharpe	0,69
Information Ratio	-1,26
Tracking Error	0,56%
VAR (95%)	2,27%
Sharpe Modificado	0,94
Beta (12 meses)	0,85
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,17%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos 19/12/2018
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?	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

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

PROponente

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: 04.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

Recife, 17 de janeiro de 2019



Ofício RECI PREV nº 009/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 50.000.000,00 (Cinquenta milhões de reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35 e aplicar o mesmo valor no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.327.340/0001-73, vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 009/2019

Atenciosamente,

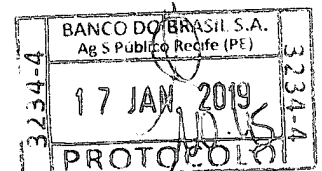


JOSÉ MARGOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR
DIRETOR EXECUTIVO

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



Características

CNPJ: 13.422.205/0001-35
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 272612
 Início do Fundo: 28/04/2011

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 10.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du

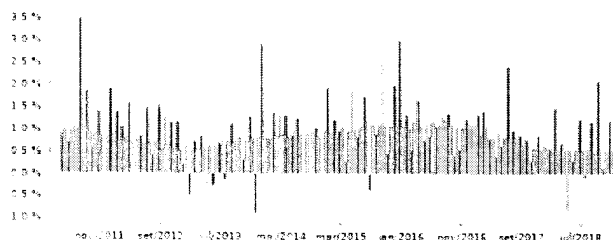
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18
Fundo	142,23	0,54	9,01	22,86	40,41	1,22	0,11	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,84	0,69	1,48	0,56	0,96
% do CDI	126,85	168,29	139,71	135,39	121,35	247,72	22,00	384,81	250,21	-13,55	227,52	55,59	-163,16	133,48	278,85	120,55	165,00
CDI	112,12	0,32	6,45	16,88	33,30	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58
Ibovespa	46,33	9,34	20,37	53,89	143,20	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14
IBX	85,93	9,13	20,85	55,19	140,12	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74
IGP-M	52,85	0,06	7,21	6,79	14,29	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	vezes Acima do Benchmark
Fundo	2.422.290.149	6.817.731.94	6.355.494.34	2,35%	-2,36%	1,11%	-5,74	2,35%	2,09%	-0,84%	7
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,46%	0

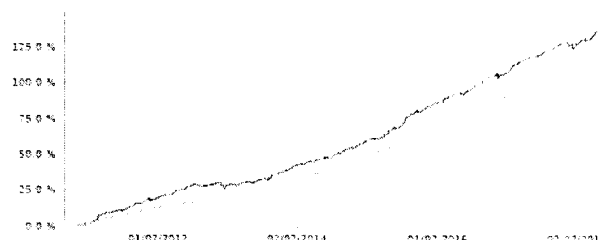
Gráficos

Fundo CDI

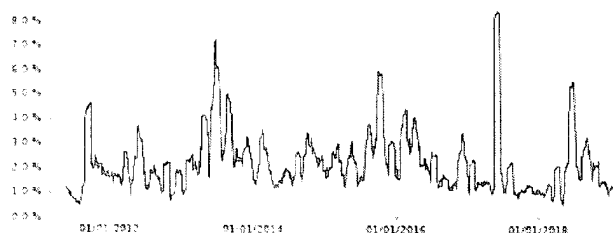
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 18/01/2019 (mensal)



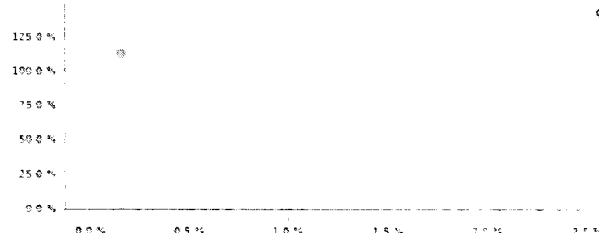
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 18/01/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 18/01/2019 (diária)

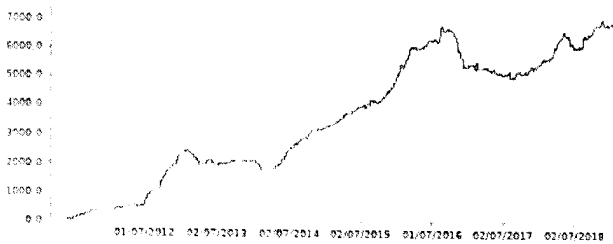


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 18/01/2019 (diária)

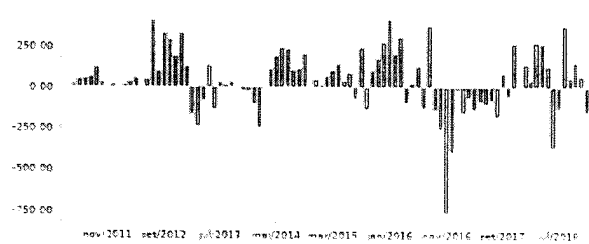


As informações herein exibidas são extraídas de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualidade não é assumida pela CIBRAFIUBB pelo fundo desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundo de investimento em 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 do Fidejussor (Garantidor de Créditos - FIC). Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias e metodologias utilizadas na política de investimento do fundo de investimento podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos para o fundo para cobrir o prejuízo do fundo. Ao considerar e recomendar a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliar as informações de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para as opções foram utilizadas as informações de fonte Original S&P.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 18/01/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 18/01/2019 (mensal)



Composição da Carteira

dez/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	Pl. Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	-----------

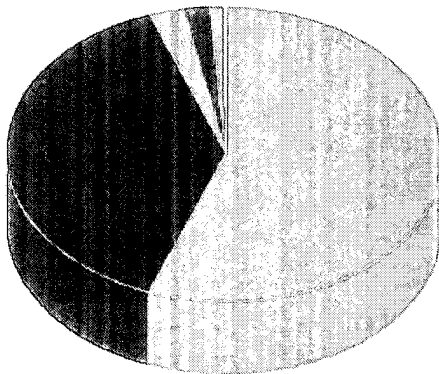
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18
Titulos Públicos	98,09%	98,75%	98,87%	99,23%	99,56%	99,53%	99,46%	99,52%
Operações Compromissadas	1,91%	1,25%	1,13%	0,77%	0,44%	0,48%	0,54%	0,48%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,00%	-0,00%	0,00%	-	-	-	-	-
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)	6.854.500,35	6.923.282,00	6.844.791,59	6.551.962,37	6.422.224,91	6.047.649,86	6.108.970,61	6.458.766,21
Data da Divulgação	09/01/2019	04/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	05/09/2018	03/08/2018	04/07/2018	06/06/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

dez/2018



NTN-B - Venc. 15/05/2021	55,65%
NTN-B - Venc. 15/08/2020	38,73%
NTN-B - Venc. 15/08/2022	2,50%
Operações Compromissadas - LFT - Venc. 01/09/2022	1,91%
NTN-B - Venc. 15/05/2019	1,21%
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00%
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0,00%
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00%
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00%
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00%
Outros Valores a receber	0,00%
Outras Disponibilidades	0,00%
Outros Valores a pagar	0,00%

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela conexão e atualizado é de responsabilidade do DISTRIBUIDOR. Não há garantia de que a performance passada ou futura de qualquer fundo de investimento não sofrerá alterações. Os dados são atualizados até a data da divulgação. O rendimento obtido 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 detentores, superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de capital por parte do investidor. Ao investir, é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendada a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas informações de fonte Quantiles.