



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:	026 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	026 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	08/02/18	
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 107.533,95	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Cento e sete mil, quinhentos e trinta e três reais e noventa e cinco centavos			
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	BB PREVIDENCIARIO 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\$ 107.533,95		
Quantidade de Cotas:	53.880,82137697		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,99577		
Data da Operação:	08/02/2018		
Data de Liquidação:	08/02/2018		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	1.232.860.430,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,009%		
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\$ 55.228.932.000,00		
% 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.	5,87%		
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\$	53.246.574.026,90	
% Recursos do Gestor com RPPS	5,74%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Excelente		
Representação do conceito	Excelente		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim		
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018		

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		0,75%
Retorno Médio Anual		9,35%
Retorno Total		98,37%



Maior Retorno	1,17%
Menor Retorno	0,39%
Qtde. mês Positivo	92
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	1
Qtde. mês abaixo do Benchmark	91
Risco Mensal Período	0,22%
Risco Anual do Período	0,76%
Retorno Relativo ao Benchmark	-6,16%
Sharpe	-1,20
Information Ratio	-13,46
Tracking Error	0,07%
VAR (95%)	1,11%
Sharpe Modificado	-56,38
Beta (12 meses)	0,78
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 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: 14/01/2019
Outras Observações:	Recebimento de compensação no valor de R\$ 180.376,91 e pagamento de Taxa de Administração no valor de R\$ 287.910,86
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)

PROPORLENTE

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(A) AUTORIZADOR

José Márcio Alves de Barros

Gestor de Investimentos

CPF 334.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

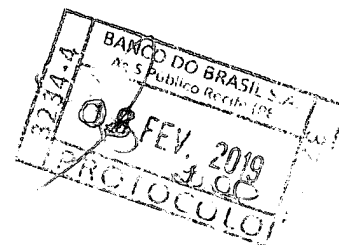
CPA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

RECI
PREV

Recife, 08 de fevereiro de 2019



Ofício RECIPREV nº 026/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 107.533,95 (Cento e sete mil, quinhentos e trinta e três reais e noventa e cinco centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO: 13.077.415/0001-05, vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 026/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ELCIO 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

Re: Planilha Valores +NITS com. 01/2019

JULIANA COTTARD GIESTOSA

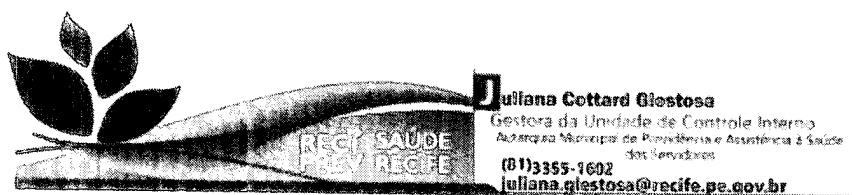
sex 08/02/2019 10:40

Para ANDRE LUIZ MARTINS CORREIA DA SILVA <andrecorreia@recife.pe.gov.br>; MESSIAS FRANCISCO PEREIRA FILHO <messiasfilho@recife.pe.gov.br>; ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA <annap@recife.pe.gov.br>; JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>;

Bom dia!

Seguem valores para conferência:

RECIPREV	180.340,70
RECIFIN	325.549,72
VALOR DEPOSITADO	505.890,42



De: ANDRE LUIZ MARTINS CORREIA DA SILVA

Enviado: sexta-feira, 8 de fevereiro de 2019 10:16:10

Para: JULIANA COTTARD GIESTOSA; MESSIAS FRANCISCO PEREIRA FILHO; ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA

Assunto: Planilha Valores +NITS com. 01/2019

Bom Dia !

Segue em anexo os NITS e respectivos valores da compensação competência. 01/2019, para cruzamento e separação por Fundos, e envio para Gerência de Investimentos, peço-lhe o obséquio de enviar-me uma cópia.

Att.

André Luiz M. C. Silva

Chefe da Div. de Gestão Previdenciária

• RECIPREV

Características

CNPJ: 13.077.415/0001-05
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 1,00%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Soberano
 Código de Referência: 272604
 Início do Fundo: 28/04/2011

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 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+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

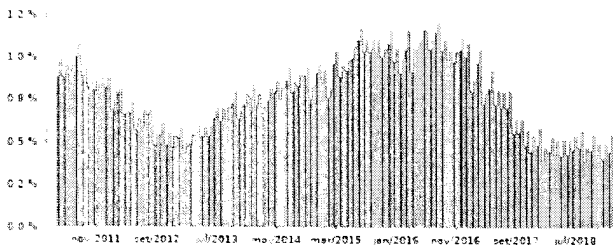
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18
Fundo	99,58	0,57	5,28	14,07	29,00	0,45	0,41	0,41	0,45	0,39	0,47	0,45	0,43	0,42	0,43	0,44	0,39
% do CDI	88,19	82,56	82,17	85,38	88,56	82,50	82,32	82,55	82,79	82,81	82,54	82,84	82,57	81,66	82,43	83,41	83,21
CDI	112,91	0,69	6,42	16,47	32,74	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46
Ibovespa	45,18	8,48	13,65	47,05	147,03	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52
IBX	84,86	8,50	14,51	48,60	143,08	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42
IGP-M	52,93	0,11	6,84	6,41	13,35	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,04	0,07

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	1.995774141	1.232.860,43	1.306.030,14	0,01%	-	0,00%	0,84	0,01%	0,47%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

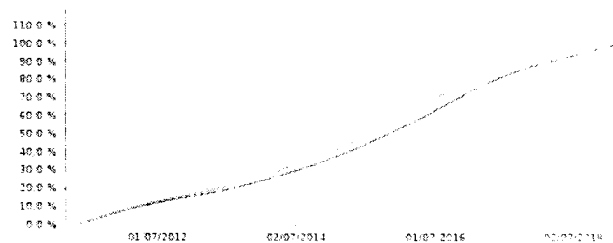
Gráficos

Fundo CDI

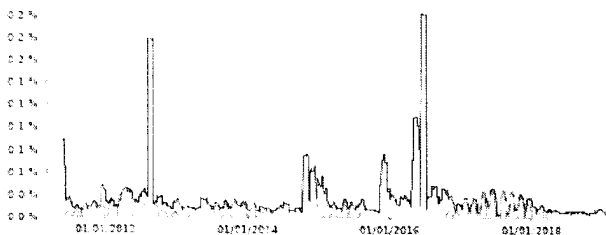
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 08/02/2019 (mensal)



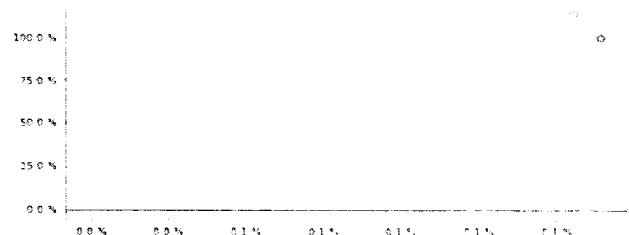
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 08/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 08/02/2019 (diária)

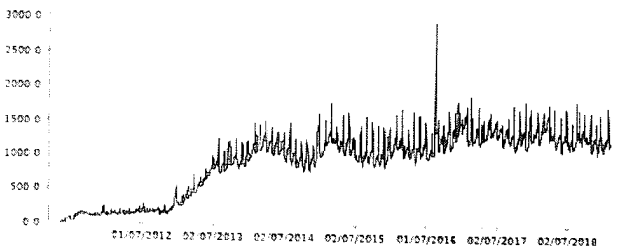


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 08/02/2019 (diária)

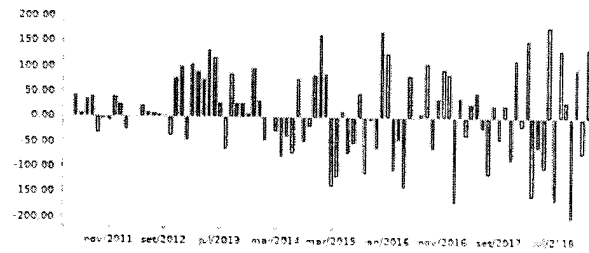


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo QUANTUM, pelo Interinvestimentos ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia da Administração do fundo, Gestão da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou garantia do Fidejussor Garantidor do Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias e uso de 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 avaliar e recomendar a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para a utilização da plataforma de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações (D) e (S).
 Fonte: Quantum Axis.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 08/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 08/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

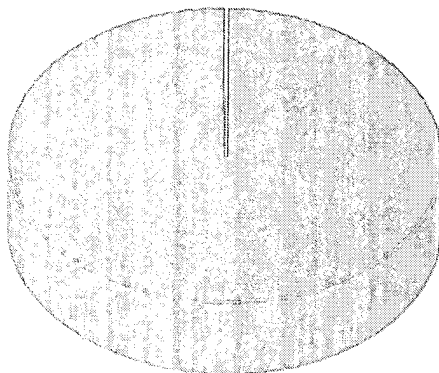
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,15	98,13	13,21	98,30	13,21	98,30	13,21	98,30	-	R\$ 1.305.990.477,50

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

Tipo de Aplicação	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18
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%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.301.788,30	1.157.483,38	1.226.386,94	1.120.973,03	1.316.299,88	1.278.234,77	1.135.822,82	1.295.491,67
Data da Divulgação	05/02/2019	04/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	04/09/2018	03/08/2018	09/07/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/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 de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	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. O titular desta marca não possui 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 proteção oferecida pelo Garantidor de Créditos (FGC). Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas ou não, podem resultar em perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente elevação do custo de abertura de novos cotistas, podendo 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 aplicações de cotas, mantenha um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas as cotizações (Data: Fonte: Quantum Aes).