



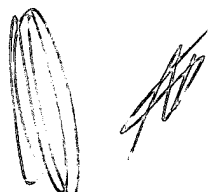
PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDORES
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR







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:	035 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	035 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	18/02/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 14.500.000,00		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Quatorze milhões e quinhentos mil 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\$ 14.500.000,00			
Quantidade de Cotas:	5.928.180,77270161			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,44594			
Data da Operação:	18/02/2019			
Data de Liquidação:	19/02/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	6.904.118.680,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,210%			
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 (%):		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)	Objetivos:	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.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Taxa de Juros (Risco 1)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Baixo
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo		Curto Prazo
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal		0,96%
Retorno Médio Anual		12,18%
Retorno Total		143,65%

Maior Retorno		3,50%
Menor Retorno		-0,91%
Qtde. mês Positivo		83
Qtde. mês Negativo		10
Qtde. mês acima do Benchmark		34
Qtde. mês abaixo do Benchmark		59
Risco Mensal Período		0,79%
Risco Anual do Período		0,80%
Retorno Relativo ao Benchmark		2,73%
Sharpe		-4,76%
Information Ratio		0,72
Tracking Error		-1,26
VAR HISTÓRICO (95%)		0,56%
VAR 12 MESES (95%)		2,26%
Sharpe Modificado		2,06%
Beta (12 meses)		0,99
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,85
		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 Providência 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:		
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	



<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>Anexo: lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</p> <table border="0" style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 50%; text-align: center;"> <p>PROponente  Anderson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF 052.430.264-25 Entidade Certificadora ANRIMA CPA 20 e CFA Validade da Certificação 05/12/2020</p> </td> <td style="width: 50%; text-align: center;"> <p>Gestor Autorizador  José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334.326.354-00 Entidade Certificadora ANRIMA CPA 20 e CFA Validade da Certificação 21/11/2021</p> </td> </tr> </table>		<p>PROponente  Anderson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF 052.430.264-25 Entidade Certificadora ANRIMA CPA 20 e CFA Validade da Certificação 05/12/2020</p>	<p>Gestor Autorizador  José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334.326.354-00 Entidade Certificadora ANRIMA CPA 20 e CFA Validade da Certificação 21/11/2021</p>
<p>PROponente  Anderson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF 052.430.264-25 Entidade Certificadora ANRIMA CPA 20 e CFA Validade da Certificação 05/12/2020</p>	<p>Gestor Autorizador  José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334.326.354-00 Entidade Certificadora ANRIMA CPA 20 e CFA Validade da Certificação 21/11/2021</p>		

SAÚDE
RECIFE

RECI
PREV

Recife, 18 de fevereiro de 2019

Ofício RECIPREV nº 035/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 14.500.000,00 (Quatorze milhões e quinhentos mil reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35, vinculado a conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 035/2019

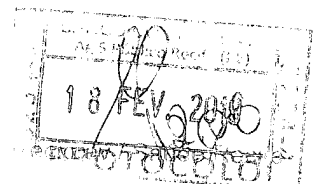
Atenciosamente,


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

Unidade Administrativa de Previdência e Assistência Social - Recife - PE
Av. Tanque Borta 488 - Cep. 51071-000 - Boa Vista, Recife - PE
Fone/Fax: (51) 3355 1650 / 3355 877



BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

18/02/2019

Características

CNPJ: 13.322.205/0001-35
 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

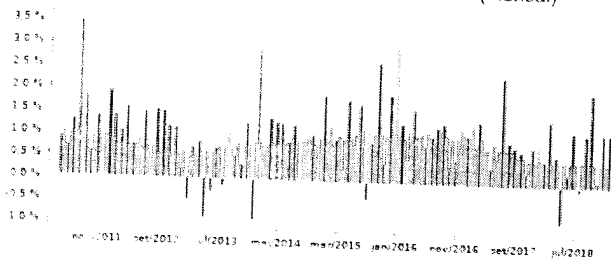
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18
Fundo	144,59	1,52	9,76	22,50	38,02	1,22	1,22	0,11	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,84	0,69	1,48	0,56
% do CDI	127,71	180,99	152,12	137,95	116,91	223,80	247,72	22,00	384,81	250,21	-13,55	227,52	55,59	-163,16	133,48	278,85	120,55
CDI	113,22	0,84	6,42	16,31	32,52	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	46,96	9,81	14,18	48,56	142,44	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	87,14	9,84	15,15	49,85	139,55	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	53,13	0,24	6,95	6,52	13,04	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,67

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	2.445.944.305	6.904.118,68	6.456.821,95	2,35%	-2,36%	1,12%	-4,79	2,35%	2,09%	-0,84%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

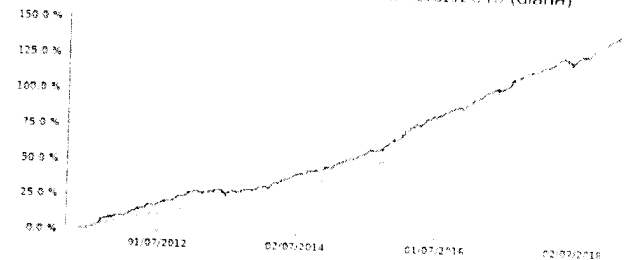
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

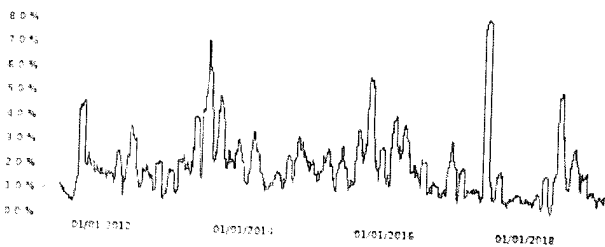
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 18/02/2019 (mensal)



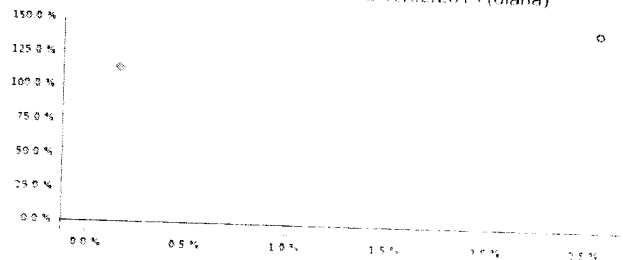
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 18/02/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 18/02/2019 (diária)

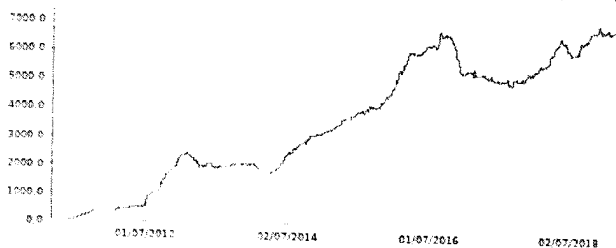


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 18/02/2019 (diária)

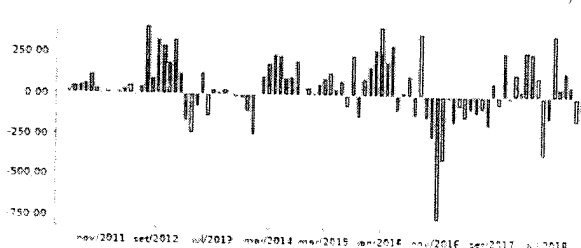


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualizado não é assumida pela QUANTUM FUND INVESTIMENTOS S.A. ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia de Administração do fundo, Gestor do Carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou proteção. Os valores do fundo de investimento podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir as perdas com recursos próprios do fundo. Ao investir é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento no ato de aplicação dos recursos. Para a aplicação da performance do Fundo Quantum Aces.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 18/02/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 18/02/2019 (mensal)



Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

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

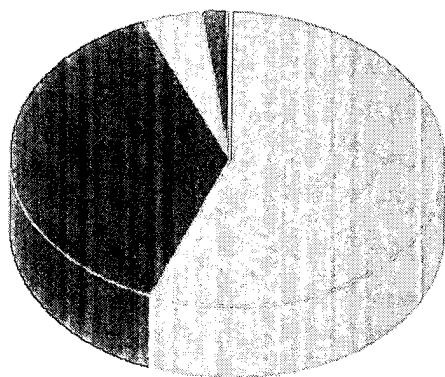
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18
Títulos Públicos	98,12%	98,09%	98,75%	98,87%	99,23%	99,56%	99,53%	99,46%
Operações Compromissadas	1,87%	1,91%	1,25%	1,13%	0,77%	0,44%	0,48%	0,54%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,01%	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)	6.832.498,26	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
Data da Divulgação	05/02/2019	09/01/2019	04/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	05/09/2018	03/08/2018	04/07/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2019



NTN-B - Venc. 15/05/2021	55,64 %
NTN-B - Venc. 15/08/2020	37,78 %
NTN-B - Venc. 15/08/2022	1,47 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc. 01/09/2022	1,87 %
NTN-B - Venc. 15/05/2019	0,24 %
Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
Outros Valores a pagar	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas, consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo QUANTUMFI, por não estar destinado a qualquer fim comercial. Fundos de investimento não constam com a garantia de Administrador do fundo, Gestor da carteira de qualquer mecanismo de seguro ou garantia de liquidez garantida do Cliente. FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias mais demeritadas, utilizadas como parte da política de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobrir a perda com recursos próprios 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 (R\$). Para os citados, foram utilizadas as seguintes fontes: Quantumfi.