



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 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:	045 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	045 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	07/03/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 1.520.000,00		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Um milhão quinhentos e vinte 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\$ 1.520.000,00			
Quantidade de Cotas:	618.676,69703534			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,45686			
Data da Operação:	07/03/2019			
Data de Liquidação:	08/03/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	6.513.686.650,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,023%			
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\$ 55.990.040.000,00			
% 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.	5,86%			
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\$	54.074.590.990,21		
% 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)	<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: Risco de Taxa de Juros (Risco 1)</p> <p>Risco do Fundo atribuído pelo Administrador 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	12,18%
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	35
Qtde. mês abaixo do Benchmark	59
Risco Mensal Período	0,79%
Risco Mensal 12 MESES	0,80%
Risco Anual do Período	2,73%
Retorno Relativo ao Benchmark	-4,76%
Sharpe	0,76
Information Ratio	-1,27
Tracking Error	0,56%
VAR HISTÓRICO (95%)	2,26%
VAR 12 MESES (95%)	2,06%
Sharpe Modificado	1,05
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 RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos: 20/02/2019
Outras Observações:	Destinado ao pagamento de consignados
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)

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: 324.328.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

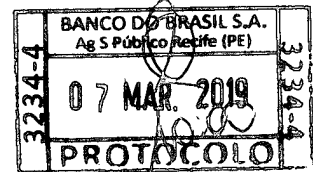
CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 07 de março de 2019



Ofício RECIPREV nº 045/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 1.520.000,00 (Um milhão, quinhentos e vinte mil reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35, vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 045/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIO
DIRETOR VICE PRESIDENTE

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

BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

08/03/2019

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 do
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 do

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18
Fundo	145,69	1,97	9,36	22,01	37,33	0,61	1,22	1,22	0,11	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,84	0,69	1,48
% do CDI	127,96	173,35	146,06	137,65	116,37	122,93	223,80	247,72	22,00	384,81	250,21	-13,55	227,52	55,59	-163,16	133,48	278,85
CDI	113,85	1,14	6,41	15,99	32,08	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53
Ibovespa	45,21	8,51	11,34	42,36	116,14	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01
IBRX	84,92	8,54	12,28	43,56	114,93	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08
IGP-M	54,26	0,98	7,58	7,25	13,01	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64

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	2,456856719	6.881.262,72	6.513.686,65	2,35%	-2,36%	1,12%	3,64	2,35%	2,09%	-0,84%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

Gráficos

Retorno Mensal - 29/04/2011 a 08/03/2019 (mensal)

Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 08/03/2019 (diária)

Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 08/03/2019 (diária)

Risco x Retorno - 29/04/2011 a 08/03/2019 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 08/03/2019 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 08/03/2019 (mensal)

Composição da Carteira

jan/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	DI 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%	NTN-B - Venc. 15/05/2021 NTN-B - Venc. 15/08/2020	98,12%	98,12%	98,12%	98,12%	98,12%	98,12%	55,64% 37,78%
Operações Compromissadas	1,87%	NTN-B - Venc. 15/08/2022	1,87%	1,87%	1,87%	1,87%	1,87%	1,87%	4,47%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,01%	Operações Compromissadas - LFT - Venc. 01/09/2022 NTN-B - Venc. 15/05/2019	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	1,87% 0,24%

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualização no caso de erro é de responsabilidade do administrador do fundo. O administrador do fundo não garante a atualidade, a exatidão ou a integridade das informações e não se responsabiliza por qualquer erro ou omissão. Os dados de desempenho não contam com a garantia de Administração do fundo. Gestor da carteira, em qualquer momento, pode alterar a composição da carteira de fundos de acordo com a estratégia de investimento, podendo sofrer com perdas para seus cotistas superiores ao valor aplicado e a consequente redução do patrimônio líquido do fundo. As investidoras comprometendo a futura liquidação do fundo de investimento no aplicador responsável. Para saber mais detalhes sobre o fundo, consulte a página de informações do fundo no site da BB. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas as seguintes fontes: Banco Central do Brasil e Anbima.

:: BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

08/03/2019

Valores a receber	0,00%	<input checked="" type="checkbox"/> Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0,00 % 0%
Disponibilidades	0,00%	<input checked="" type="checkbox"/> Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0,00 % 0%
Valores a pagar	-0,00%	<input checked="" type="checkbox"/> Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	6.832.498,25	<input checked="" type="checkbox"/> Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 % 10%
Data da Divulgação	05/02/2019	<input checked="" type="checkbox"/> Outros Valores a receber	0,00 %
Composição da Carteira Individual		<input checked="" type="checkbox"/> Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
		<input checked="" type="checkbox"/> Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %/2018
		<input checked="" type="checkbox"/> Outras Disponibilidades	0,00 %
		<input checked="" type="checkbox"/> Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %/2019
		<input checked="" type="checkbox"/> Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
		<input checked="" type="checkbox"/> Outros Valores a pagar	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualidade dos dados é de responsabilidade do QUANTIA, pelo qual não se destina a ser utilizada para qualquer fim comercial de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de compra ou venda de valores mobiliários ou quaisquer outros valores mobiliários. Fundos de investimento não contam com a garantia de Administração do fundo. Gastos da carteira de qualquer natureza não são garantidos. Não há garantia de retorno. O Resultado obtido no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias e os distribuidores, públicos ou privados, podem sofrer alterações sem aviso prévio. O desempenho do fundo não garante o resultado em períodos subsequentes. O capital aplicado é a consequência da aplicação de recursos em estratégias de investimento. Não há garantia de retorno de longo prazo. A rentabilidade é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento, nos aplicáveis regulamentos. Não há garantia de retorno de longo prazo. O desempenho do fundo não garante o resultado em períodos subsequentes. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para mais informações consulte o site do fundo. Divulgação de dados.