



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:	046 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	046 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	08/03/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 1.520.000,00		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
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 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:	Aplicação			
Valor da operação:	R\$ 1.520.000,00			
Quantidade de Cotas:	758.823,55410877			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,00310			
Data da Operação:	08/03/2019			
Data de Liquidação:	08/03/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	1.344.222.660,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		0,113%		
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 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 (%):	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 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	0,74%	
Retorno Médio Anual	9,30%	
Retorno Total	99,26%	

Maior Retorno		1,17%
Menor Retorno		0,39%
Qtde. mês Positivo		93
Qtde. mês Negativo		0
Qtde. mês acima do Benchmark		2
Qtde. mês abaixo do Benchmark		92
Risco Mensal Período		0,22%
Risco Mensal 12 MESES		0,03%
Risco Anual do Período		0,76%
Retorno Relativo ao Benchmark		6,25%
Sharpe		-1,05
Information Ratio		-12,69
Tracking Error		0,07%
VAR HISTÓRICO (95%)		1,11%
VAR 12 MESES (95%)		0,79%
Sharpe Modificado		-46,63
Beta (12 meses)		0,75
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 RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	20/02/2019
Outras Observações:	Desninado ao pagamento dos 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?		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)

PROponente

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 052.430.264-25

Entidade Certificadora: ANRIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 05/12/2020

Gestor Autorizador

Jose Marcos Alves de Barros

Chefe de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora: ANRIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

Recife, 08 de março de 2019

RECI
PREV

Ofício RECI-REV nº 046/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 1.520.000,00 (Um milhão, quinhentos e vinte reais), no 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 046/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR
DIRETOR VICE PRESIDENTE

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



