



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



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:	060 /2018 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	060 /2018 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	02/03/18	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 2.953.347,64		FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"		
Dois milhões, novecentos e cinquenta e três mil, trezentos e quarenta e sete reais e sessenta e quatro centavos		FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
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:	Renda Fixa			
Tipo de Ativo:	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"			
Tipo de operação realizada:	Resgate			
Valor da operação:	R\$ 2.953.347,64			
Quantidade de Cotas:	155,2673776			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 19.021,00000000			
Data da Operação:	02/03/2018			
Data de Liquidação:	02/03/2018			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.452.437.000,00			
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,203337%			
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X	
Administrador:	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS			
CNPJ do Administrador:	30.822.936/0001-69			
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	27/10/2017			
Gestor:	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS			
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	27/10/2017			
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A.			
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91			
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	24/10/2017			
Data de Início FI:	28/04/2011			
Taxa Administração do FI (%):	1,00			
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado			
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			
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado			
Carência (dias):	0			
Data Listagem Bolsa:	Não listado			
Resgate (dias):	0			

Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui		
Cód. Negociação Bolsa:	Sem código		
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:	06.006.071/0001-88		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI Renda Fixa - 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	
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 Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações		
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	21/02/2018	
Outras Observações:	Estorno de pagamento no valor de R\$ 112,25. Estorno de tarifa do Fundo Socopa FII no valor de R\$ 50,00 e pagamento do consignado no valor total de R\$ 1.703.509,89		
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO		
CNPJ do Fundo:	13.322.205/0001-35		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 1.250.000,00		
Quantidade de Cotas:	557.289,34462773		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,24300000		
Data da Operação:	02/03/2018		
Data de Liquidação:	02/03/2018		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 5.715.600.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,021870%		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS		
CNPJ do Administrador:	30.822.936/0001-69		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	27/10/2017		
Gestor:	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS		
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	27/10/2017		
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A.		
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	24/10/2017		
Data de Início FI:	28/04/2011		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		

Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:		
Índice de Referência do FI :	Dispensado	
Tx Performance do FI (%):	IDKA IPCA 2A	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Não possui	
Carência (dias):	Dispensado	
Data Listagem Bolsa:	0	
Resgate (dias):	Não listado	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	1	
Cód. Negociação Bolsa:	Não possui	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	Sem código	
Fundo investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	INVESTIDOR GERAL	
CNPJ do Fundo:	Não	
Segmento:	R\$ 0,00	
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00	
% Carteira do Fundo:	R\$ 0,00	
	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
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 Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	21/02/2018
Outras Observações:		
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)	<div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">PROponente José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> <div style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">Gestor Autorizador José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div>	

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 02 de março de 2018

Ofício RECIPREV nº 060/2018 – GI



Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 2.953.347,64 (Dois milhões, novecentos e cinquenta e três mil, trezentos e quarenta e sete reais e sessenta e quatro centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO: 13.077.415/0001-05 e aplicar o valor de R\$ 1.250.000,00 (Um milhão, duzentos e cinquenta mil reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35, ambos vinculados a conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 060/2018

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO 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

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife
Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000 , Boa Vista, Recife - PE
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647


**PREFEITURA DO
RECIFE**

Valor do consignado do RECIPREV de Fevereiro/2018
GERSON CRUZ SANTOS 26/02/2018 Hoje, 10:12JOSE MARCOS ALVES DE
BARROS;ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA;

Bom dia José Marcos! Solicito resgatar o valor referente a consignados de
FEVEREIRO/2018 no valor de:

Valor -----R\$ 1.703.775,80

GERSON CRUZ SANTOS

Analista de Controle Interno

Gerência Geral Matricial de Gastos Públicos - GGMAT

(081) 3355-9471 | gerson.santos@recife.pe.gov.br

Edf. Sede PCR, 14º Andar, Av. Cais do Apolo, 925, Bairro do Recife

Características

	● FUNDO	● BB Top RF C FI
CNPJ	13077415000105	06006071000188
Início do Fundo	28/04/2011	06/08/2004
Código Anbima	272604	130168
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Baixa Soberano	Renda Fixa Duração Média Grau de Invest.
Gestão	BB Dsvm S.A	BB Dsvm S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dsvm S.A	BB Dsvm S.A
Taxa máx. adm. (%)	1,00	0,00
Taxa performance	-	-
Data da Última Cotação	02/03/2018	02/03/2018
Cota	1,9021	20,438
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.452.437	15.508.269
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.268.065	15.673.624
Fundo de cotas	Sim	Não
Valor Invest	100,01	35,34
Nome do invest	BB Top RF Títulos Públicos Federais FI - Cotas d... LFT 210100 2021-09-01 - Operações compromiss...	
Investidor qualificado	Não	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim	-
Resolução 3922	Sim	-

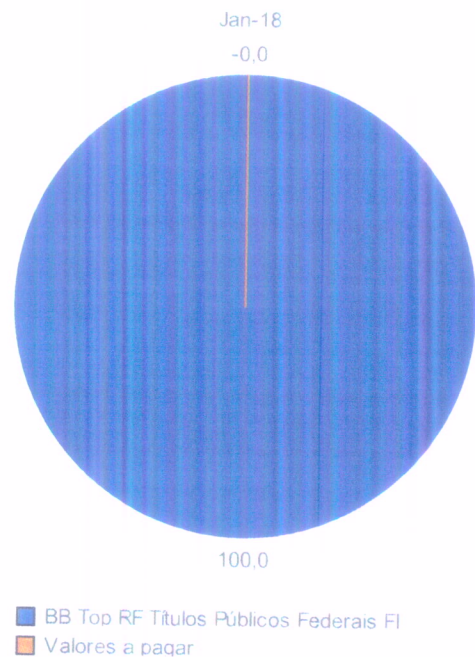
Retornos (%) (até 02/03/2018)

	out 2017	nov 2017	dez 2017	jan 2018	fev 2018	mar 2018	2016	2017	2018	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,56	0,48	0,45	0,49	0,39	0,04	13,11	8,87	0,92	7,80	21,84	37,35	90,21
● CDI	0,64	0,57	0,54	0,58	0,46	0,05	14,00	9,93	1,10	8,90	24,00	40,93	100,88
● IBOV	0,02	-3,15	6,16	11,14	0,52	0,48	38,94	26,86	12,25	30,23	91,03	68,09	30,59

Retorno Acumulado (252 dias)



Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	0,82
Menor Retorno Mensal (%)	0,04
Retorno Acumulado (%)	7,80
Volatilidade	0,11
Sharpe	-64,03
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,05

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economática é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Características

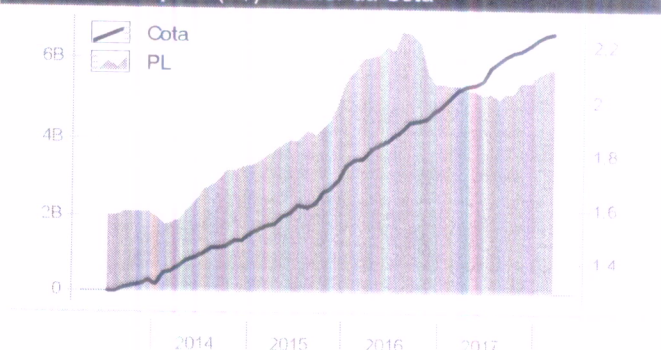
CNPJ	13322205000135
Início do Fundo	28/04/2011
Código Anbima	272612
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	BB DtvM S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB DtvM S.A
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	08/03/2018
Cota	2,243
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	5.715.600
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	5.317.571
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	10.000
Aplicação adicional mínima	0
Resgate mínimo	0
Saldo mínimo	0
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+001
Prazo pgto resgate	D+001

Benchmark IDKA IPGA 2A

Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



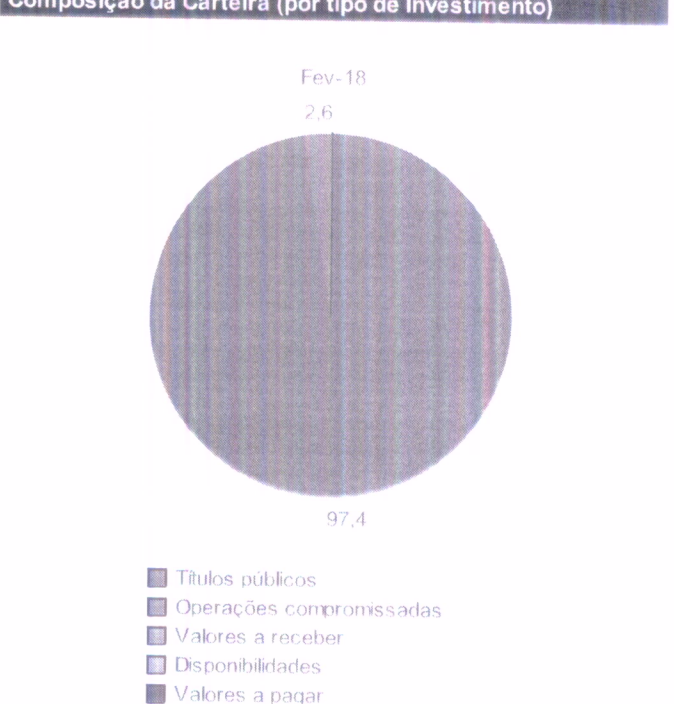
Retornos (%) (até 02/03/2018)

	out 2017	nov 2017	dez 2017	jan 2018	fev 2018	mar 2018	2016	2017	2018	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,76	0,28	0,86	0,96	0,56	0,15	14,89	12,40	1,68	11,39	25,25	46,75	124,30
● CDI	0,64	0,57	0,54	0,58	0,46	0,05	14,00	9,93	1,10	8,90	24,00	40,93	100,88
● IBOV	0,02	-3,15	6,16	11,14	0,52	0,48	38,94	26,86	12,25	30,23	91,03	68,09	30,59

Retorno Acumulado (252 dias)



Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	2,44
Menor Retorno Mensal (%)	0,28
Retorno Acumulado (%)	11,39
Volatilidade	2,70
Sharpe	0,87
VAR de 1 mês - 95% (%)	1,27

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economática é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.