



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:	065 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	065 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	18/03/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
R\$ 20.000.000,00			
Vinte milhões de 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\$ 20.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	8.080.907,55922890		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,47497		
Data da Operação:	18/03/2019		
Data de Liquidação:	19/03/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	6.957.580.240,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,287%		
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 (%):		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 atual. 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		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 Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	11/03/2019
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	

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

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF 334.326.354-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CIA

Validade da Certificação: 21/11/2021

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF 334.326.354-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CIA

Validade da Certificação: 21/11/2021

Recife, 18 de março de 2019

Ofício RECI-REV nº 065/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de 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.

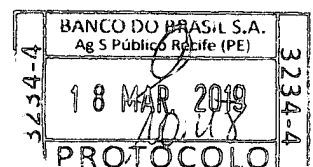
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 065/2019

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



:: BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

19/03/2019

Características

CNPJ: 13.322.205/0001-35
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTMV
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTMV
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anterior: 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

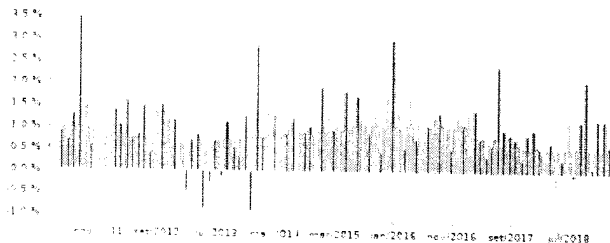
Retorno (%)	Início	Fim	12 meses	24 meses	36 meses	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18
Fundo	147,50	2,73	9,87	22,34	37,94	0,61	1,22	1,22	0,11	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,84	0,69	1,48
% do CDI	129,13	207,57	154,27	141,20	119,23	122,93	223,80	247,72	22,00	384,81	250,21	-13,55	227,52	55,59	163,16	133,48	278,85
CDI	114,22	1,31	6,40	15,82	31,82	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	51,64	13,31	17,26	53,98	100,90	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01
IBX	92,95	13,25	17,99	54,92	101,62	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08
IOP-M	54,50	1,14	7,52	7,42	13,00	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	Revez. Anual de Retorno Máx
Fundo	2.474.969,63	6.957.580,24	6.546.439,00	2,37%	-2,36%	1,12%	3,58	2,37%	2,09%	-0,84%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

Gráficos

Fundo CDI

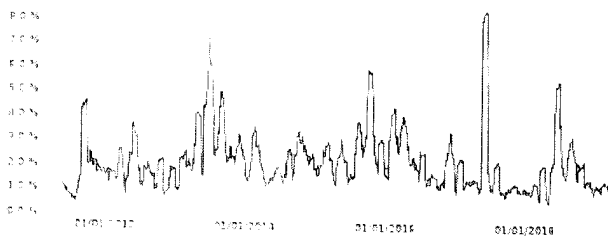
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 19/03/2019 (mensal)



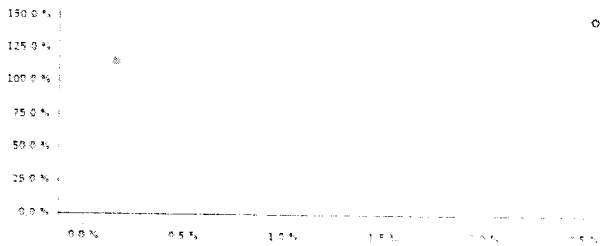
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 19/03/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 19/03/2019 (diária)

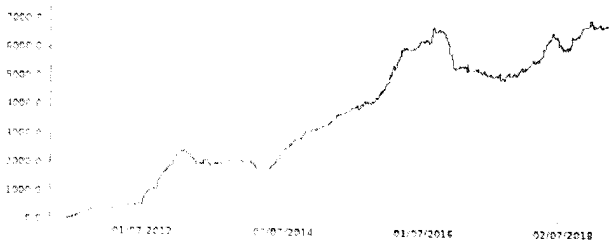


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 19/03/2019 (diária)

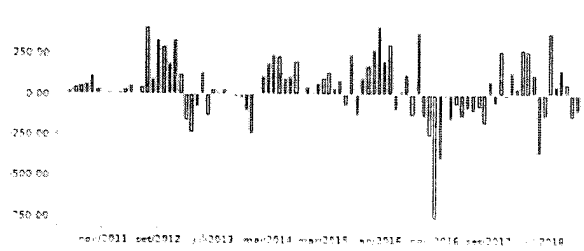


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou prestadas, consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela veracidade cabe ao emissor e não ao administrador do fundo. A administração do fundo não se responsabiliza por qualquer erro ou omissão. O administrador do fundo não garante a performance do fundo e não se responsabiliza por qualquer perda decorrente da aplicação do fundo. Os dados do fundo são atualizados diariamente. Retardos de divulgação do passado não representam garantia de rentabilidade futura. As estratégias de investimento utilizadas pelo fundo não garantem a preservação do valor nominal da aplicação. A volatilidade é considerada a partir da análise de 12 meses. Os valores expressos estão em Real (R\$). Para mais informações, favor consultar o site do fundo.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 19/03/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 19/03/2019 (mensal)



Composição da Carteira

fev/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	IL Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

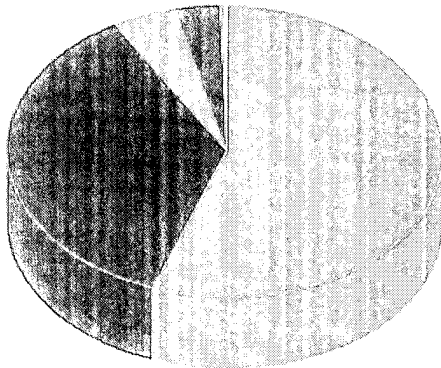
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18
Títulos Públicos	96,76%	98,12%	98,09%	98,75%	98,87%	99,23%	99,56%	99,53%
Operações Compromissadas	3,40%	1,87%	1,91%	1,25%	1,13%	0,77%	0,44%	0,48%
Outras operações passivas e equitativas	0,16%	-	-	-	-	-	-	-
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%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,00%	0,01%	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)	6.882.421,50	6.832.498,25	6.854.500,35	6.923.282,00	6.844.791,59	6.551.962,37	6.422.224,91	6.047.649,86
Data da Divulgação	12/03/2019	05/02/2019	09/01/2019	04/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	05/09/2018	03/08/2018

As informações são apresentadas para títulos públicos ou privados considerados confiáveis, cuja responsabilidade pela liquidação é oriunda da emissão, em cada caso, pelo emissor dos títulos ou pelo administrador dos títulos de qualquer empresa. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de investimento ou garantia de qualquer natureza em relação ao produto. Características de desempenho: O histórico de rentabilidade no passado não representa garantia de estabilidade futura. As estratégias de investimentos adotadas pelo administrador do fundo de investimentos podem resultar em significativas perdas para seus cotistas, superiores ao capital aplicado e a consequente elevação do custo de aplicação para os cotistas. Para maiores detalhes consulte o Regulamento do fundo de investimentos e o relatório de análise de risco emitido pelo administrador do fundo. Os valores exibidos são em Real (R\$). Para maiores detalhes consulte o site do administrador do fundo. Última atualização: 12/03/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

36,7% 119



NTN-B - Venc. 15/05/2021	55,60 %
NTN-B - Venc. 15/08/2020	36,19 %
NTN-B - Venc. 15/08/2022	4,74 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc. 01/09/2021	3,40 %
NTN-B - Venc. 15/05/2019	0,23 %
Outras operações passivas e exigibilidades / COMP TOMADA PRE - 15	0,16 %
Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
Outros Valores a pagar	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	0,00 %

As informações aqui foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção ou não dos dados não é assumida pela BBIDKA. Não se responsabiliza por qualquer dano ou prejuízo de seu grupo empresarial. As informações aqui apresentadas não devem ser entendidas como recomendações de investimento ou qualquer outra recomendação de natureza financeira. Os dados aqui apresentados não devem ser entendidos como garantia de resultados futuros. A distribuição de títulos no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias aqui descritas não representam qualquer recomendação de investimento. Os valores aqui apresentados podem sofrer alterações sem qualquer aviso prévio. Não se responsabiliza por qualquer dano ou prejuízo de seu grupo empresarial. A BBIDKA recomenda a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento aqui apresentado. Este relatório não constitui oferta de um fundo de investimento e não deve ser utilizado para análise de longo prazo (12 meses) ou mais. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para obter mais informações, consulte o site da BBIDKA.