



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 Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 Valor: R\$ 10.000.000,00 Dez milhões de reais | Nº / ANO: | 068 /2019 - GI | |
| | OF. Nº: | 068 /2019 - GI | |
| | Data: | 19/03/19 | |
| | Fundo de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a" | | |
| Sim para todos os fundos desta APR | | | |
| HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS: | | | |
| Fundo: | BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO | | |
| CNPJ do Fundo: | 10 418 335/0001 88 | | |
| Segmento: | FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações | | |
| Tipo de Ativo: | Fundo de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a" | | |
| Tipo de operação realizada: | Aplicação | | |
| Valor da operação: | R\$ 10.000.000,00 | | |
| Quantidade de Cotas: | 3.916.455,33101637 | | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 2,55333 | | |
| Data da Operação: | 19/03/2019 | | |
| Data de Liquidação: | 20/03/2019 | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ | 462.772.700,00 | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | | 2,161% | |
| 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: | 10/06/2009 |
| Taxa Administração do FI (%): | 1,00 |
| Índice de Referência do FI: | IGC |
| 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 listar |
| Resgate (dias): | 4 |
| Cód. Negociação Bolsa: | Não listar |
| 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: | 27.146.328/0001-77 |
| 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: O fundo tem por objetivo buscar retorno próximo à variação do IGC - Índice de Governança Corporativa, divulgado pela BOVESPA, através de investimento, nos limites estabelecidos em seu regulamento, em carteira diversificada de ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores ou entidade mantenedora de mercado de balcão organizado autorizada pela CVM, sejam admitidas à negociação em segmento especial mantido nos moldes do Novo Mercado ou classificadas nos moldes dos Níveis Bovespa 2, 1 e/ou BOVESPA MAIS</p> <p>Principais riscos do fundo: Risco de Investimento em Ações (Risco 5)</p> <p>Risco do Fundo atribuído pelo Administrador: Risco Muito Alto</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 | 0,59% |
| Retorno Médio Anual | 7,32% |
| Retorno Total | 76,95% |

| | |
|---|--|
| Maior Retorno | 11,85% |
| Menor Retorno | -9,83% |
| Qtde. mês Positivo | 52 |
| Qtde. mês Negativo | 45 |
| Qtde. mês acima do Benchmark | 27 |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark | 71 |
| Risco Mensal Período | 4,95% |
| Risco Mensal 12 MESES | 6,25% |
| Risco Anual do Período | 17,15% |
| Retorno Relativo ao Benchmark | -6,49% |
| Sharpe | -0,16 |
| Information Ratio | -0,90 |
| Tracking Error | 0,99% |
| VAR HISTÓRICO (95%) | 8,85% |
| VAR 12 MESES (95%) | 9,57% |
| Sharpe Modificado | -0,17 |
| Beta (12 meses) | 0,92 |
| Erro Quadrático Médio (EQM) | 0,29% |
| 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 RECIPREV 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? | 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

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPI nº 334.326.354/00

Entidade Certificadora ANBIMA

CFA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPI nº 334.326.354/00

Entidade Certificadora ANBIMA

CFA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE
RECIFE**

Recife, 19 de março de 2019

**RECI
PREV**

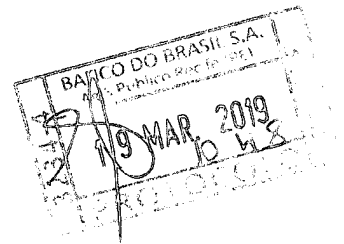
Ofício RECI PREV nº 068/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 10.000.000,00 (Dez milhões de reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 10.418.335/0001-88; vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 068/2019

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

Características

CNPJ: 10.418.335/0001-88
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 1,00%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Ações Indexados
 Código de Referência: 228842
 Início do Fundo: 10/06/2009

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+1 du
 Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+4 du

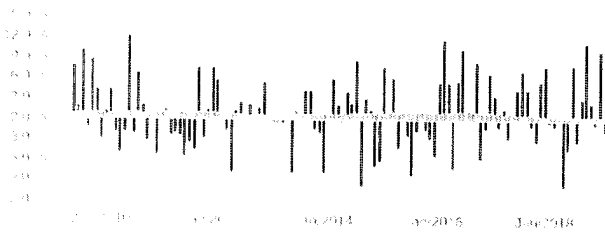
| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | fev/19 | jan/19 | dez/18 | nov/18 | out/18 | set/18 | ago/18 | jul/18 | jun/18 | mai/18 | abr/18 | mar/18 |
|-------------|--------|--------|----------|----------|----------|---------|----------|---------|--------|----------|--------|---------|----------|---------|-----------|--------|---------|
| Fundo | 155,33 | 11,15 | 18,51 | 47,75 | 87,35 | -1,80 | 10,42 | -0,87 | 2,66 | 11,52 | 3,25 | -3,26 | 8,22 | -4,40 | -9,79 | 0,70 | -1,01 |
| % do CDI | 100,31 | 833,11 | 289,41 | 302,24 | 274,80 | -364,72 | 1.918,36 | -175,53 | 539,87 | 2.121,76 | 694,51 | -575,48 | 1.516,09 | -849,74 | -1.890,96 | 135,08 | -189,98 |
| CDI | 154,85 | 1,34 | 6,40 | 15,80 | 31,79 | 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 | 83,06 | 11,55 | 15,50 | 49,60 | 97,51 | -1,86 | 10,82 | -1,81 | 2,38 | 10,19 | 3,48 | -3,21 | 8,86 | -5,20 | -10,87 | 0,88 | 0,01 |
| IBX | 133,84 | 11,49 | 16,21 | 50,52 | 98,36 | -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 | 76,00 | 1,16 | 7,51 | 7,44 | 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 | Veze Acima do Benchmark |
|----------------------------|-------------|--------------|--------------------|--------------|--------------|-------|-------|----------------|----------------|----------------|-------------------------|
| Fundo | 2.553329262 | 462.772,70 | 309.525,86 | 21,01% | -17,04% | 9,98% | 32,81 | 21,01% | 11,52% | -9,79% | 6 |
| CDI | - | - | - | 0,00% | - | 0,00% | 1,00 | 0,00% | 0,57% | 0,47% | 0 |

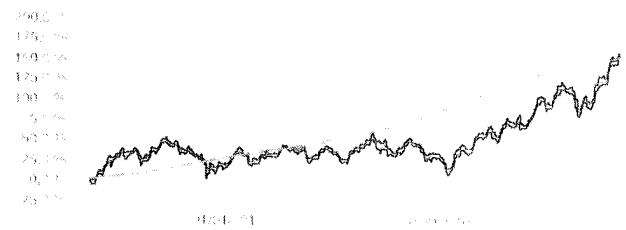
Gráficos

▣ Fundo ▨ CDI

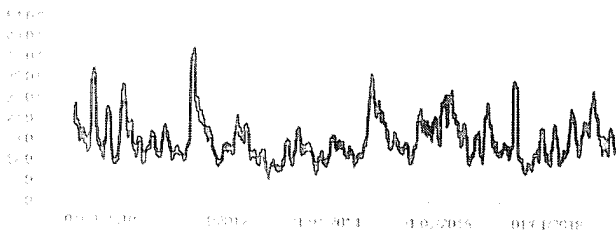
Retorno Mensal - 15/06/2009 a 20/03/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 15/06/2009 a 20/03/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 15/06/2009 a 20/03/2019 (diária)

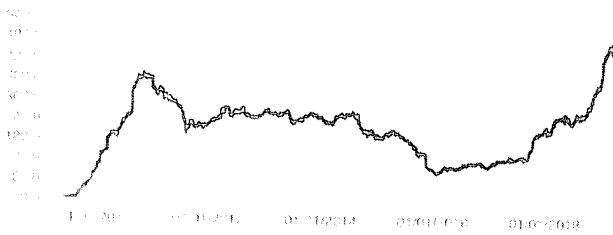


Risco x Retorno - 15/06/2009 a 20/03/2019 (diária)

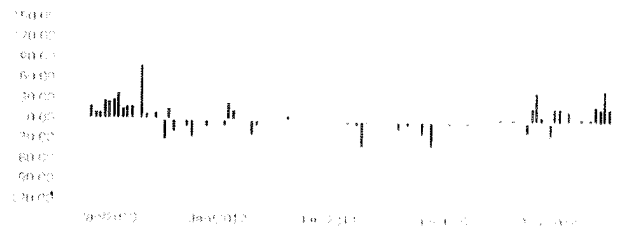


As informações são fornecidas a partir de fontes públicas ou privadas, consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela precisão e atualidade é dos respectivos emissores. Não há garantia de que as informações aqui apresentadas sejam corretas, completas ou atualizadas. O investidor deve realizar sua própria análise de risco e não deve confiar exclusivamente nas informações aqui apresentadas. O fundo não garante a recuperação do valor aplicado e não oferece qualquer tipo de garantia de retorno. O fundo não é adequado para todos os investidores e pode não ser adequado para alguns tipos de investidores. O fundo não é um produto de investimento seguro e pode sofrer perdas. O fundo não é um produto de investimento seguro e pode sofrer perdas. O fundo não é um produto de investimento seguro e pode sofrer perdas.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 15/06/2009 a 20/03/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 15/06/2009 a 20/03/2019 (mensal)



Composição da Carteira

fev/2019

Performance dos Fundos em Carteira

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

Não há fundos(FI) na carteira

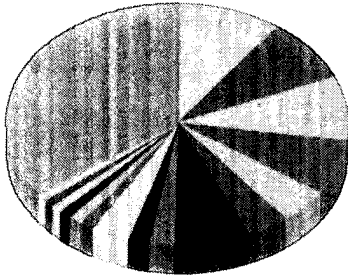
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

| Tipo de Aplicação | fev/19 | jan/19 | dez/18 | nov/18 | out/18 | set/18 | ago/18 | jul/18 |
|--|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Ações | 92,22% | 94,49% | 91,29% | 92,96% | 95,25% | 95,58% | 94,76% | 96,07% |
| Certificada ou recibo de depósito de valores mobiliários | 2,41% | 2,45% | 2,29% | 2,28% | 2,73% | 2,68% | 2,78% | 3,13% |
| Operação Compromissada | 2,28% | 3,49% | 3,17% | 1,88% | 2,71% | 1,57% | 2,60% | 0,66% |
| Valores a receber | 1,41% | 1,01% | 0,89% | 0,44% | 0,50% | 0,20% | 10,82% | 0,20% |
| Outras Aplicações | 0,02% | 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 | -0,06% | 0,00% | 0,08% | -0,00% | 0,01% | -0,01% | 0,01% | -0,01% |
| Valores a pagar | -0,25% | -3,08% | -0,22% | -0,17% | -1,20% | -0,03% | -10,99% | -0,06% |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 462.739,42 | 447.231,35 | 360.081,52 | 340.325,38 | 305.635,24 | 267.797,23 | 261.257,72 | 263.003,32 |
| Data da Divulgação | 12/03/2019 | 06/02/2019 | 08/01/2019 | 05/12/2018 | 05/11/2018 | 03/10/2018 | 05/09/2018 | 02/08/2018 |

As informações aqui foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualizações cabe às fontes citadas. A BB FUNDOS PREVIDENCIÁRIOS não se responsabiliza por qualquer erro ou omissão. Os dados de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. O gestor da carteira de aplicação não garante o desempenho futuro do fundo. Os resultados obtidos no passado não representam garantia de rentabilidade futura. As estratégias e os investimentos utilizados pelo fundo podem sofrer alterações sem aviso prévio. O fundo pode sofrer alterações em suas estratégias e investimentos, o que pode resultar em significativas perdas para seus investidores. A BB FUNDOS PREVIDENCIÁRIOS não recomenda a leitura cuidadosa do prospecto e o regulamento do fundo de investimento de aplicação em ações. Para obter mais informações sobre o fundo de investimento em ações, consulte o regulamento do fundo de investimento em ações, disponível em www.bb.com.br.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

fev/2019



| | |
|---|--------|
| ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4 | 9.67% |
| BRADESCO PN N1 - BBDC4 | 8.45% |
| VALE ON N1 - VALE3 | 8.41% |
| PETROBRAS PN - PETR4 | 7.21% |
| PETROBRAS ON - PETR3 | 4.71% |
| B3 ON NM - B3SA3 | 3.90% |
| BRASIL ON NM - BBAS3 | 3.89% |
| ITAUSA PN N1 - ITSA4 | 3.24% |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc. 01/09/2021 | 2.28% |
| BRADESCO ON N1 - BBDC3 | 1.93% |
| LOJAS RENNER ON NM - LREN3 | 1.78% |
| ULTRAPAR ON NM - UGPA3 | 1.68% |
| RUMO S.A. ON NM - RAIL3 | 1.26% |
| JBS ON NM - JBSS3 | 1.26% |
| LOCALIZA ON NM - RENT3 | 1.13% |
| BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3 | 1.03% |
| EQUATORIAL ON NM - EQTL3 | 0.95% |
| KROTON ON NM - KROT3 | 0.94% |
| Lançamentos positivos menores que 0.94% | 34.60% |

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade das informações cabe ao emissor. Não há garantia de que as informações sejam corretas, completas ou atualizadas. O emissor não se responsabiliza por qualquer prejuízo ou perda decorrente do uso das informações. Os dados são fornecidos para fins informativos e não devem ser utilizados como base para decisões de investimento. O emissor não garante a estabilidade futura. As estratégias de derivativos utilizadas em operações de hedge podem resultar em ganhos ou perdas significativas para seus cotistas, superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cobertura de perdas por parte dos cotistas em um fundo de investimento, e podem ser afetadas pela análise de curto prazo (12 doze) meses. Os valores exibidos são em Real (R\$). Para os dados de fundo, consulte o site do Fundo. Fonte: CVM, B3 e Anbima.