



**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° 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N° 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>	<b>Nº / ANO:</b>	<b>076 /2019 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>	<b>OF. Nº:</b>	<b>076 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	<b>Data:</b>	<b>26/03/19</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>		
<b>Valor:</b>		
R\$ 900.000,00		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
Novecentos mil reais		

Sim para todos os fundos desta APR

**HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:**

<b>Fundo:</b>	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	13.322.005/0001-35		
<b>Segmento:</b>	FI 100% Títulos Públicos		
<b>Tipo de Ativo:</b>	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Resgate		
<b>Valor da operação:</b>	R\$: 900.000,00		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	364.518,77378090		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,46874		
<b>Data da Operação:</b>	26/03/2019		
<b>Data de Liquidação:</b>	28/03/2019		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	7.006.076.010,00	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>		0,013%	
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>		15,00%	
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
<b>Administrador:</b>	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	30.822.936/0001-69		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	25/10/2018		
<b>Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Administrador com RPPS</b>		R\$ 56.854.639.000,00	
<b>% 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.</b>		5,82%	
<b>Gestor:</b>	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	30.822.936/0001-69		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	25/10/2018		
<b>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	R\$	54.952.582.976,91	
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>		5,66%	
<b>Empresa de Rating</b>		Fitch Ratings	
<b>Conceito</b>		Excelente	
<b>Representação do conceito</b>		Excelente	
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN</b>		Sim	
<b>Distribuidor:</b>	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	00.000.000/0001-91		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	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)	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 índice 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
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal		0,96%
Retorno Médio Anual		12,13%
Retorno Total		145,13%



Maior Retorno		
Menor Retorno		3,50%
Qtde. mês Positivo		-0,91%
Qtde. mês Negativo		84
Qtde. mês acima do Benchmark		10
Qtde. mês abaixo do Benchmark		35
Risco Mensal Período		59
Risco Mensal 12 MESES		0,78%
Risco Anual do Período		0,80%
Retorno Relativo ao Benchmark		2,72%
Sharpe		4,69%
Information Ratio		0,72
Tracking Error		-1,23
VAR HISTÓRICO (95%)		0,56%
VAR 12 MESES (95%)		2,25%
Sharpe Modificado		2,06%
Beta (12 meses)		0,99
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,85
		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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	11/03/2019
Outras Observações:	Destinado ao pagamento de consignações	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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, mantem 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**

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CFA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

**GESTOR(A) AUTORIZADOR**

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CFA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE  
RECIFE

Recife, 26 de março de 2019

RECI  
PREV

Ofício RECIPREV nº 076/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 900.000,00 (Novecentos 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 076/2019

Atenciosamente,

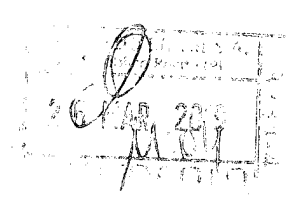


**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS



**FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JUNIOR**  
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**

28/03/2019

**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 du  
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 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	146,87	2,47	8,83	21,48	36,35	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	128,17	165,81	138,05	137,22	115,15	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	114,59	1,49	6,39	15,65	31,57	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	43,73	7,40	10,93	49,87	84,46	-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	83,04	7,43	11,73	50,76	85,60	-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	55,96	2,09	8,31	8,43	13,88	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64

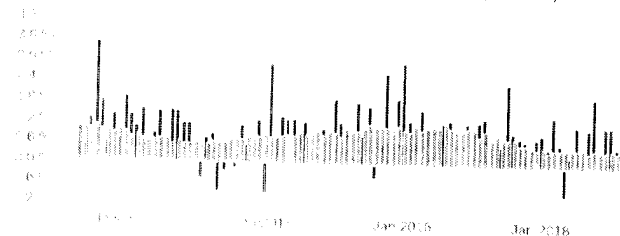
  

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze-Acima do Benchmark
Fundo	2.468737731	7.066.076,01	6.576.231,00	2,34%	-2,36%	1,11%	4,06	2,34%	2,09%	-0,84%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

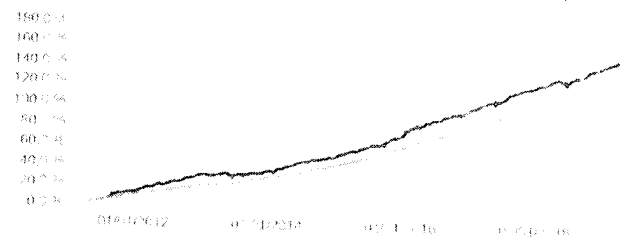
**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

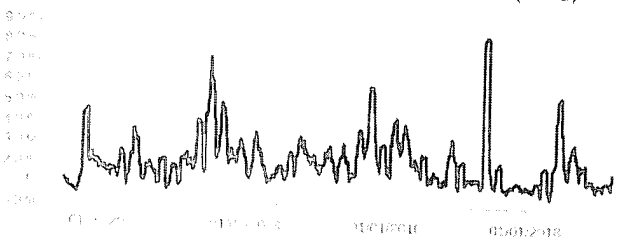
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 28/03/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 28/03/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 28/03/2019 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 28/03/2019 (diária)

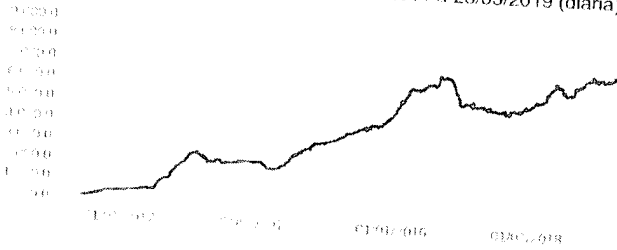


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade cabe às unidades da OJBANIL. Não há garantia de que qualquer uma das empresas de seu grupo empresarial, as informações disponíveis, não devam ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. Gestor do carteira de qualquer decisão sobre o que comprar ou vender em qualquer um dos fundos de investimento, a menos que haja um significativo perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente mudança de gestão de qualquer um dos fundos de investimento, não garante a continuidade do fundo de investimento. Não há garantia de que o fundo de investimento não seja liquidado. Para saber mais sobre o fundo de investimento, consulte o regulamento do fundo de investimento em aplicação de recursos. Para saber mais sobre o fundo de investimento, consulte o regulamento do fundo de investimento em aplicação de recursos. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os dados históricos foram utilizadas as informações disponíveis em 28/03/2019.

**:: BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

28/03/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 28/03/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 28/03/2019 (mensal)



Composição da Carteira

Performance dos Fundos em Carteira

fev/2019

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
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 exibições	0,16%	-	-	-	-	-	-	-
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-
Disponíveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Mercado Futuro - Posições contradas	-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

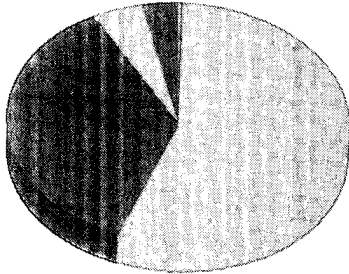
As informações foram obtidas a partir de títulos públicos ou privados considerados confiáveis, cuja responsabilidade pela veracidade e exatidão não é assumida pela BBANFI S.A. pelo titular desta carteira ou pelo qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundo de investimento em qualquer outra forma de títulos. Fundos de investimento não costumam ter a garantia do Administrador do fundo. Gestor da carteira de que dependa o aumento ou redução do patrimônio líquido. Características do Crescer 1 (C1): O histórico de rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos que adotamos podem gerar ganhos ou prejuízos dependendo da evolução dos preços de títulos. Seus resultados podem resultar em significativas perdas para seus cotistas, superiores ao capital aplicado e a consequente redução do patrimônio líquido. O objetivo principal do fundo é a aplicação de recursos em títulos de renda fixa de curto prazo, com o objetivo de proporcionar aos cotistas uma rentabilidade superior à taxa de juros de curto prazo. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os detalhes, consulte o Regulamento do Fundo (Fundus) e o Prospecto do Fundo (Fundus) em: [www.bb.com.br](http://www.bb.com.br).

**:: BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

28/03/2019

fev/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)



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 Celip	0.00 %
Valores a pagar / Auditoria	0.00 %
Outros Valores a pagar	0.00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	0.00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualidade não é assumida pela QUANTUMFI, ou qualquer outra marca ou qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não oferecem qualquer garantia de rendimento ou qualquer outra vantagem. O retorno em qualquer fundo de investimento do Brasil (FIDC) é variável e obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias e os objetivos, publicados como parte da oferta de qualquer fundo de investimento, não são garantia de significativas rendas para seus cotistas, supostos ao capital aplicado e a consequente obtenção de rentabilidade. Os valores são meramente informativos. O preço de qualquer fundo de investimento é determinado e recomendado a leitura cuidadosa do prospecto e regularização do fundo de investimento no âmbito dos recursos. Para mais informações consulte o site do Fundo QuantumFI.