



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE





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:	077 /2018 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	077 /2018 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13		Data:	29/03/18
Valor:			
R\$ 101.805,69		FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"	
Centos e um mil, oitocentos e cinco reais e sessenta e nove centavos		FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"	
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:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 101.805,69		
Quantidade de Cotas:	53.306,99026076		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,90980000		
Data da Operação:	29/03/2018		
Data de Liquidação:	29/03/2018		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.369.382.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,007434%		
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:	27/10/2017		
Gestor:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	27/10/2017		
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:	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 o 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	20/03/2018	
Outras Observações:			
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)		
CNPJ do Fundo:	13.633.964/0001-19		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 101.805,69		
Quantidade de Cotas:	416,04963409		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 244,69602100		
Data da Operação:	29/03/2018		
Data de Liquidação:	29/03/2018		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 5.223.950,97		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,948826%		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.		
CNPJ do Administrador:	62.285.390/0001-40		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	17/11/2017		
Gestor:	TERCON INVESTIMENTOS LTDA		
CNPJ do Gestor:	09.121.454/0001-95		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	01/11/2017		
Distribuidor:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.		
CNPJ do Distribuidor:	62.285.390/0001-40		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	17/11/2017		
Data de Início FI:	18/05/2012		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		

Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Liberum Rating	
Índice de Referência do FI:	125% do DI	
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:	8	
Carência (dias):	90	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	30	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve realizar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Cód. Negociação Bolsa:	Sem código	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR QUALIFICADO	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	R\$ 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 por objetivo proporcionar rendimentos aos Quotistas por meio da aquisição: (i) de Direitos Creditórios, juntamente com todos os direitos, privilégios, preferências, prerrogativas e ações assegurados aos titulares de tais direitos creditórios, tudo nos termos do Contrato de Cessão; e (ii) de ativos financeiros, conforme a Política de Investimento estabelecida no Capítulo Dez do Regulamento. Os recursos do Fundo serão utilizados para a aquisição de Direitos Creditórios elegíveis, na proporção de, no mínimo, 50% (cinquenta por cento) do Patrimônio Líquido do Fundo. Os Direitos Creditórios são individualmente representados por Duplicatas ou cheques ("Títulos de Crédito"), por contratos de compra e venda e/ou de prestação de serviços, de titularidade de empresas atuantes nos segmentos financeiro, comercial, industrial, representados por duplicatas e cheques ("Cedentes" e "Direitos Creditórios", respectivamente). O Fundo poderá adquirir Direitos Creditórios, observada a vedação de que trata o Parágrafo 2º do artigo 39, da Instrução CVM 356, e outros ativos de um mesmo devedor, ou de coobrigação de uma mesma pessoa ou entidade, no montante de, no máximo, de 20% (vinte por cento) do Patrimônio Líquido do Fundo.
	Principais riscos do fundo:	O principal fato de risco do Fundo é a liquidez dos direitos creditórios que está ligado diretamente a atividade econômica dos Cedentes e Sacados envolvidos na operação
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recursos em razão do longo prazo de 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	
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos	20/03/2018
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s) <div style="display: flex; justify-content: space-around; margin-top: 20px;"> <div style="text-align: center;">  <p>PROponente Anderson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CPF: 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </div> <div style="text-align: center;">  <p>GESTOR/AUTORIZADOR José Marcos Alves de Barros Chefe de Investimentos CPF: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div>		

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 29 de março de 2018



Ofício RECIPREV nº 077/2018 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 101.805,69 (Cento e um mil, oitocentos e cinco reais e sessenta e nove centavos), 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 077/2018

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ELCIO 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


MUNICÍPIO DE
RECIFE

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

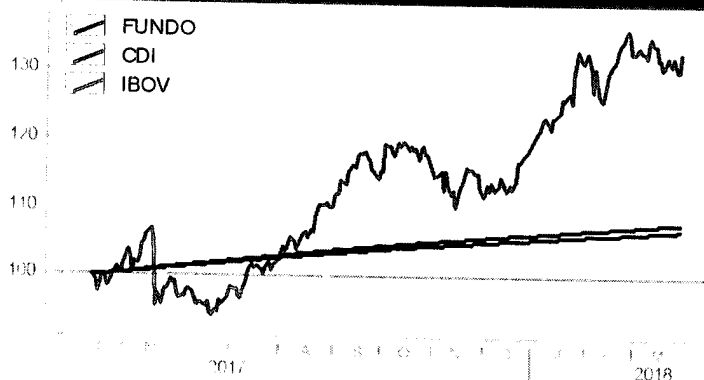
Características

	● 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	02/04/2018	02/04/2018
Cota	1,9098	20,537
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.259.102	15.536.894
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.251.953	15.676.009
Fundo de cotas	Sim	Não
Valor Invest	-	-
Nome do invest	-	-
Investidor qualificado	Não	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim	-
Resolução 3922	Sim	-

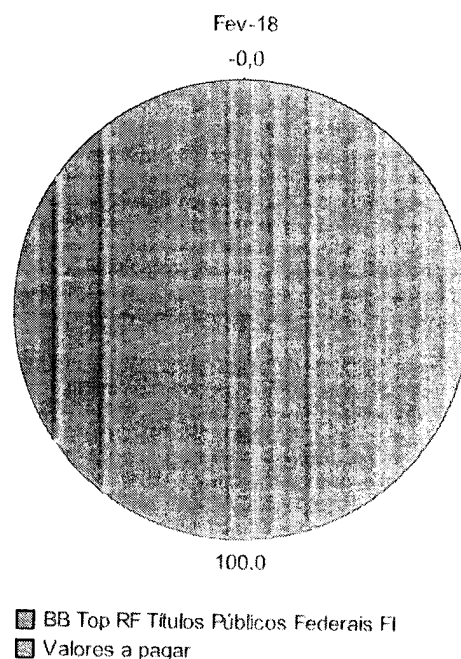
Retornos (%) (até 29/03/2018)

	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	0,44	13,11	8,87	1,32	7,37	21,28	36,75	90,98
● CDI	0,64	0,57	0,54	0,58	0,46	0,53	14,00	9,93	1,59	8,49	23,42	40,35	101,84
● IBOV	0,02	-3,15	6,16	11,14	0,52	0,01	38,94	26,86	11,73	30,27	66,88	70,41	29,99

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 (%)	0,39
Retorno Acumulado (%)	7,37
Volatilidade	0,10
Sharpe	-65,93
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.