



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	Nº / ANO:	078 /2019 - GI
	OF. Nº:	078 /2019 - GI
	Data:	26/03/19
Valor:	R\$ 966,12	
Novecentos e sessenta e seis reais e doze centavos	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE		
CNPJ do Fundo:	INVESTIMENTO		
Segmento:	13.077.415/0001-05		
Tipo de Ativo:	FI Renda Fixa Geral		
Tipo de operação realizada:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Valor da operação:	Resgate		
Quantidade de Cotas:	R\$ 966,12		
Valor da Cota (R\$):	0,0000048		
Data da Operação:	R\$ 2.007.975.071,00000		
Data de Liquidação:	26/03/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	26/03/2019	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		1.380.086.430,00	
Limite Máximo por PL do fundo		0,000%	
Banco/Agência/Conta:		15,00%	
Administrador:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
CNPJ do Administrador:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	30.822.936/0001-69		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	25/10/2018		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS		Sim	
% 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.		R\$ 56.854.639.000,00	
Gestor:		5,87%	
CNPJ do Gestor:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	30.822.936/0001-69		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	25/10/2018		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS		Sim	
% Recursos do Gestor com RPPS	R\$	54.952.382.976,91	
Empresa de Rating		5,66%	
Conceito		Fit: h Ratings	
Representação do conceito		Excelente	
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN		Excelente	
Distribuidor:		Sim	
CNPJ do Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:		00.000.006/0001-91	
		30/10/2018	

Data de Início FI:		28/04/2011
Taxa Administração do FI (%):		1,00
Índice de Referência do FI:		(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
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):		0
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:		sim
CNPJ do Fundo:		27.146.328/0001-77
Segmento:		Renda Fixa
Tipo de Ativo:		Fundos Renda fixa em 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
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		0,74%
Retorno Médio Anual		9,26%
Retorno Total		100,07%

Maior Retorno		1,17%
Menor Retorno		0,39%
Qtde. mês Positivo		94
Qtde. mês Negativo		0
Qtde. mês acima do Benchmark		1
Qtde. mês abaixo do Benchmark		93
Risco Mensal Período		0,22%
Risco Mensal 12 MESES		0,02%
Risco Anual do Período		0,77%
Retorno Relativo ao Benchmark		-6,33%
Sharpe		1,19
Information Ratio		-13,51
Tracking Error		0,07%
VAR HISTÓRICO (95%)		1,11%
VAR 12 MESES (95%)		0,79%
Sharpe Modificado		-51,58
Beta (12 meses)		0,77
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,07%
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 Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	11/03/2019
Outras Observações:	Pagamento de folha	
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, 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: Limina(s) do fundo(s) e ofício(s)

PROPOSTANTE

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF nº 326.354.00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CEA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF nº 326.354.00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CEA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

Recife, 26 de março de 2019

RECI
PREV

Ofício RECIPREV nº 078/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 966,12 (Novecentos e sessenta reais e doze centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05; vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 078/2019

Atenciosamente,



JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS



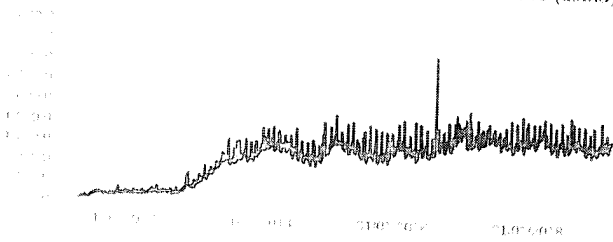
ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilmo Senhor
PEDRO PAULO
Gerente de Relacionamento
Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE
NESTA

:: BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

26/03/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 26/03/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 26/03/2019 (mensal)



Composição da Carteira

fev-2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark (12)

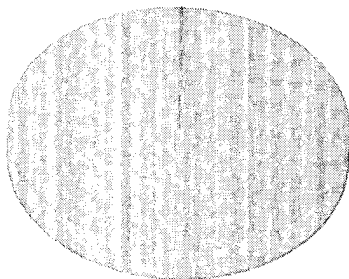
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desvio padrão	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,39	98,70	14,04	98,32	14,04	98,32	14,04	98,32	-	RS 1.291.825.101,54

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

Tipo de Aplicação	fev-19							
	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.231.918,99	1.301.788,30	1.157.483,38	1.226.386,94	1.120.973,03	1.316.299,80	1.278.234,77	1.135.822,82
Data da Publicação	06/03/2019	05/02/2019	04/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	04/09/2018	03/08/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

fev-2019



■ Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01%
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00%
■ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00%
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00%
■ Outros Valores a pagar	0,00%
■ Valores a pagar / Taxa Anfid	0,00%

As informações são fornecidas através de fontes públicas ou privadas, consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade das mesmas é de responsabilidade do emissor. A BB Fundos é uma instituição financeira autorizada pelo Banco Central do Brasil para a distribuição de valores mobiliários. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de investimento ou garantia de desempenho futuro. Os valores exibidos estão em R\$ mil. A BB Fundos é uma instituição financeira autorizada pelo Banco Central do Brasil para a distribuição de valores mobiliários. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de investimento ou garantia de desempenho futuro. Os valores exibidos estão em R\$ mil. A BB Fundos é uma instituição financeira autorizada pelo Banco Central do Brasil para a distribuição de valores mobiliários. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de investimento ou garantia de desempenho futuro. Os valores exibidos estão em R\$ mil.