



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:	080 /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	080 /2019 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	27/03/19
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 6.000.000,00		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Seis 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\$ 6.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	2.430.391,82520600		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,46874		
Data da Operação:	27/03/2019		
Data de Liquidação:	28/03/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	7.066.076.010,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		0,085%	
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\$ 56.854.639.000,00	
% 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.		5,82%	
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\$	54.952.382.976,91	
% Recursos do Gestor com RPPS		5,66%	
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 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 SFLIC 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	12,13%	
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 Previdência 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 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?	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

PROponente

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF 334.326.354-00

Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CFA

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 CFA

Validade da Certificação 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

Recife, 27 de março de 2019

RECI
PREV

Ofício RECI PREV nº 080/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 6.000.000,00 (Seis milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TITULOS PUBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35; vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 080/2019

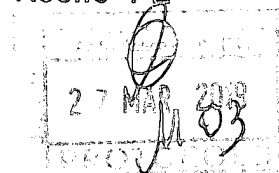
Atenciosamente,



JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR
DIRETOR VICE PRESIDENTE

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





JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>

Re: Pagamento de Consignados

GERSON CRUZ SANTOS <gerson.santos@recife.pe.gov.br>

27 de março de 2019 14:01

Para: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>

Boa tarde Zé Marcos! Houve uma alteração no valor dos consignados de Março/2019, peço que desconsidere o valor de R\$ 1.769.101,44, anteriormente informado e resgate o novo valor de R\$ 1.768.614,03 da conta 7909_X -RECIPREV, para pagamento dia 29/03/2019. Referentes a consignados da competência Março/2019.

ATT

Em seg, 25 de mar de 2019 às 14:22, JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br> escreveu:

Ok

Em seg, 25 de mar de 2019 às 2:21 PM, GERSON CRUZ SANTOS <gerson.santos@recife.pe.gov.br> escreveu:

Boa tarde Zé Marcos! Solicito resgatar o valor de R\$ 1.769.101,44 da conta 7909_X -RECIPREV, para pagamento dia 29/03/2019. Referentes a consignados da competência Março/2019.

ATT

Gerson Cruz Santos

--

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos - RECIPREV
Fone: (81) 99766-1068 / 3355-1642
zemarcos@recife.pe.gov.br

Rua Manoel Borba, 488
Boa Vista
Recife Pernambuco
50070-000
Brasil

Características

CNPJ: 13.322.205/0001-35
 Gestor: 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 de Furore: 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

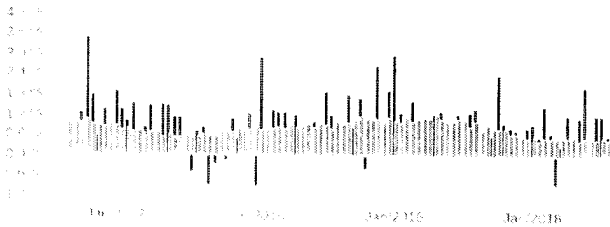
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18
Fundo	146,87	2,47	8,83	21,48	36,35	0,61	1,22	1,22	0,11	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,84	0,69	1,48
% do CDI	128,17	165,81	138,05	137,22	115,15	122,93	223,80	247,72	22,00	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	0,62	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

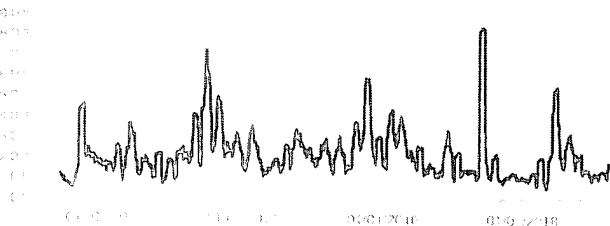
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 28/03/2019 (mensal)



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)

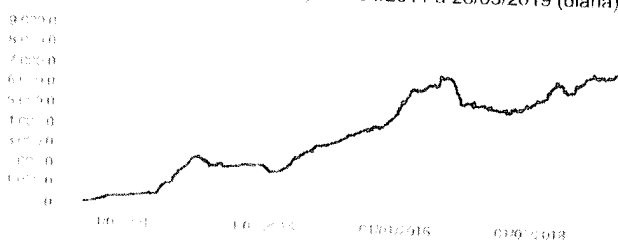


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela exatidão e veracidade recai sobre a população do FIDC. Não há garantia de retorno, nem qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser utilizadas como base para qualquer decisão de investimento. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. Gestor do ativo de qualquer mecanismo de proteção de crédito, não garante o recebimento de valores. A garantia obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias adotadas pelo administrador podem sofrer alterações sem aviso prévio. O administrador não recomenda a abertura de uma posição de investimento em qualquer ativo financeiro. A abertura de uma posição de investimento em qualquer ativo financeiro não representa recomendação do administrador do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para obter mais informações sobre o fundo de investimento, consulte o regulamento do fundo de investimento em Renda Fixa. Para os cálculos foi utilizada a metodologia de cálculo de risco e retorno. Para os cálculos foi utilizada a metodologia de cálculo de risco e retorno.

:: 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

fev/2019

Performance dos Fundos em Carteira

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

Não há fundos(FI) na carteira

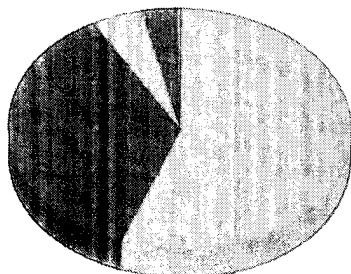
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

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 exigibilidades	0,16%	-	-	-	-	-	-	-
Valores a receber	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 foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualidade cabe ao assinante pelo QUANTUM. Não há qualquer garantia de que qualquer das empresas do seu grupo empresarial, as informações disponíveis, não devam ser entendidas como recomendações distribuídas ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro veículo mobiliário. Fundos de investimento não costumam com a garantia do Administrador do fundo. Gestão da carteira de qualquer tipo de ativo de risco não é garantida. O rendimento do investimento em títulos públicos não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias participativas utilizadas não podem garantir a rentabilidade do fundo de investimento. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias participativas utilizadas não podem garantir a rentabilidade do fundo de investimento. As estratégias participativas utilizadas não podem garantir a rentabilidade do fundo de investimento. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias participativas utilizadas não podem garantir a rentabilidade do fundo de investimento. Para os valores foram utilizadas as seguintes fontes: Banco de Dados.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

fev/2019



NTN-B - Venc.: 15/05/2021	55.60 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2020	35.19 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	1.74 %
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 foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela exatidão e veracidade não é assumida pela QUANTUM. Este fundo desta marca não pode, em qualquer das circunstâncias de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundos de investimento em qualquer categoria de investimentos. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer instituição financeira ou da Fapesp, Garante de Créditos - FCG. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos utilizadas como parte da política de investimento deste fundo de investimento podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do investidor de aportar recursos para manter a participação no fundo de investimento. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas as seguintes taxas: Taxa de Juro: 0,50% a.a.