



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

| | | |
|---|------------------|---|
| AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR | Nº / ANO: | 085 /2019 - GI |
| Unidade Gestora do RPPS | OF. Nº: | 085 /2019 - GI |
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores | Data: | 01/04/19 |
| CNPJ: 05.244.336/0001-13 | | |
| Valor: | | |
| R\$ 390,00 | | Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a" |
| Trezentos e noventa reais | | |

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 INVESTIMENTO | | |
| CNPJ do Fundo: | 13.077.415/0001-05 | | |
| Segmento: | FI Renda Fixa - Geral | | |
| Tipo de Ativo: | Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a" | | |
| Tipo de operação realizada: | Resgate | | |
| Valor da operação: | R\$ 390,00 | | |
| Quantidade de Cotas: | 194,06817342 | | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 2,00960 | | |
| Data da Operação: | 01/04/2019 | | |
| Data de Liquidação: | 01/04/2019 | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ | 1.140.825.560,00 | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | | 0,000% | |
| 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\$ 56.854.439.000,00 | |
| % 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 BACDEN | 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 (%): | 1,00 | |
| 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 | |
| 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 RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações | |
| | Data da reunião do Comitê de Investimentos | 11/03/2019 |
| Outras Observações: | Ordem cancelada | |
| 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: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)

PROPORINTE

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos
CPF 324.320.354-00
Entidade Certificadora ANBIMA
CFA e CEA
Validade da Certificação 21/11/2021

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos
CPF 324.320.354-00
Entidade Certificadora ANBIMA
CFA e CEA
Validade da Certificação 21/11/2021

**SAÚDE
RECIFE**

Recife, 01 de abril de 2019

**RECI
PREV**

Ofício RECI PREV nº 085/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar valor de R\$ 390,00 (Trezentos e noventa reais), no 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.

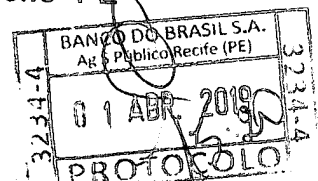
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 085/2019

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: 13.077.415/0001-05
 Gestor: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 1,00%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Soberano
 Código de Referência: 272604
 Início do Fundo: 28/04/2011

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 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+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

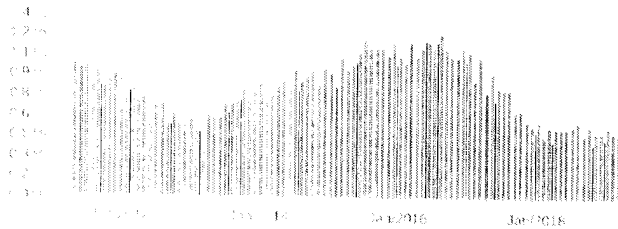
| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | mar/19 | fev/19 | jan/19 | dez/18 | nov/18 | out/18 | set/18 | ago/18 | jul/18 | jun/18 | mai/18 | abr/18 |
|-------------|--------|-------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo | 100,96 | 1,27 | 5,25 | 13,18 | 27,80 | 0,39 | 0,41 | 0,45 | 0,41 | 0,41 | 0,45 | 0,39 | 0,47 | 0,45 | 0,43 | 0,42 | 0,43 |
| % do CDI | 88,02 | 82,44 | 82,08 | 84,44 | 88,28 | 82,41 | 82,54 | 82,50 | 82,32 | 82,55 | 82,79 | 82,81 | 82,54 | 82,84 | 82,57 | 81,66 | 82,43 |
| CDI | 114,70 | 1,54 | 6,39 | 15,61 | 31,49 | 0,47 | 0,49 | 0,54 | 0,49 | 0,49 | 0,54 | 0,47 | 0,57 | 0,54 | 0,52 | 0,52 | 0,52 |
| Ibovespa | 46,26 | 9,29 | 14,52 | 51,20 | 93,31 | -0,18 | -1,86 | 10,82 | -1,81 | 2,38 | 10,19 | 3,48 | -3,21 | 8,88 | -5,20 | -10,67 | 0,88 |
| IBRX | 86,33 | 9,36 | 15,40 | 52,15 | 94,12 | -0,11 | -1,76 | 10,71 | -1,29 | 2,66 | 10,42 | 3,23 | -3,13 | 8,84 | -5,19 | -10,91 | 0,82 |
| IOP-M | 56,10 | 2,18 | 8,33 | 8,52 | 13,93 | 1,26 | 0,88 | 0,01 | -1,08 | -0,49 | 0,89 | 1,52 | 0,70 | 0,51 | 1,87 | 1,38 | 0,57 |

| Risco x Retorno (12 meses) | Cota | PL (R\$ mil) | PL Médio (R\$ mil) | Volatilidade | Perda Máxima | VaR | Beta | Tracking Error | Retorno Máximo | Retorno Mínimo | Vezes Acima do Benchmark |
|----------------------------|-------------|--------------|--------------------|--------------|--------------|-------|------|----------------|----------------|----------------|--------------------------|
| Fundo | 2,009603085 | 1.140.825,56 | 1.287.472,05 | 0,01% | - | 0,00% | 0,81 | 0,01% | 0,47% | 0,39% | 0 |
| CDI | - | - | - | 0,00% | - | 0,00% | 1,00 | 0,00% | 0,57% | 0,47% | 0 |

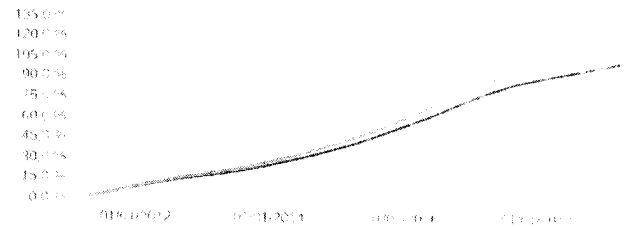
Gráficos

Fundo CDI

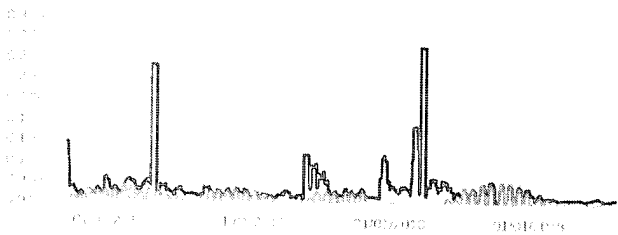
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 01/04/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 01/04/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 01/04/2019 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 01/04/2019 (diária)

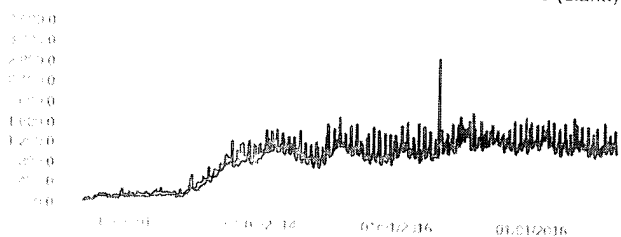


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela BBANBIDR. Este site é de caráter informativo e não constitui oferta de investimento. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer instituição financeira ou do Banco Garantidor de Créditos - BGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias aqui realizadas, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação de cotista de aportar recursos para o fundo para a manutenção do fundo. As informações aqui recomendadas a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para mais informações sobre o funcionamento de um fundo de investimento, consulte o regulamento, o prospecto, o regulamento do fundo de investimento ou aplique seus recursos. Para mais informações sobre o funcionamento de um fundo de investimento, consulte o regulamento, o prospecto, o regulamento do fundo de investimento ou aplique seus recursos. Para mais informações sobre o funcionamento de um fundo de investimento, consulte o regulamento, o prospecto, o regulamento do fundo de investimento ou aplique seus recursos. Fonte: Diretoria de Regulação e Supervisão de Investimentos - DRSI

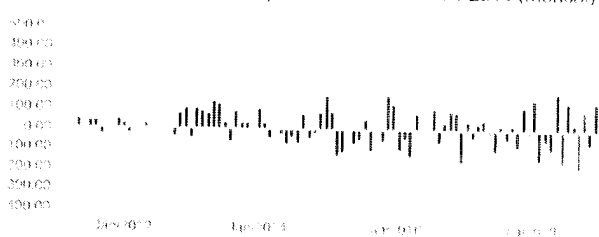
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

01/04/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 01/04/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 01/04/2019 (mensal)



Composição da Carteira

fev/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

| FUNDO | % do PL | Mês | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | | Volatilidade | 12 meses |
|--|---------|---------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|--------------|----------------------|
| | | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | | |
| BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA | 100,01 | 0,02 | 97,39 | 14,15 | 98,31 | 14,15 | 98,31 | 14,15 | 98,31 | - | PL Médio |
| | | | | | | | | | | | R\$ 1.287.518.899,01 |

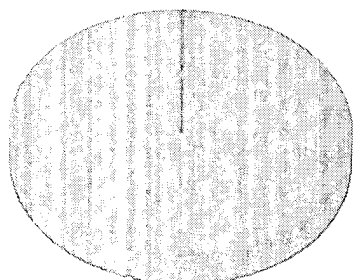
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

| Tipo de Aplicação | fev/19 | jan/19 | dez/18 | nov/18 | out/18 | set/18 | ago/18 | jul/18 |
|------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 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 | 1.316.299,88 | 1.278.234,77 | 1.135.822,82 |
| Data da Divulgação | 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 Anbip | 0,00 % |



As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela OUB FIC FI Renda Fixa Previdenciário, ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como recomendações de investimento ou qualquer outra forma de recomendação de investimento. Não contam com a garantia de Administração do fundo. Gestor da carteira de qualquer mecanismo de proteção ou seguro de títulos ou valores em garantia de crédito Realizado obtido no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias como derivativos, utilizadas como parte da política de investimento do fundo de investimento podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de fornecer recursos para o resgate do fundo de investimento. É recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para informações detalhadas consulte o site do fundo de investimento ou procure o analista de investimentos. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os detalhes veja o site do fundo de investimento. Fonte: Quantia Axi.