



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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>		<b>Nº / ANO:</b>	<b>106 /2019 - GI</b>
Unidade Gestora do RPPS		<b>OF. Nº:</b>	<b>106 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	<b>26/04/19</b>
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
<b>Valor:</b>			
R\$ 7.790.000,00		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Sete milhões, setecentos e noventa mil reais			
Sim para todos os fundos desta APR			
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>			
<b>Fundo:</b>	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	13.322.205/0001-35		
<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\$ 7.790.000,00		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	3.122.524,94803637		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,49478		
<b>Data da Operação:</b>	26/04/2019		
<b>Data de Liquidação:</b>	29/04/2019		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	7.203.177.690,00	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>		0,108%	
<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\$ 56.725.931.000,00		
<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>	5,78%		
<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\$	55.061.059.988,11	
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>		5,69%	
<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 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
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal		0,96%
Retorno Médio Anual		12,08%
Retorno Total		146,73%

Maior Retorno		3,50%
Menor Retorno		-0,91%
Qtde. mês Positivo		85
Qtde. mês Negativo		10
Qtde. mês acima do Benchmark		35
Qtde. mês abaixo do Benchmark		60
Risco Mensal Período		0,78%
Risco Mensal 12 MESES		0,77%
Risco Anual do Período		2,71%
Retorno Relativo ao Benchmark		-4,71%
Sharpe		0,72
Information Ratio		-1,23
Tracking Error		0,56%
VAR HISTÓRICO (95%)		2,24%
VAR 12 MESES (95%)		1,98%
Sharpe Modificado		1,00
Beta (12 meses)		0,85
Erro Quadrático Médio (EQM)		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	23/04/2019
Outras Observações:	Para pagamento de folha	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<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"</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>		
<b>Art. 7º, VII, "a"</b>		
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>		
<b>Art. 8º, IV, "a"</b>		
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)

PROponente

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 05.2430.264-25

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CFA

Validade da Certificação: 05/12/2020

Gestor/Autorizador

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 31.026.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE  
RECIFE

Recife, 26 de abril de 2019

RECI  
PREV

Ofício RECIPREV nº 106/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 7.790.000,00 (Sete milhões, setecentos e noventa 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 106/2019

Atenciosamente,

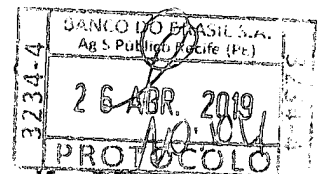


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS  
GERENTE DE INVESTIMENTOS



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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

29/04/2019

**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 Anual: Renda Fixa Indexados  
 Código de Referência: 272612  
 Início de 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 do  
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 do

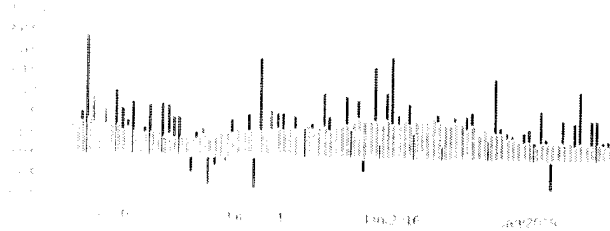
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18
Fundo	149,48	3,55	9,19	21,71	37,75	0,65	0,61	1,22	1,22	0,11	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,34	0,69
% do CDI	129,19	176,17	143,62	143,10	122,57	138,77	122,93	223,80	247,72	22,00	384,81	250,21	-13,55	227,52	55,59	-165,16	133,48
CDI	115,70	2,01	6,40	15,17	30,80	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	46,46	9,44	13,10	50,86	79,35	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88
IRX	86,68	9,57	14,04	51,74	81,66	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82
IGP-M	57,43	3,06	8,70	10,33	14,51	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57

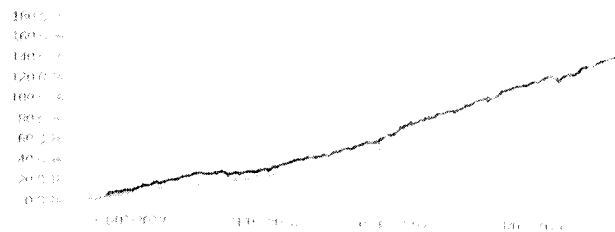
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,494775904	7.203.177,69	6.656.585,58	2,36%	-2,36%	1,12%	-4,26	2,36%	2,09%	-0,84%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

**Gráficos**

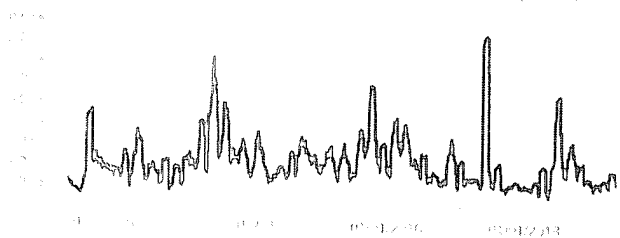
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 29/04/2019 (mensal)



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



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



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

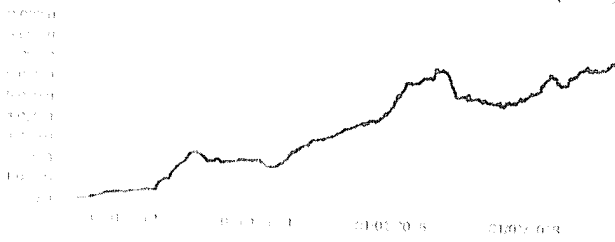


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualidade caberá ao investidor. Não há garantia de que as informações aqui apresentadas sejam corretas, completas ou atualizadas. As informações aqui apresentadas não devem ser consideradas como recomendações de compra ou venda de qualquer instrumento financeiro. O rendimento de qualquer instrumento financeiro não contém a garantia do Administrador do fundo. Estes de cada um dos valores aqui apresentados são apenas estimativas e não representam a realidade. O rendimento de qualquer instrumento financeiro não contém a garantia do Administrador do fundo. Estes de cada um dos valores aqui apresentados são apenas estimativas e não representam a realidade. O rendimento de qualquer instrumento financeiro não contém a garantia do Administrador do fundo. Estes de cada um dos valores aqui apresentados são apenas estimativas e não representam a realidade.

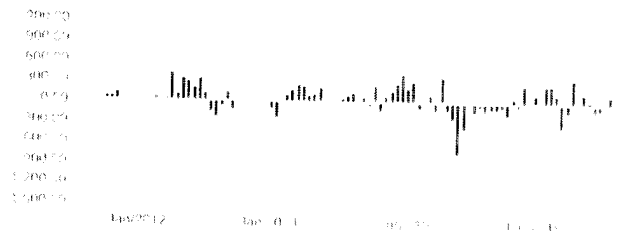
**:: BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

29/04/2019

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



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



Composição da Carteira

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

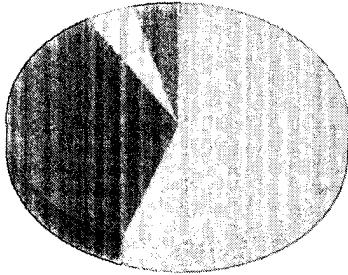
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18
Títulos Públicos	95,86%	96,76%	98,12%	98,09%	98,75%	98,87%	99,23%	99,56%
Operações Compromissadas	4,14%	3,40%	1,87%	1,91%	1,25%	1,13%	0,77%	0,44%
Valores a receber	0,00%	0,00%	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%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,00%	-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%
Outras operações passivas e exigibilidades	-	0,16%	-	-	-	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	7.065.416,53	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
Data da Divulgação	02/04/2019	12/03/2019	05/02/2019	09/01/2019	04/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	05/09/2018

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas, consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade das mesmas cabe aos seus respectivos emissores e não à BBIDCA. A BBIDCA não se responsabiliza por qualquer erro ou omissão de qualquer natureza, nem por qualquer prejuízo decorrente do uso das informações aqui apresentadas. As informações aqui apresentadas são apenas para fins informativos e não devem ser utilizadas como base para qualquer decisão de investimento. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias aqui divulgadas não são recomendadas para todos os investidores. A rentabilidade aqui apresentada é apenas para fins informativos e não deve ser utilizada como base para qualquer decisão de investimento. Para mais informações, consulte o site da BBIDCA ou o telefone 0800 00 1000. Para mais informações, consulte o site da BBIDCA ou o telefone 0800 00 1000.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

mar/2019



■ NTN-B - Venc. 15/05/2021	54,98 %
■ NTN-B - Venc. 15/08/2020	36,01 %
■ NTN-B - Venc. 15/08/2022	4,65 %
■ Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	4,14 %
■ NTN-B - Venc. 15/05/2019	1,22 %
■ Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0,00 %
■ Operações Compromissadas - NTN-F - Venc. 01/01/2025	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 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Outros Valores a receber	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção ou não do conteúdo não é assumida pela QUANTIA FIDUCIÁRIA. O investidor deve analisar as informações de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de investimento ou qualquer outra forma de aconselhamento financeiro. A Quântia Fideiúsa não garante a exatidão das informações. A Quântia Fideiúsa não oferece qualquer garantia de rendimento futuro. O custo de custódia de qualquer ativo financeiro é pago em percentual sobre o valor do ativo. A Quântia Fideiúsa não representa qualquer garantia de rentabilidade futura. As estratégias e sua rentabilidade podem variar e não há garantia de retorno. A Quântia Fideiúsa não recomenda a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para mais informações, consulte o site da Quântia Fideiúsa.