



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:	107 /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	107 /2019 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	26/04/19
CNPJ: 05.244.336/0001-13		
Valor:		
R\$ 3.539,47	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Três mil, quinhentos e trinta e nove reais e quarenta e sete centavos		

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO FM 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\$ 3.539,47		
Quantidade de Cotas:	1.754.82353529		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,01699		
Data da Operação:	26/04/2019		
Data de Liquidação:	26/04/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	1.428.763.320,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,00%		
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\$ 56.775.431.000,00		
% 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.	5,78%		
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\$	55.064.059.988,11	
% Recursos do Gestor com RPPS	5,69%		
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 (%):		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		9,21%
Retorno Total		100,84%
Maior Retorno		1,17%
Menor Retorno		0,39%
Qtde. mês Positivo		95
Qtde. mês Negativo		0
Qtde. mês acima do Benchmark		1
Qtde. mês abaixo do Benchmark		94
Risco Mensal Período		0,22%
Risco Mensal 12 MESES		0,03%
Risco Anual do Período		0,77%

Retorno Relativo ao Benchmark	-6,41%
Sharpe	-1,18
Information Ratio	-13,58
Tracking Error	0,07%
VAR HISTÓRICO (95%)	1,10%
VAR 12 MESES (95%)	0,79%
Sharpe Modificado	-50,57
Beta (12 meses)	0,76
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 Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECI-IPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos 23/04/2019
Outras Observações:	Pagamento de restos deixados
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, 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(s)

PROPOSTENTE

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Unidade de Investimentos

CPI 052.430.264-25

Entidade Certificadora: ANBIMA

PA 20 e CFA

Validade da Certificação: 05/12/2020

GESTOR AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gestor de Investimentos

CPI 052.430.264-00

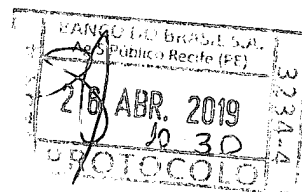
Entidade Certificadora: ANBIMA

PA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE
RECIFE**

Recife, 26 de abril de 2019



**RECI
PREV**

Ofício RECIPREV nº 107/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 3.539,47 (Três mil, quinhentos e trinta e nove reais e quarenta e sete 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 107/2019

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



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

Provisão de recursos para pagamento de Restos Deixados

ALUIZIO ROBERTO CORREIA OLIVEIRA <aluizioroberto@recife.pe.gov.br>

23 de abril de 2019 14:21

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

Cc: GERSON CRUZ SANTOS <gerson.santos@recife.pe.gov.br>, AMERICO DE OLIVEIRA MACHADO JUNIOR <americo.machado@recife.pe.gov.br>, ELCIO RICARDO LEITE GUIMARAES <elcio.guimaraes@recife.pe.gov.br>

Zé Marcos,

Solicito provisão de recursos para o pagamento de Restos Deixados da RECIPREV no valor total de R\$ 3 539,47 na conta 7909-X.

Desde já, agradeço

Características

CNPJ: 13.077.415/0001-05
 Gestão: 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

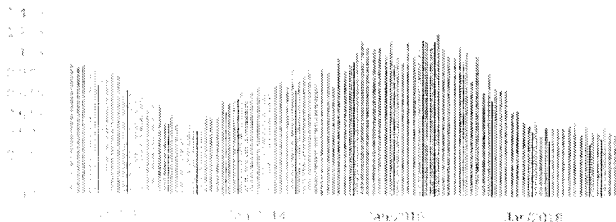
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18
Fundo	101,70	1,64	5,25	12,75	27,18	0,39	0,41	0,45	0,41	0,41	0,45	0,39	0,47	0,45	0,43	0,42	0,43
% do CDI	87,94	82,48	82,09	83,94	88,14	82,41	82,54	82,50	82,32	82,55	82,79	82,81	82,54	82,84	82,57	81,66	82,43
CDI	115,65	1,99	6,40	15,19	30,84	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	46,54	9,50	12,60	51,78	79,18	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88
IBX	86,77	9,62	13,59	52,54	81,41	-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	57,04	2,80	8,45	9,98	14,24	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	Veze Acima do Benchmark
Fundo	2,016994831	1.428.763,32	1.284.386,29	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

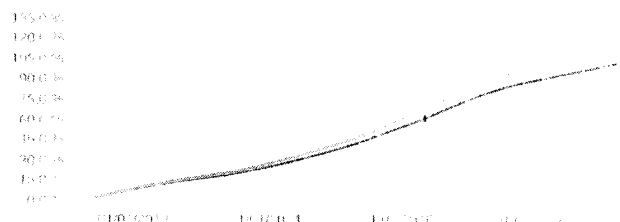
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

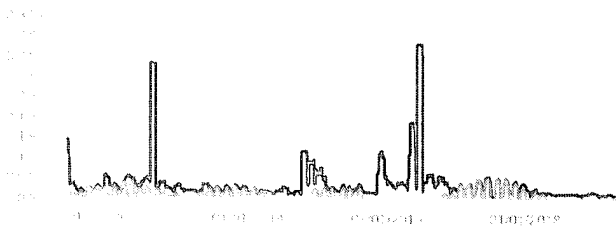
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 26/04/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 26/04/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 26/04/2019 (diária)

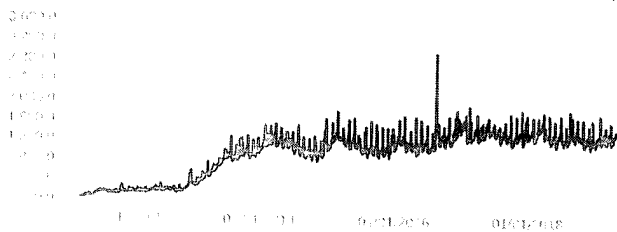


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 26/04/2019 (diária)

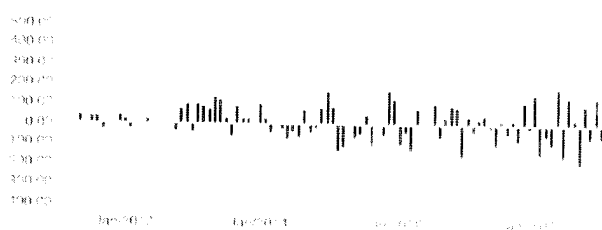


As informações herein são de fontes públicas ou privadas, consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade das mesmas pertence ao emissor do presente documento, não podendo ser entendidas como recomendação de compra ou venda de qualquer produto financeiro. Os valores aqui apresentados são apenas para fins informativos e não representam garantia de desempenho futuro. O desempenho passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias empregadas pelo fundo podem resultar em perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente elevação do custo de aplicação e a consequente redução da cobertura da aplicação. A administração do fundo recomenda a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para obter mais informações sobre o fundo de investimento, recomendamos a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizados os dados de fechamento de cada dia de trading.

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



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



Composição da Carteira

mar/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

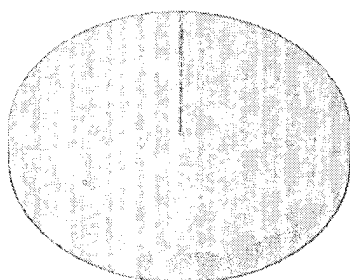
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses	PL Medio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo			
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,46	99,04	14,65	98,34	14,65	98,34	14,65	98,34	-	R\$ 1.284.359.803,20	

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
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%
Valores a pagar	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	0,00%
Patrimônio líquido (R\$ mil)	1.204.603,03	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
Data da Divulgação	02/04/2019	06/03/2019	05/02/2019	04/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	04/09/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

mar/2019



■ Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Anbid	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 BBASFI S.A. A BBASFI S.A. não se responsabiliza por qualquer erro ou omissão de informações. As informações disponíveis não devem ser consideradas como recomendação de investimento ou qualquer outra forma de recomendação. Os dados são fornecidos para fins informativos e não representam uma garantia de desempenho futuro. O desempenho passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias de alocação de ativos podem resultar em significativas perdas para seus investidores superiores ao capital aplicado e a consequente redução do valor de aplicação investido, podendo ocorrer a perda total do investimento. Ao investir, é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento no qual se investiu. Para maiores informações, consulte o site da BBASFI S.A. ou o telefone 0800 00 1000. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os valores foram utilizadas as seguintes fontes: Central Financeira.