



**RECIFE**  
PREFEITURA DA CIDADE



**PREFEITURA DO RECIFE  
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDORES  
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, DQU DE 26/04/2012

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>		<b>Nº / ANO:</b>	<b>108 /2019 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>		<b>OF. Nº:</b>	<b>108 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	<b>29/04/19</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>			
<b>Valor:</b>			
R\$ 165.790,36	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Cento e sessenta e cinco mil, setecentos e noventa reais e trinta e seis centavos			
Sim para todos os fundos desta APR			
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>			
<b>Fundo:</b>	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	13.077.415/0001-05		
<b>Segmento:</b>	FI Renda Fixa Geral		
<b>Tipo de Ativo:</b>	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Resgate		
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 165.790,36		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	82.179,99817015		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,01741		
<b>Data da Operação:</b>	29/04/2019		
<b>Data de Liquidação:</b>	29/04/2019		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	1.439.223.000,00	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	0,012%		
<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\$ 56.775.931.000,00		
<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\$	55.064.059.988,11	
<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 (%):		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
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>		
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 Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RFCIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos 23/01/2019
Outras Observações:	Refere-se a TED para pagar folha de abril no valor de R\$ 8.282.283,76 e o recebimento do parcelamento no valor de R\$ 326.493,40.
<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?	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
<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)

  
PROPOSTANTE

Anderson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Departamento de Investimentos

CNPJ 052.430.264-25

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 05/12/2020

  
GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CNPJ 052.430.264-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE  
RECIFE

Recife, 29 de abril de 2019

RECI  
PREV

Ofício RECI PREV nº 108/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 165.790,36 (Cento e sessenta e cinco mil, setecentos e noventa reais e trinta e seis 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.

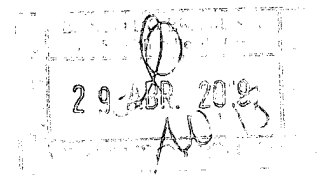
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 108/2019

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>

---

## Folha de abril/2019

---

**SANDRA MARIA GOMES GALINDO** <sandra.galindo@recife.pe.gov.br>

24 de abril de 2019 14:56

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

Cc: ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA <annap@recife.pe.gov.br>, SANDRA MARIA GOMES GALINDO <sandra.galindo@recife.pe.gov.br>

Zé Marcos, boa tarde!

Solicitamos o resgate de aplicações financeira da conta 65000-5 do Bradesco no valor de **R\$ 8.282.283,76**(oito milhões , duzentos e oitenta e dois mil, duzentos e oitenta e três reais e setenta e seis centavos), referente ao **pagamento de abril/2019** dos **APO/PPR e PEN**, transmitido eletronicamente pela EMPREL com data de pagamento previsto para o dia **30/04/2019, FUNDO RECIPREV.**

Informamos o valor líquido de **R\$ 21.397.075,08**(vinte e um milhões, trezentos e noventa e sete mil, setenta e cinco reais e oito centavos), referente a folha de **abril/2019** dos **APO/PPR e PEN** do **FUNDO RECIFIN.**

**AUT. PREV. MUN. RECIFE - RECIPREV**

**SAÚDE RECIFE** - Valor líquido **R\$ 53.523,60**(cinquenta e três mil, quinhentos e vinte e três reais e sessenta centavos)

**PREVIDÊNCIA** - Valor líquido **R\$ 177.969,85**(cento e setenta e sete mil, novecentos e sessenta e nove reais e oitenta e cinco centavos)

Sandra Galindo  
3355-1645

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

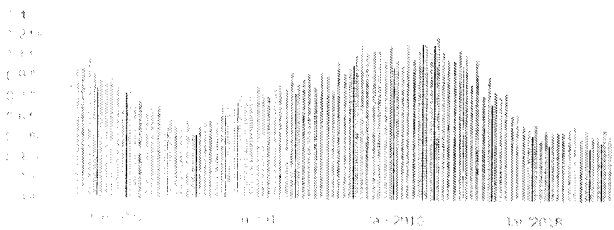
Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00  
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00  
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00  
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00  
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0  
 Conversão da Cota para Resgate: D+0  
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

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	101,74	1,66	5,25	12,73	27,15	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	87,93	82,48	82,09	83,92	88,15	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	115,70	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
IBX	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
IGPM	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

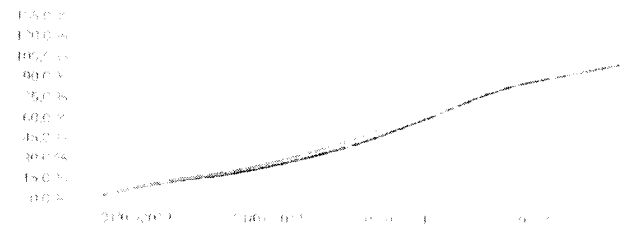
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2.017.405.253	1.438.223,00	1.284.553,75	0,01%	-	0,00%	0,81	0,01%	0,47%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

Gráficos

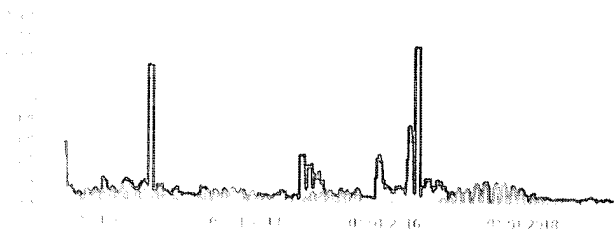
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 29/04/2019 (mensal)



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)

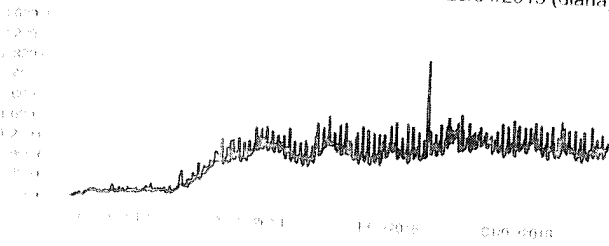


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas, consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e exatidão dos dados cabe aos seus emissores. Não há garantia de que as informações aqui apresentadas sejam corretas, completas ou atualizadas. As informações aqui apresentadas não devem ser utilizadas como recomendação de investimento. O desempenho passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias e investimentos aqui apresentados são de caráter informativo e não devem ser utilizados como base para a tomada de decisão de investimento. A administração do fundo não se responsabiliza por danos ou prejuízos decorrentes do uso das informações aqui apresentadas. Para mais informações, consulte o regulamento do fundo de investimento em aplicação em recursos fixos, disponível em [www.bb.com.br](#). Para obter a última versão, consulte o site do fundo. Última atualização: 29/04/2019.

**BB FLUXO FIC 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

mar/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

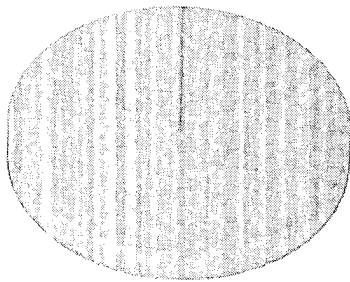
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo				
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,49	99,04	14,68	98,34	14,68	98,34	14,68	98,34	-	-	-	PI Médio
													R\$ 1.284.564.573,34

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	1.316.299,83	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 contidas neste relatório são de caráter informativo e não representam recomendação de compra ou venda de qualquer ativo financeiro. As informações contidas neste relatório não são garantidas e não representam garantia de liquidez ou de retorno. O fundo é um produto de investimento de médio e longo prazo, sujeito a variações de valor. O fundo é classificado como renda fixa e possui uma estratégia de investimento em títulos públicos federais. O fundo é registrado em nome do administrador e não possui personalidade jurídica própria. O fundo é classificado como renda fixa e possui uma estratégia de investimento em títulos públicos federais. O fundo é registrado em nome do administrador e não possui personalidade jurídica própria.