



**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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>	<b>Nº / ANO:</b>	<b>110 /2019 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>	<b>OF. Nº:</b>	<b>110 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	<b>Data:</b>	30/04/19
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>		
<b>Valor:</b>		
R\$ 1.767.651,71		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
Um milhão, setecentos e sessenta e sete mil, seiscentos e cinquenta e um reais e setenta e um centavos		


Sim para todos os fundos desta APR

**HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:**

<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\$ 1.767.651,71		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	2,01781592		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,49478		
<b>Data da Operação:</b>	30/04/2019		
<b>Data de Liquidação:</b>	30/04/2019		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	1.303.936.680,00	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>		0,136%	
<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 (%):		0,20
Índice de Referência do FI:		IDKA IPC A 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 Prvidência 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	
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos	23/04/2019
Pagamento de consignados		
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</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"		
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>		
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	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
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)

**PROponente**

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 092.430.264-25

Entidade Certificadora: ANBIMA

CFA 20 e CFA

validade da Certificação: 05/12/2020

**Gestor/Autorizador**

José Marcos Alves de Barros

Chefe de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

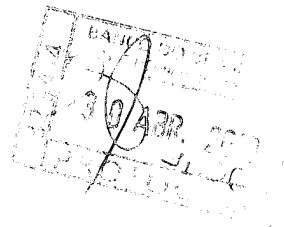
Entidade Certificadora: ANBIMA

CFA 20 e CFA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE  
RECIFE

Recife, 30 de abril de 2019



RECI  
PREV

Ofício RECI PREV nº 110/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 1.767.651,71 (Um milhão, setecentos e sessenta e sete mil, seiscentos e cinquenta e um reais e setenta e um 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 110/2019

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>

---

**Pagamento de consignados 04/2019**

---

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

29 de abril de 2019 10:46

Para: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>, ELCIO RICARDO LEITE  
GUIMARAES <elcio.guimaraes@recife.pe.gov.br>, AMERICO DE OLIVEIRA MACHADO JUNIOR  
<americo.machado@recife.pe.gov.br>, ANNA PAULA ALMEIDA NUNES E SILVA <annap@recife.pe.gov.br>

Bom Dia Zé Marcos! Solicito resgatar o valor de R\$ 1.767.551,71 da conta 7909-X -RECIPREV, para pagamento dia 30/04/2019. Referentes a consignados da competência Abril/2019.

ATT

Gerson Cruz Santos

**BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

30/04/2019

**Características**

CNPJ: 13.077.415/0001-05  
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM  
 Administração: BB Gestão de Recursos DTVM  
 Taxa de Administração: 1,00%  
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui  
 Classificação Anterna: Renda Fixa Duração Baixa Soberano  
 Código de Referência: 272604  
 Início de Fundo: 29/04/2011

**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

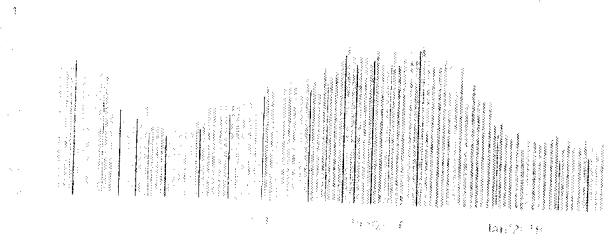
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18
Fundo	101,78	1,68	5,25	12,71	27,12	0,43	0,39	0,41	0,45	0,41	0,41	0,45	0,39	0,47	0,45	0,43	0,42
% do CDI	87,93	82,48	82,09	83,89	88,17	82,88	82,41	82,54	82,50	82,32	82,55	82,79	82,81	82,54	82,84	82,57	81,66
CDI	115,76	2,04	6,40	15,15	30,76	0,52	0,47	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52
Ibovespa	46,72	9,63	11,54	49,64	82,12	0,98	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87
IBX	87,05	9,79	12,57	50,67	84,10	1,06	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,14	-10,91
IOP-M	57,50	3,10	8,71	10,44	14,54	0,92	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38

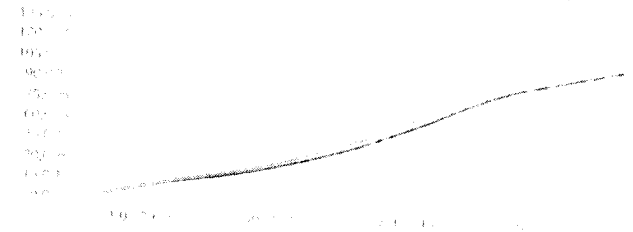
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	2.017815916	1.303.936,68	1.282.310,43	0,01%	-	0,00%	0,81	0,01%	0,47%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

■ Fundo ■ CDI

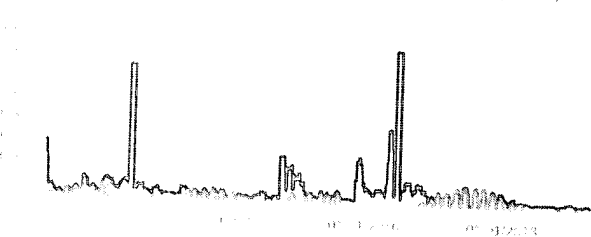
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 30/04/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 30/04/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 30/04/2019 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 30/04/2019 (diária)

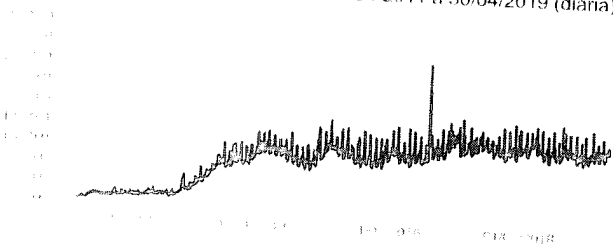


As informações contidas neste documento são de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis e não representam uma recomendação ou uma responsabilidade pela corretora em relação à compra ou venda de qualquer produto financeiro. O investidor deve avaliar o risco de cada operação antes de tomar qualquer decisão. A corretora não se responsabiliza por danos ou prejuízos decorrentes do uso das informações aqui contidas. Este documento não representa uma recomendação ou uma responsabilidade pela corretora em relação à compra ou venda de qualquer produto financeiro. O investidor deve avaliar o risco de cada operação antes de tomar qualquer decisão. A corretora não se responsabiliza por danos ou prejuízos decorrentes do uso das informações aqui contidas.

# BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

30/04/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 30/04/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 30/04/2019 (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		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100.01	0,51	99,04	14,71	98,34	14,71	98,34	14,71	98,34
R\$ 1.282.891.704,43									

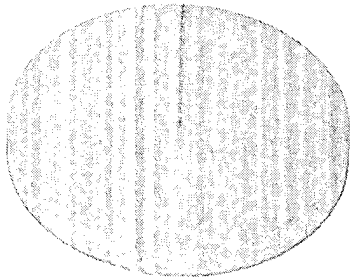
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

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 Distribuição	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 natureza pública ou privada e consideradas confidenciais, cuja responsabilidade pela veracidade e exatidão cabe ao emissor e não ao receptor. O emissor não garante a precisão das informações e não se responsabiliza por qualquer erro ou omissão. O receptor deve interpretar as informações de acordo com o contexto e não deve tomar decisões com base apenas no conteúdo deste relatório. Este relatório é fornecido apenas para fins informativos e não constitui recomendação de compra ou venda de qualquer produto financeiro. Os valores são expressos em reais e arredondados para o número inteiro mais próximo. Os valores são sujeitos a alterações sem aviso prévio. Este relatório é válido apenas para o período de 12 meses anteriores à data de publicação.