



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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>	<b>Nº / ANO:</b>	<b>111 /2019 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>	<b>OF. Nº:</b>	<b>111 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	<b>Data:</b>	<b>06/05/19</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>		
<b>Valor:</b>		
<b>R\$ 32.000.000,00</b>	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Trinta e dois milhões de reais		

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\$ 32.000.000,00		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	7.01781592		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,50229		
<b>Data da Operação:</b>	06/05/2019		
<b>Data de Liquidação:</b>	07/05/2019		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	7.307.924.480,00	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>		0,438%	
<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 DIVM (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 DIVM (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\$	55.064.019.988,11	
<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>	20/10/2018		

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

**Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior**

Retorno Médio Mensal	0,96%
Retorno Médio Anual	17,08%
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	0,77

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 RFCIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos	23/04/2019
<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)

**PROPORINENTE**

Andreson ~~de~~ Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

CPF: 052.430.264-25

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 05/12/2020

**GESTOR(A) AUTORIZADOR**

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 052.426.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE  
RECIFE

RECI  
PREV

Recife, 06 de maio de 2019



Ofício RECIPREV nº 111/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 32.000.000,00 (Trinta e dois milhões de 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 111/2019

Atenciosamente,

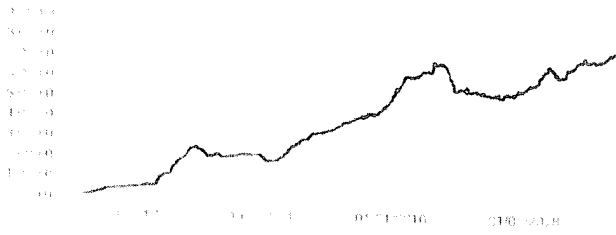
  
JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
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



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 07/05/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 07/05/2019 (mensal)



**Composição da Carteira**

abr/2019

**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											

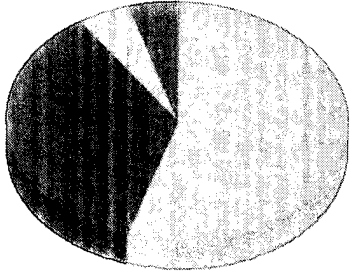
**Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)**

Tipo de Aplicação	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18
Títulos Públicos	95,45%	95,86%	96,76%	98,12%	98,09%	98,75%	98,87%	99,23%
Operações Compromissadas	4,54%	4,14%	3,40%	1,87%	1,91%	1,25%	1,13%	0,77%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,01%	-0,00%	-0,00%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	-
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%	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 exatibidades	-	-	0,16%	-	-	-	-	-
<b>Patrimônio Líquido (R\$ mil)</b>	<b>7.220.070,50</b>	<b>7.065.416,53</b>	<b>6.882.421,50</b>	<b>6.832.498,25</b>	<b>6.854.500,35</b>	<b>6.923.282,00</b>	<b>6.844.791,59</b>	<b>6.551.962,37</b>
<b>Data da Formação</b>	<b>06/05/2019</b>	<b>02/04/2019</b>	<b>12/03/2019</b>	<b>05/02/2019</b>	<b>09/01/2019</b>	<b>04/12/2018</b>	<b>06/11/2018</b>	<b>03/10/2018</b>

As informações são fornecidas pela parte de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis e não representam recomendação ou garantia de resultados. A administração não se responsabiliza por danos decorrentes do uso das informações. As informações disponíveis não devem ser utilizadas como base para decisões de investimento. O desempenho passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias para formação dos títulos públicos são analisadas periodicamente pelo Comitê de Investimentos. O risco de crédito não é totalmente eliminado e a liquidez pode ser afetada em situações de crise. A administração não se responsabiliza por danos decorrentes do uso das informações. As informações são fornecidas pela parte de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis e não representam recomendação ou garantia de resultados. A administração não se responsabiliza por danos decorrentes do uso das informações. As informações disponíveis não devem ser utilizadas como base para decisões de investimento. O desempenho passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias para formação dos títulos públicos são analisadas periodicamente pelo Comitê de Investimentos. O risco de crédito não é totalmente eliminado e a liquidez pode ser afetada em situações de crise. A administração não se responsabiliza por danos decorrentes do uso das informações.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

abr/2019



NTN-B - Venc.: 15/05/2021	54.63 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2020	35.72 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	4.88 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	4.54 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2019	0.22 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0.01 %
Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0.01 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	0.00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0.00 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0.00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0.00 %
Outros Valores a receber	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 %