



**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>121 /2019 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>	<b>OF. Nº:</b>	<b>121 /2019 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	<b>Data:</b>	<b>09/05/19</b>
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>		
<b>Valor:</b>		
<b>R\$ 2.900.000,00</b>		<b>Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"</b>
<b>Dois milhões e novecentos mil reais</b>		

Sim para todos os fundos desta APR

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

<b>Fundo:</b>	<b>BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	<b>13.077.415/0001-05</b>		
<b>Segmento:</b>	<b>FI Renda Fixa - Geral</b>		
<b>Tipo de Ativo:</b>	<b>Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"</b>		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	<b>Resgate</b>		
<b>Valor da operação:</b>	<b>R\$ 2.712.636,63</b>		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	<b>1.342.687,44337758</b>		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	<b>R\$ 2,02030</b>		
<b>Data da Operação:</b>	<b>09/05/2019</b>		
<b>Data de Liquidação:</b>	<b>09/05/2019</b>		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	<b>R\$</b>	<b>1.284.043.320,00</b>	
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>		<b>0,211%</b>	
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>		<b>15,00%</b>	
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	<b>Banco do Brasil S.A.</b>	<b>3234-4</b>	<b>7 909 X</b>
<b>Administrador:</b>	<b>BB DIVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)</b>		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	<b>30.827.936/0001-69</b>		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	<b>25/10/2018</b>		
<b>Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	<b>Sim</b>		
<b>Volume de Recursos do Administrador com RPPS</b>		<b>R\$ 56.725.931.000,00</b>	
<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>		<b>5,78%</b>	
<b>Gestor:</b>	<b>BB DIVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)</b>		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	<b>30.827.936/0001-69</b>		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	<b>25/10/2018</b>		
<b>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	<b>Sim</b>		
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	<b>R\$</b>	<b>55.064.059.988,11</b>	
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>		<b>5,69%</b>	
<b>Empresa de Rating</b>	<b>Fitch Ratings</b>		
<b>Conceito</b>	<b>Excelente</b>		
<b>Representação do conceito</b>	<b>Excelente</b>		
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN</b>	<b>Sim</b>		
<b>Distribuidor:</b>	<b>BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)</b>		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	<b>00.000.000/0001-91</b>		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	<b>30/10/2018</b>		

Data de Início FI:		28/04/2011
Taxa Administração do FI (%):		1,00
Índice de Referência do FI:		CFI
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 RFP/PRFV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos 23/04/2019
Outras Observações:	Tivemos, também, nesta data o recebimento de R\$ 187.363,37 de Compensação Previdenciária
<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?	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>	
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, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do 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?

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

Pergunta não se aplica ao fundo

Pergunta não se aplica ao fundo

Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO		
CNPJ do Fundo:	07.442.078/0001-09		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "I"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 2.900.000,00		
Quantidade de Cotas:	534.473,08768288		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 5,42590		
Data da Operação:	09/05/2019		
Data de Liquidação:	09/05/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	5.020.385.050,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,058%		
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\$ 56.775.931.000,00		
% 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\$	15.064.059.988,11	
% 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	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:	25/10/2018		
Data de início FI:	24/07/2009		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		
Índice de Referência do FI:	IMA B		
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):	
Cód. Negociação Bolsa:	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	Não listado INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não
CNPJ do Fundo:	
Segmento:	0,00
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:	R\$ 0,00 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)**

<b>Objetivos:</b>	O fundo busca retorno dos investimentos através do sub índice IMA-B. Para isso, aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais, registrados no SELIC e/ou em suas operações compromissadas. Deve, 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.
<b>Principais riscos do fundo:</b>	Risco de Taxa de Juros (Risco 5)
<b>Risco do Fundo atribuído pelo Administrador:</b>	Risco Muito Alto

**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 Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):** Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECI PREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações.

**Outras Observações:** Data da reunião do Comitê de Investimentos: 23/04/2019

**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?** 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: Lamina(s) do fundo(s) e ofício(s)	
<b>PROPONENTE</b> Andreson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Divisão de Investimentos CP: 052 430 264 25 Entidade Certificadora: ANRIMA CPA 20 e CFA Validade da Certificação: 05/12/2020	<b>GESTOR/AUTORIZADOR</b> José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CP: 334 326 354 00 Entidade Certificadora: ANRIMA CPA 20 e CFA Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE  
RECIFE**

Recife, 09 de maio de 2019

**RECI  
PREV**

**Ofício RECIPREV nº 121/2019 – GI**


Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 2.712.636,63 (Dois milhões, setecentos e doze mil, seiscentos e trinta e seis reais e sessenta e três centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05; e aplicar o valor de R\$ 2.900.000,00 (Dois milhões e novecentos mil reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.442.078/0001-05; vinculados à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 121/2019

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>

---

**Re: divisão comprev recifin e reciprev**

---

**JULIANA COTTARD GIESTOSA** <juliana.giestosa@recife.pe.gov.br>

9 de maio de 2019 08:05

Para: ANDRE LUIZ MARTINS CORREIA DA SILVA <andrecorreia@recife.pe.gov.br>, JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>, MESSIAS FRANCISCO PEREIRA FILHO <messiasfilho@recife.pe.gov.br>

Meninos,

Seguem valores da compensação de Abril:

RECIPREV	187.363,37
RECIFIN	321.061,15
VALOR DEPOSITADO	508.424,52

Em ter, 7 de mai de 2019 às 15:43, JULIANA COTTARD GIESTOSA <juliana.giestosa@recife.pe.gov.br> escreveu:

Joia!

Fico no aguardo do valor depositado.

Em qui, 2 de mai de 2019 às 09:54, ANDRE LUIZ MARTINS CORREIA DA SILVA <andrecorreia@recife.pe.gov.br> escreveu:

Juliana,

Segue planilha comprev para divisão por fundos.  
obg.

André Luiz M. C. Silva

**Chefe da Div. de Gestão Previdenciária**

◦ RECIPREV



**Características**

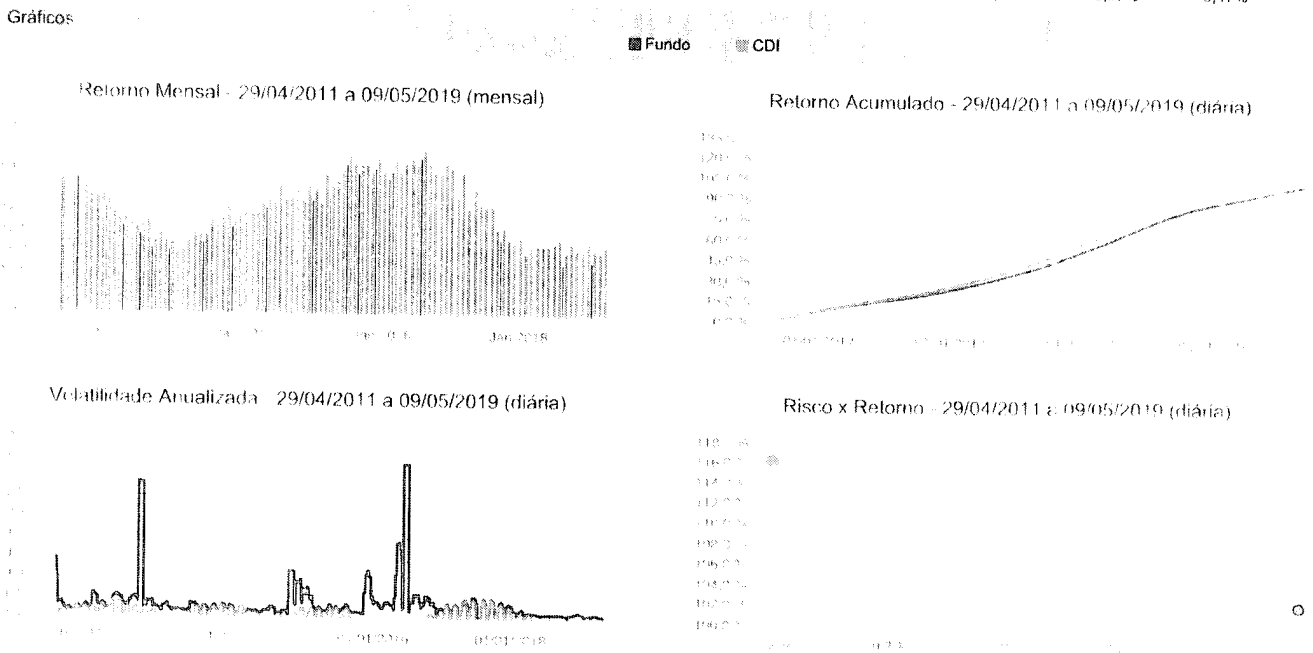
CNPJ: 13.077.415/0001-05  
 Gestor: BB Gestão de Recursos DTVM  
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM  
 Taxa de Administração: 1,00%  
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui  
 Classificação Antima: Renda Fixa Duração Baixa Soberano  
 Código de Referência: 272604  
 Início de Fundo: 28/04/2011

**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	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	102,03	1,81	5,25	12,59	26,94	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	87,90	82,52	82,13	83,74	88,21	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	116,08	2,19	6,40	15,03	30,54	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	44,36	7,87	14,62	43,45	77,01	0,98	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87
IRX	84,54	8,32	16,04	44,43	79,62	1,06	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91
IGP-M	57,66	3,21	8,48	10,92	14,51	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	2.020303864	1.284.043,32	1.283.595,09	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

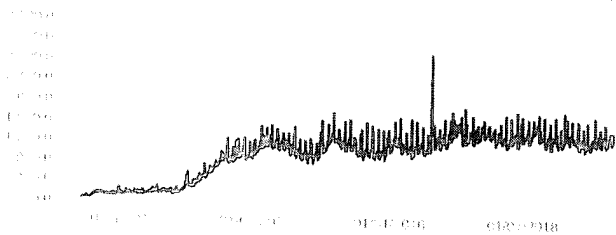


As informações aqui foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela veracidade e atualidade dos dados não é do BB FIC. O BB FIC não se responsabiliza por qualquer das consequências de seu uso empresarial. As informações, respectivamente, não devem ser tomadas por qualquer investidor, profissional ou pessoa física ou jurídica, para fins de investimento ou qualquer outra finalidade. O retorno obtido no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As informações aqui fornecidas não devem ser utilizadas para qualquer finalidade, exceto a de referência. A análise de risco recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento aplicável, e não a análise de risco feita aqui. Os valores exibidos são em Real (R\$). Para as informações e atualizações, consulte o site [www.bb.com.br](http://www.bb.com.br).

**:: BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

09/05/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 09/05/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 09/05/2019 (mensal)



**Composição da Carteira**

abr/2019

**Performance dos Fundos em Carteira**

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

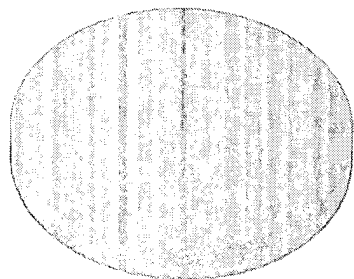
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses PL Médio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,15	99,30	14,88	98,35	14,88	98,35	14,88	98,35	-	R\$ 1.283.641.841,73

**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
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%
Valores a pagar	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.248.000,72	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
Data da Divulgação	06/05/2019	02/04/2019	06/03/2019	05/02/2019	04/01/2019	05/12/2018	06/11/2018	03/10/2018

**Composição da Carteira Individual - Ativos (%)**

abr/2019



■ Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Anbid	0,00 %

As informações foram extraídas a partir de fontes públicas ou privadas, consideradas confiáveis. Não se responsabiliza pela correção ou atualidade das informações aqui apresentadas, bem como por qualquer erro ou omissão de seu grupo empresarial. As informações, portanto, não devem ser utilizadas como base para qualquer decisão de investimento. Fundos de investimento não contam com a garantia da Administração de Fundos. Gestor do fundo de investimento não assume a responsabilidade por qualquer perda decorrente da aplicação em valores mobiliários e investimentos em títulos de renda fixa. Rendimentos obtidos no passado não representam garantia de rentabilidade futura. As estratégias adotadas pelo administrador do fundo de investimento não podem resultar em significativas perdas para seus cotistas, independentemente do capital aplicado e a consequente obrigação de indenização decorrente da aplicação em valores mobiliários e investimentos em títulos de renda fixa. A rentabilidade é estimada e letada exclusivamente do prospecto e regulamento do fundo de investimento no aplicador, disponíveis em [www.bb.com.br](http://www.bb.com.br). Informações referentes ao desempenho e rentabilidade são analisadas no período de 12 meses mensais. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Fundos e valores de patrimônio são em reais (R\$).

**:: BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

09/05/2019

**Características**

CNPJ: 07.442.978/0001-05  
 Gestã: BB Gestão de Recursos DTVM  
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM  
 Taxa de Administração: 0,20%  
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui  
 Classificação Antima: Renda Fixa Indexados  
 Código de Referência: 242901  
 Início do Fundo: 24/07/2005

**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	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	442,59	7,97	16,63	28,27	49,82	1,50	0,56	0,50	4,36	1,62	0,91	7,07	0,16	-0,46	2,29	-0,35	-3,17
% do CDI	135,39	364,08	259,96	188,08	163,10	288,62	119,13	100,58	802,15	327,30	184,04	1.301,92	-34,52	-81,50	422,99	-67,86	-611,77
CDI	326,90	2,19	6,40	15,03	30,54	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	280,51	7,87	14,62	43,45	77,01	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	415,40	8,32	16,04	44,43	79,62	1,06	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91
IGP-M	116,68	3,21	8,48	10,92	14,51	0,92	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38

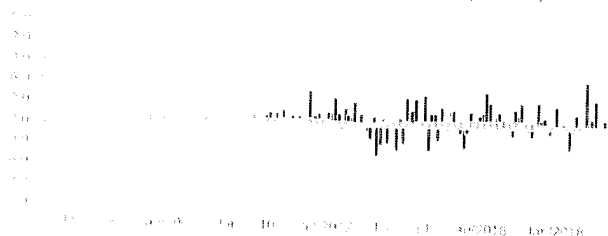
**Risco x Retorno (12 meses)**

	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	5.425904628	5.020.385,05	4.069.755,01	5,94%	-5,25%	2,82%	-9,53	5,94%	7,07%	-0,46%	8
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

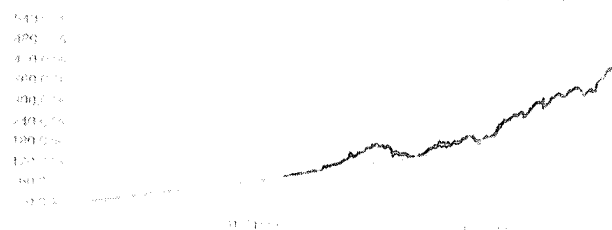
**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

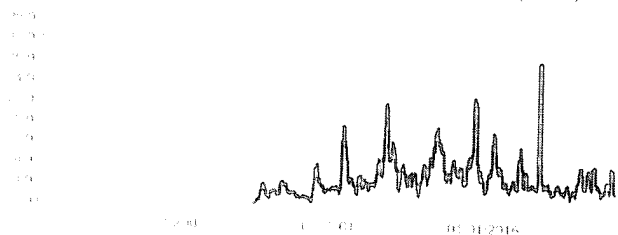
Retorno Mensal - 27/06/2005 a 09/05/2019 (mensal)



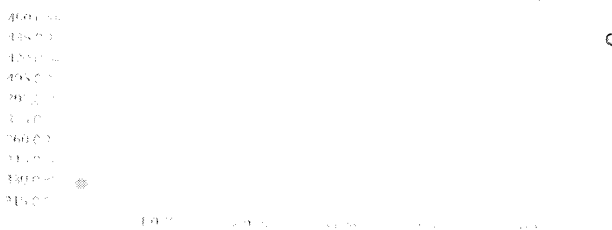
Retorno Acumulado - 27/06/2005 a 09/05/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 27/06/2005 a 09/05/2019 (diária)

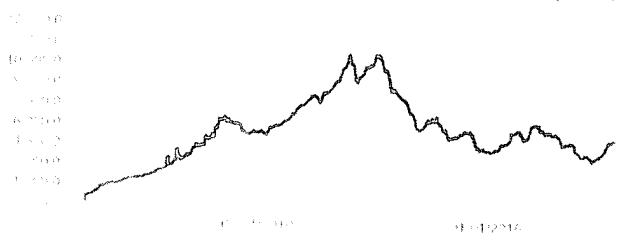


Risco x Retorno - 27/06/2005 a 09/05/2019 (diária)



As informações foram obtidas a partir de fontes públicas cujas precisas, completas e atualizações, cuja responsabilidade pela correção e atualização cabe ao usuário, não são garantidas. O administrador do fundo não se responsabiliza por quaisquer danos materiais ou morais decorrentes do uso das informações disponíveis. As informações disponíveis não devem ser usadas como base para a distribuição de renda ou para a formação de portfólios de investimento. O administrador do fundo não garante a rentabilidade futura. As estratégias de investimento utilizadas pelo administrador do fundo são baseadas em análises de mercado e podem sofrer alterações sem aviso prévio. Os valores exibidos estão em Real (R\$) e representam o valor líquido do fundo de investimento em aplicação em títulos públicos. Para mais informações, consulte o site do fundo em [www.bb.com.br](http://www.bb.com.br).

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 27/06/2005 a 09/05/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 27/06/2005 a 09/05/2019 (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											

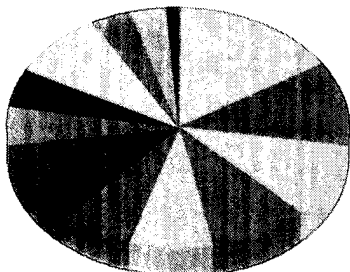
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18
Títulos Públicos	88,52%	87,90%	90,21%	97,55%	98,29%	96,97%	98,33%	99,59%
Operações Compromissadas	11,41%	12,03%	9,72%	2,36%	1,62%	2,94%	1,57%	0,32%
Outras aplicações	0,06%	0,07%	0,07%	0,08%	0,09%	0,10%	0,10%	0,09%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,01%	0,00%	-0,00%	0,01%	-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%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	5.058.651,55	4.887.849,43	4.614.280,76	4.159.431,81	3.870.963,79	3.733.451,66	3.596.631,65	3.646.686,50
Data da Desapuração	07/05/2019	02/04/2019	08/03/2019	05/02/2019	07/01/2019	04/12/2018	05/11/2018	05/10/2018

As informações aqui apresentadas são de fontes públicas ou privadas consideradas não óbvias, cuja responsabilidade pela veracidade dos dados é atribuída ao emissor. Não há garantia de que qualquer informação aqui apresentada seja precisa, completa ou atualizada. As informações aqui apresentadas não devem ser consideradas como recomendação de investimento ou qualquer outra recomendação financeira. A volatilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias aqui descritas são indicativas e não devem ser utilizadas como base para a tomada de decisões de investimento. As informações aqui apresentadas são de caráter informativo e não devem ser utilizadas como base para a tomada de decisões de investimento. As informações aqui apresentadas são de caráter informativo e não devem ser utilizadas como base para a tomada de decisões de investimento. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para mais detalhes, consulte o Regulamento do Fundo e o Relatório de Investimento.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

abr/2019



NTN-B - Venc.: 15/08/2050	15.70 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	11.41 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	10.14 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	9.48 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	7.80 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	6.75 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	5.63 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2020	5.33 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	5.17 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2019	5.17 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	4.80 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	4.18 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	4.18 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	3.77 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	3.41 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	1.26 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0.00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	0.00 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	0.00 %
Lançamentos positivos menores que 0,00%	0.01 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela consistência e atualidade é de responsabilidade do IMA-B. Não há garantia de que as informações aqui apresentadas sejam corretas, precisas, completas ou atualizadas em qualquer momento. Os dados apresentados não contam com a garantia de Acreditado de Fato. Gestor da carteira de qualquer instrumento financeiro, incluindo o presente, não garante a exatidão, a integridade ou a atualidade das informações aqui apresentadas. O desempenho passado não representa a garantia de rentabilidade futura. As estratégias de investimento em títulos públicos são de alto risco e podem sofrer perdas. A gestão do fundo pode sofrer perdas para seus cotistas, superiores ao capital aplicado e a consequente redução do valor patrimonial por parte dos cotistas. A gestão do fundo não recomenda a compra ou venda do presente fundo de investimento em qualquer circunstância. Para mais informações, consulte o regulamento do fundo de investimento em aplicações de renda fixa em títulos públicos do IMA-B. O fundo é registrado em CNPJ nº 12.456.789/0001-00. Os valores de referência são em Real (R\$). Para mais informações, consulte o regulamento do fundo de investimento em títulos públicos do IMA-B.