



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

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	130 /2019 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	130 /2019 GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	16/05/19
CNPJ: 05.244.336/0001-13		
Valor:		
R\$ 35.000.000,00	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Trinta e cinco milhões de reais		

Sim para todos os fundos desta APR

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA? TÍTULOS PUBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO		
CNPJ do Fundo:	13 322 205/0001-35		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 35.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	13 988 729 47091200		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,50201		
Data da Operação:	16/05/2019		
Data de Liquidação:	17/05/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	7 427 270 600,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,471%		
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:	27/10/2018		
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:	27/10/2018		
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 (%):		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:		Suspensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		Suspensado
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		12,10%
Retorno Total		149,45%

Maior Retorno		3,50%
Menor Retorno		-0,91%
Qtde. mês Positivo		86
Qtde. mês Negativo		10
Qtde. mês acima do Benchmark		36
Qtde. mês abaixo do Benchmark		60
Risco Mensal Período		0,78%
Risco Mensal 12 MESES		0,78%
Risco Anual do Período		2,69%
Retorno Relativo ao Benchmark		-4,64%
Sharpe		0,75
Information Ratio		1,20
Tracking Error		0,56%
VAR HISTÓRICO (95%)		2,24%
VAR 12 MESES (95%)		2,01%
Sharpe Modificado		1,04
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	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/05/2019
Outras Observações:		
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	
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, 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

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Departamento de Investimentos

CPF: 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

CPF: 324.826.350-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

SAÚDE
RECIFE

Recife, 16 de maio de 2019

RECI
PREV

Ofício RECIPREV nº 130/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 35.000.000,00 (Trinta e cinco 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, e fazer as seguintes operações:

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 130/2019

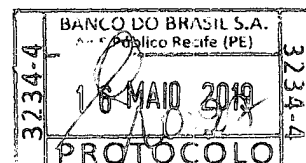
Atenciosamente,


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



Ilmo Sr. Gerente de Relacionamento do Banco do Brasil S.A. Agência Setor Público - Recife - PE
CNPJ: 00.339.888/0001-01
Rua do Comércio, 100 - Centro - Recife - PE
CEP: 50.000-000

Características

CNPJ: 11.322.205/0001-35
 Gestor: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 272612
 Início do Fundo: 28/04/2011

Informações Operacionais

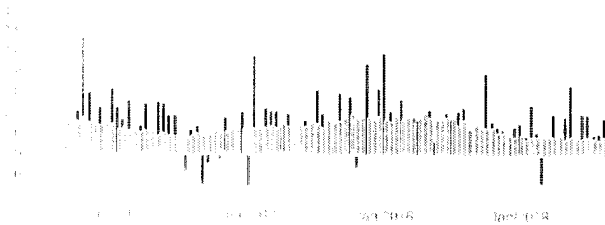
Aplicação Mínima: R\$ 10.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+1 do
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 do

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	150,20	3,85	9,78	21,23	36,51	1,10	0,65	0,61	1,22	1,22	0,11	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,84
% do CDI	129,04	164,39	152,96	142,35	120,38	213,15	138,77	122,93	223,80	247,72	22,00	384,81	250,21	-13,55	227,52	55,59	-163,16
CDI	116,40	2,34	6,40	14,91	30,33	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	37,03	2,40	5,71	33,25	69,57	0,98	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87
IBRX	75,26	2,86	7,41	34,01	72,11	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	57,86	3,34	8,20	11,35	14,39	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	2.502014216	7.427.270,60	6.699.723,84	2,35%	-1,91%	1,11%	4,01	2,35%	2,09%	-0,08%	8
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

Gráficos

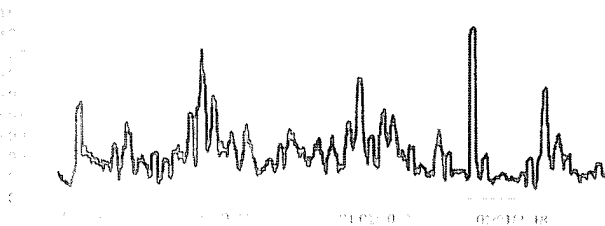
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 17/05/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 17/05/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 17/05/2019 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 17/05/2019 (diária)

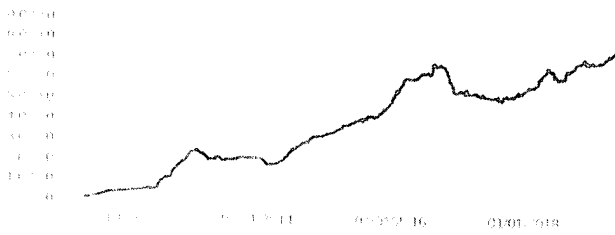


A informação aqui fornecida é obtida a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo OGCPI (BB) e pelos beneficiários, ou seja, qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de compra ou venda de qualquer título ou instrumento financeiro, mobiliário ou não, emitido pelo emissor, ou seja, com a garantia de Administração do fundo, Gestor, da carteira de equities ou mensalmente, sob pena de violação das Cartas de Investimentos (CIs). Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos podem gerar perdas significativas para os investidores do fundo. A avaliação e recomendação a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo do investimento são obrigatórias para o investidor. Para maiores informações sobre o fundo de investimento, consulte o site da análise de rentabilidade (12 (doze) meses). Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas bases de dados de 17/05/2019. Este documento não constitui oferta de investimento e não é uma recomendação de compra ou venda de qualquer título ou instrumento financeiro. Este documento não constitui oferta de investimento e não é uma recomendação de compra ou venda de qualquer título ou instrumento financeiro.

:: BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

17/05/2019

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 17/05/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 17/05/2019 (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 exequibiliares	-	-	0,16%	-	-	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	7.220.070,50	7.065.416,53	6.882.421,50	6.832.498,25	6.854.500,35	6.923.282,00	6.844.791,56	6.551.962,37
Data da Encolgação	06/05/2019	02/04/2019	12/03/2019	05/02/2019	09/01/2019	04/12/2018	06/11/2018	03/10/2018

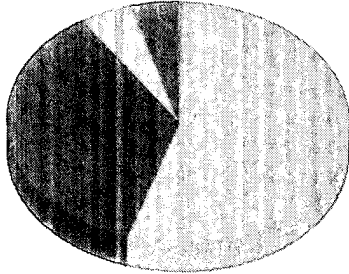
As informações aqui fornecidas são parciais e não representam uma recomendação de investimento. A administração do fundo não garante a liquidez dos ativos e não se responsabiliza por perdas decorrentes de operações de investimento realizadas pelo investidor. As informações aqui fornecidas são parciais e não representam uma recomendação de investimento. A administração do fundo não garante a liquidez dos ativos e não se responsabiliza por perdas decorrentes de operações de investimento realizadas pelo investidor. As informações aqui fornecidas são parciais e não representam uma recomendação de investimento. A administração do fundo não garante a liquidez dos ativos e não se responsabiliza por perdas decorrentes de operações de investimento realizadas pelo investidor.

:: BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

17/05/2019

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	4.98 %
■ 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 IFCA 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 Celip	0.00 %
■ Valores a pagar / Auditoria	0.00 %
■ Outras Disponibilidades	0.00 %
■ Outros Valores a pagar	0.00 %

As informações aqui exibidas são oriundas de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualizações cabe exclusivamente aos órgãos e instituições que as forneceram. A BB Investimentos não se responsabiliza por qualquer erro ou omissão das informações aqui apresentadas, bem como por qualquer prejuízo decorrente de sua utilização. A BB Investimentos não garante a exatidão das informações aqui apresentadas e não se responsabiliza por qualquer prejuízo decorrente de sua utilização. A BB Investimentos não garante a exatidão das informações aqui apresentadas e não se responsabiliza por qualquer prejuízo decorrente de sua utilização. A BB Investimentos não garante a exatidão das informações aqui apresentadas e não se responsabiliza por qualquer prejuízo decorrente de sua utilização.