



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE

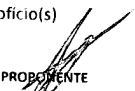



PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

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

| | | | |
|---|---|------------------|-----------------------|
| AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR | | Nº / ANO: | 210 /2018 - GI |
| Unidade Gestora do RPPS | | OF. Nº: | 210 /2018 - GI |
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 | | Data: | 14/09/18 |
| Valor: | | | |
| R\$ 14.774.471,37 | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a" | | |
| Quatorze milhões, setecentos e setenta e quatro mil, quatrocentos e setenta e um reais e trinta e sete centavos | | | |
| Sim para todos os fundos desta APR | | | |
| HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS: | | | |
| Fundo: | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | | |
| CNPJ do Fundo: | 13.077.415/0001-05 | | |
| Segmento: | Renda Fixa | | |
| Tipo de Ativo: | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a" | | |
| Tipo de operação realizada: | Aplicação | | |
| Valor da operação: | R\$ 14.774.471,37 | | |
| Quantidade de Cotas: | 7.554.877,27085378 | | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 1,95562030 | | |
| Data da Operação: | 14/09/2018 | | |
| Data de Liquidação: | 14/09/2018 | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 1.202.377.400,00 | | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 1,228772% | | |
| 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: | 27/10/2017 | | |
| Gestor: | BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | | |
| CNPJ do Gestor: | 30.822.936/0001-69 | | |
| Data do Termo de Credenciamento do Gestor: | 27/10/2017 | | |
| 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: | 24/10/2017 | | |
| Data de Início FI: | 28/04/2011 | | |
| Taxa Administração do FI (%): | 1,00 | | |
| Agência de Classificação de Risco que classificou o FI: | Dispensado | | |
| Índice de Referência do FI : | CDI | | |
| 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 | | |
| Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco: | Dispensado | | |
| Carência (dias): | 0 | | |
| Data Listagem Bolsa: | Não listado | | |
| Resgate (dias): | 0 | | |

| | | |
|--|--|---|
| Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve realizar para haver a cobrança de tx performance): | Não possui | |
| Cód. Negociação Bolsa: | Sem código | |
| Fundo Destinado à Categoria de Investidor: | INVESTIDOR GERAL | |
| Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos: | Sim | |
| CNPJ do Fundo: | 06.006.071/0001-88 | |
| Segmento: | Renda Fixa | |
| Tipo de Ativo: | FI Renda Fixa - 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 comprometidas, 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 |
| 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 Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS: | Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações | |
| | Data da reunião do Comitê de Investimentos | 11/09/2018 |
| Outras Observações: | Recebimento de Contribuições Previdenciárias Patronal e Servidor da Prefeitura do Recife e da Câmara Municipal do Recife | |
| 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? | 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 | |
| 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 laude 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) <div style="display: flex; justify-content: space-between; align-items: flex-start; margin-top: 20px;"> <div style="text-align: center;">  <p>PROPOSTANTE Anderson Carlos Gomes de Oliveira Gerente de Investimentos em Exercício CPF: 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </div> <div style="text-align: center;">  <p>GESTOR AUTORIZADOR José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 34.336.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div> | |

Recife, 14 de setembro de 2018

Ofício RECIPREV nº 210/2018 – GI

Senhor Gerente,

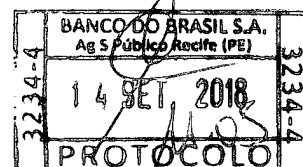
Solicitamos aplicar o valor de R\$ 14.774.471,37 (Quatorze milhões, setecentos e setenta e quatro mil, quatrocentos e setenta e um reais e trinta e sete centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO: 13.077.415/0001-05, vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 210/2018

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

Autoria Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife
Av. Manoel Borba 488, Cep 50070-000, Boa Vista, Recife - PE
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647

Características

CNPJ 13.077.415/0001-05
 Gestão 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

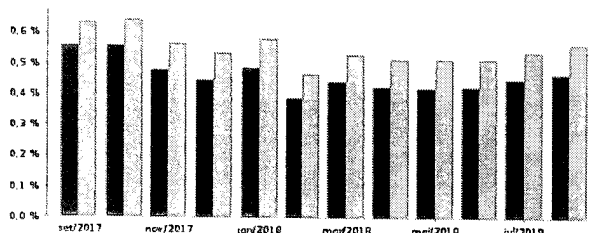
| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | ago/18 | jul/18 | jun/18 | mai/18 | abr/18 | mar/18 | fev/18 | jan/18 | dez/17 | nov/17 | out/17 | set/17 |
|-------------|--------|-------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo | 95,56 | 3,76 | 5,67 | 17,27 | 32,77 | 0,47 | 0,45 | 0,43 | 0,42 | 0,43 | 0,44 | 0,39 | 0,49 | 0,45 | 0,48 | 0,56 | 0,56 |
| % do CDI | 88,70 | 82,53 | 83,20 | 88,13 | 89,80 | 82,54 | 82,84 | 82,57 | 81,66 | 82,43 | 83,41 | 83,21 | 83,54 | 83,22 | 84,64 | 86,94 | 87,14 |
| CDI | 107,73 | 4,55 | 6,82 | 19,59 | 36,49 | 0,57 | 0,54 | 0,52 | 0,52 | 0,52 | 0,53 | 0,46 | 0,58 | 0,54 | 0,57 | 0,64 | 0,64 |
| Ibovespa | 14,86 | -1,27 | 1,19 | 30,05 | 61,67 | -3,21 | 8,88 | -5,20 | -10,87 | 0,88 | 0,01 | 0,52 | 11,14 | 6,16 | -3,15 | 0,02 | 4,88 |
| IBX | 45,01 | -1,76 | 0,46 | 28,84 | 59,55 | -3,13 | 8,84 | -5,19 | -10,91 | 0,82 | 0,08 | 0,42 | 10,74 | 6,35 | -3,38 | -0,13 | 4,69 |
| IGP-M | 51,79 | 6,87 | 8,93 | 7,16 | 19,24 | 0,70 | 0,51 | 1,87 | 1,38 | 0,57 | 0,64 | 0,07 | 0,76 | 0,89 | 0,52 | 0,20 | 0,47 |

| 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 | 1.955620302 | 1.202.377,40 | 1.326.477,41 | 0,04% | - | 0,02% | 0,93 | 0,01% | 0,56% | 0,39% | 0 |
| CDI | - | - | - | 0,03% | - | 0,02% | 1,00 | 0,00% | 0,64% | 0,46% | 0 |

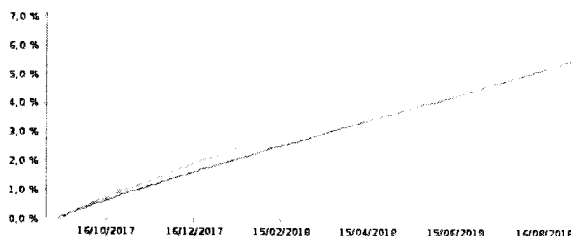
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

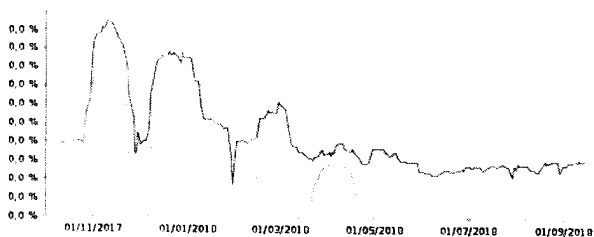
Retorno Mensal - 01/09/2017 a 14/09/2018 (mensal)



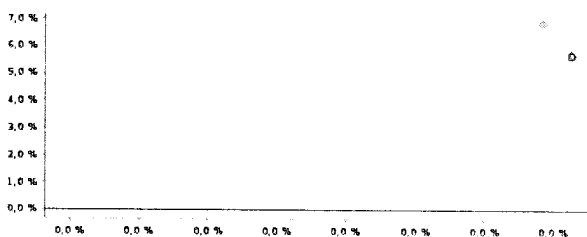
Retorno Acumulado - 13/09/2017 a 14/09/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 13/09/2017 a 14/09/2018 (diária)



Risco x Retorno - 13/09/2017 a 14/09/2018 (diária)

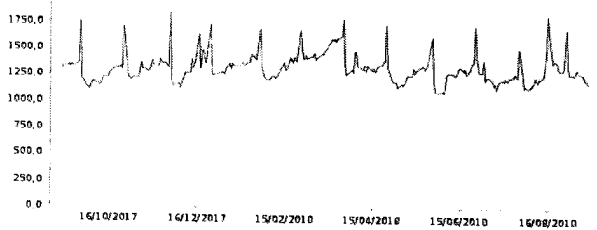


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM AXIS, pelo título desta inserção ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

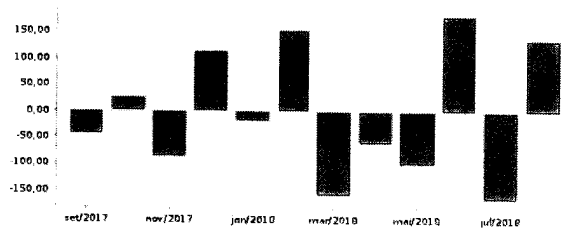
:: BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

14/09/2018

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 13/09/2017 a 14/09/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/09/2017 a 14/09/2018 (mensal)



Composição da Carteira

ago/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

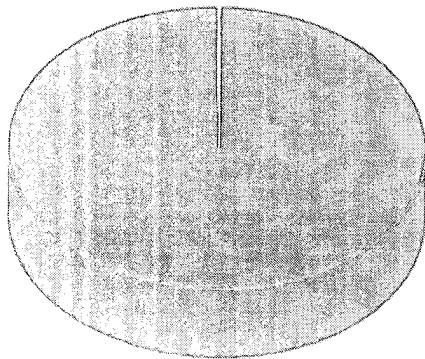
| FUNDO | % do PL | Mês | Ano | 12 meses | 24 meses | 06 meses | 12 meses | | | | | | |
|--|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|---|---|------|--------------|----------|----------------------|
| | | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | | | | | | |
| BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA | 100,01 | 0,22 | 99,25 | 4,50 | 98,78 | 6,75 | 98,91 | - | - | 0,01 | Volatilidade | PL Médio | R\$ 1 326 589 347,31 |

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

| Tipo de Aplicação | ago/18 | jul/18 | jun/18 | mai/18 | abr/18 | mar/18 | fev/18 | jan/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% | -0,00% | -0,01% | -0,00% | -0,00% | -0,01% | -0,00% | -0,00% |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 1.278.234,77 | 1.135.822,82 | 1.295.491,67 | 1.108.257,44 | 1.204.289,25 | 1.259.101,80 | 1.410.861,47 | 1.250.937,27 |
| Data da Divulgação | 04/09/2018 | 03/08/2018 | 09/07/2018 | 07/06/2018 | 04/05/2018 | 04/04/2018 | 05/03/2018 | 05/02/2018 |

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

ago/2018



| | |
|---|----------|
| 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 foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela DBANFIM, nem pela desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou oferta do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Avis.