



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° 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:	262 /2018 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	262 /2018 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	21/11/18
CNPJ: 05.244.336/0001-13		
Valor:		
R\$ 10.000.000,00		FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"
Dez milhões de reais		
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:	Resgate	
Valor da operação:	R\$ 10 000 000,00	
Quantidade de Cotas:	5.066.842,32611828	
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,97361579	
Data da Operação:	21/11/2018	
Data de Liquidação:	21/11/2018	
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.317.746.080,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,758872%	
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	
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	
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 (%):	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 RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/11/2018
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?	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, 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
<p>Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</p> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">PROponente</p> <p style="text-align: center;">Andreson Barros 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</p> </div> <div style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">Gestor/Autorizador</p> <p style="text-align: center;">José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334.526.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 10 e CEA Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div>	

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 21 de novembro de 2018

21/11/2018
M: 33

Ofício RECIPREV nº 262/2018 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 10.000.000,00 (Dez milhões de reais), do 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, e efetuar a TED conforme a seguir:

Banco: Itaú Unibanco (341)
Agência: 0522
Conta Corrente: 77.026-2
Favorecido: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - RECIPREV
CNPJ: 07.749.668/0001-85
Valor: R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 262/2018

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 Prefeitura 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


PREFEITURA DO
RECIFE

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

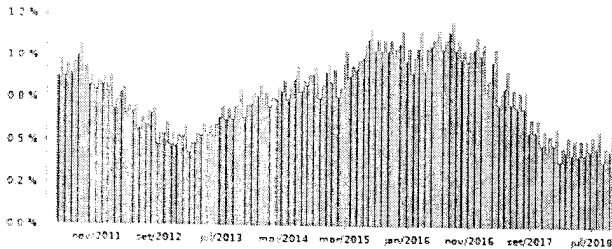
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17
Fundo	97,36	4,71	5,41	15,76	31,06	0,45	0,39	0,47	0,45	0,43	0,42	0,43	0,44	0,39	0,49	0,45	0,48
% do CDI	88,47	82,42	82,46	86,95	89,27	82,79	82,81	82,54	82,84	82,57	81,66	82,43	83,41	83,21	83,54	83,22	84,64
CDI	110,04	5,72	6,56	18,12	34,79	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57
Ibovespa	32,88	14,22	18,83	43,63	87,61	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16	-3,15
IBX	68,28	14,00	18,67	44,22	85,74	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35	-3,38
IGP-M	55,04	9,16	10,38	9,14	17,93	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89	0,52

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	1,973615786	1.317.746,08	1.327.751,51	0,02%	-	0,01%	0,86	0,01%	0,49%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,02%	-	0,01%	1,00	0,00%	0,58%	0,46%	0

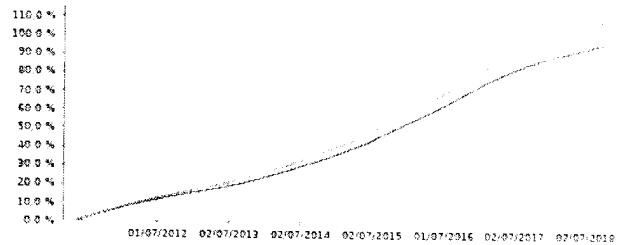
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

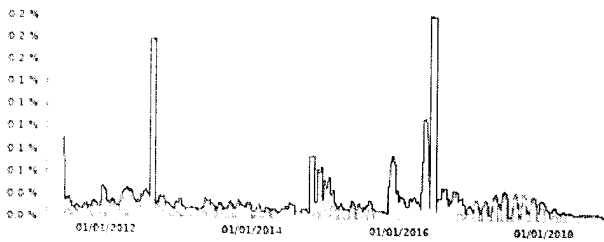
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 21/11/2018 (mensal)



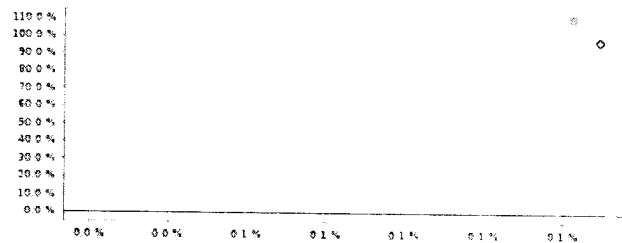
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 21/11/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 21/11/2018 (diária)

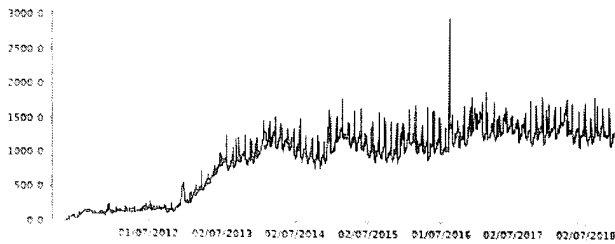


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 21/11/2018 (diária)

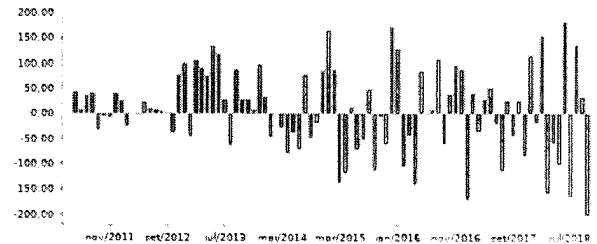


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos 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 modo de FIC ou Garantidor de créditos - FIC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento, dos fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus colistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do colista 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 Aes.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 21/11/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 21/11/2018 (mensal)



Composição da Carteira

out/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

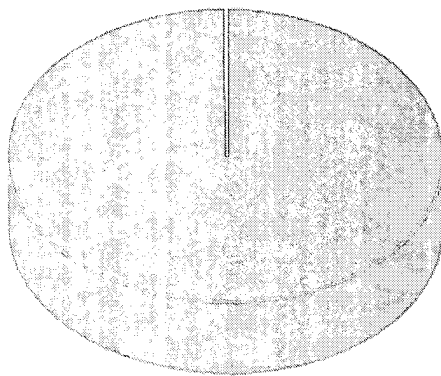
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início		12 meses PL Médio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FIC RENDA FIXA	100,01	0,32	98,62	11,71	98,29	11,71	98,29	11,71	98,29	-		R\$ 1.327.541.321,62

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

Tipo de Aplicação	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/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%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.120.973,03	1.316.299,88	1.278.234,77	1.135.822,82	1.295.491,67	1.108.257,44	1.204.289,25	1.259.101,80
Data da Divulgação	06/11/2018	03/10/2018	04/09/2018	03/08/2018	09/07/2018	07/06/2018	04/05/2018	04/04/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2018



■ Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FIC 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 QUANTILIA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos 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 resgate de fundos Garantidos de Crédito - 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 de cobrir as perdas com recursos próprios 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 (BR\$). Para os cálculos foram utilizadas observações diárias.
Fonte: Quantum Axis.