



**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 Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>		<b>Nº / ANO:</b>	272 /2018 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		<b>OF. Nº:</b>	272 /2018 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	28/11/18	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
<b>Valor:</b>				
R\$ 3.000.000,00		FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Três milhões de reais				
Sim para todos os fundos desta APR				
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>				
<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>	Renda Fixa			
<b>Tipo de Ativo:</b>	FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"			
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Resgate			
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 3.000.000,00			
<b>Quantidade de Cotas:</b>	1.260.525,62373105			
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,37995955			
<b>Data da Operação:</b>	28/11/2018			
<b>Data de Liquidação:</b>	29/11/2018			
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 7.001.496.120,00			
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	0,042848%			
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X	
<b>Administrador:</b>	BB DTVM (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>Gestor:</b>	BB DTVM (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>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>	30/10/2018			
<b>Data de Início FI:</b>	28/04/2011			
<b>Taxa Administração do FI (%):</b>	0,20			
<b>Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:</b>	Dispensado			
<b>Índice de Referência do FI :</b>	IDKA IPCA 2A			
<b>Tx Performance do FI (%):</b>	Não possui			
<b>Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):</b>	Não possui			
<b>Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:</b>	Dispensado			
<b>Carência (dias):</b>	0			
<b>Data Listagem Bolsa:</b>	Não listado			
<b>Resgate (dias):</b>	1			

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:	Não	
CNPJ do Fundo:	R\$ 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 do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco de Taxa de Juros (Risco 1)  Risco Muito 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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/11/2018
Outras Observações:	Destinado ao pagamento de folha e consignações	
<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?	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>		
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> <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 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
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)	
<b>PROPONENTE</b> Andreson Carlos 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	<b>GESTOR/AUTORIZADOR</b> José Marcos Alves de Barros Gênero de Investimentos CPF: 326.354.00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021

**SAÚDE  
RECIFE**

Recife, 28 de novembro de 2018

**RECI  
PREV**

**Ofício RECIPREV nº 272/2018 – GI**

Senhor Gerente,

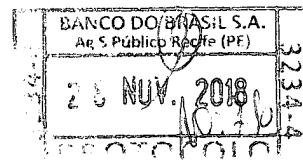
Solicitamos resgatar o valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35, vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 272/2018

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 DO  
**RECIFE**

Autarquia 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

**:: BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

29/11/2018

**Características**

CNPJ: 13.322.205/0001-35  
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM  
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM  
 Taxa de Administração: 0,20%  
 Taxa de Administração (Maxima): 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 du  
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du

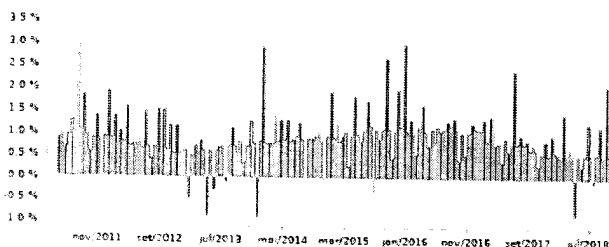
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17
Fundo	138,00	7,89	8,66	23,21	40,47	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,84	0,69	1,48	0,56	0,96	0,86	0,28
% do CDI	125,05	134,40	132,62	129,45	117,09	384,81	250,21	-13,55	227,52	55,59	-163,16	133,48	278,85	120,55	165,00	160,53	50,18
CDI	110,36	5,87	6,53	17,93	34,57	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	36,60	17,42	21,13	46,12	86,31	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	73,05	17,23	21,10	46,86	84,99	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	54,47	8,75	9,81	8,75	16,96	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	2,379959553	7.001.496,12	6.157.393,17	2,35%	-2,36%	1,11%	-5,18	2,35%	2,09%	-0,84%	8
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,01%	1,00	0,00%	0,58%	0,46%	0

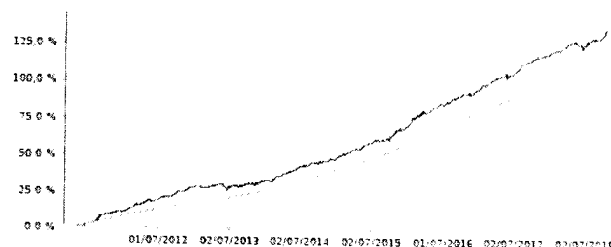
**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

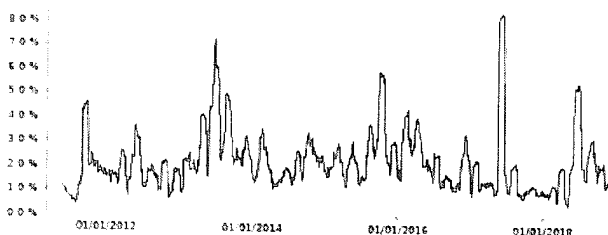
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 29/11/2018 (mensal)



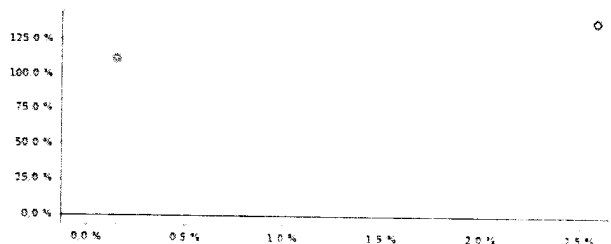
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 29/11/2018 (diária)



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



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

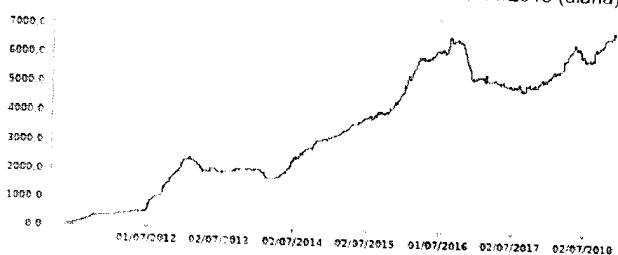


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, nem titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de 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 fundo de garantia. 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 (dados).  
 Fonte: Quantum Axi

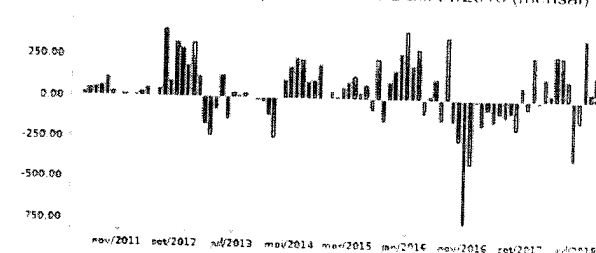
**BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

29/11/2018

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



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



Composição da Carteira

out/2018

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Medio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

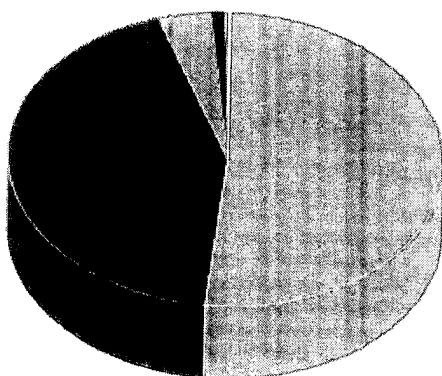
Não há fundos(FI) na carteira

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
Títulos Públicos	98.87%	99.23%	99.56%	99.53%	99.46%	99.52%	98.81%	99.26%
Operações Compromissadas	1.13%	0.77%	0.44%	0.48%	0.54%	0.48%	1.19%	0.74%
Mercado Futuro - Posições compradas	0.00%	-	-	-	-	-	-	-
Valores a receber	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)	6.844.791,59	6.551.962,37	6.422.224,91	6.047.649,86	6.108.970,61	6.458.766,21	6.381.522,31	6.069.165,85
Data da Divulgação	06/11/2018	03/10/2018	05/09/2018	03/08/2018	04/07/2018	06/06/2018	04/05/2018	04/04/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2018



NTN-B - Venc. 15/05/2021	51.43 %
NTN-B - Venc. 15/08/2020	43.29 %
NTN-B - Venc. 15/05/2019	3.83 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	1.13 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	0.29 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	0.02 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2024	0.00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0.00 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0.00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0.00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0.00 %
Valores a receber / Taxa CVM	0.00 %
Outras Disponibilidades	0.00 %
Valores a pagar / Prov. Audit 28/12/2018	0.00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0.00 %
Outros Valores a pagar	0.00 %
Valores a receber / 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 QUANTUM, podendo desta maneira ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de títulos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia de 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 colistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do colista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investir é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para maiores informações consulte 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 finais. Fonte: Quantum Axi.