



**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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>		<b>Nº / ANO:</b>	<b>295 /2018 - GI</b>	
Unidade Gestora do RPPS		<b>OF. Nº:</b>	<b>295 /2018 - GI</b>	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	<b>26/12/18</b>	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
<b>Valor:</b>				
R\$ 4.300.000,00		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Quatro milhões e trezentos mil 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>	FI 100% Títulos Públicos			
<b>Tipo de Ativo:</b>	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"			
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Resgate			
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 4.300.000,00			
<b>Quantidade de Cotas:</b>	1.786.958,91818475			
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,40632281			
<b>Data da Operação:</b>	26/12/2018			
<b>Data de Liquidação:</b>	27/12/2018			
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	6.806.406.650,00		
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	0,063%			
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>	15,00%			
<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>Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim			
<b>Volume de Recursos do Administrador com RPPS</b>	R\$ 55.097.162.000,00			
<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>	5,81%			
<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>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim			
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	R\$	53.111.188.016,71		
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>	5,69%			
<b>Empresa de Rating</b>	Fitch Ratings			
<b>Conceito</b>	Excelente			
<b>Representação do conceito</b>	Excelente			
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN</b>	Sim			
<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			

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:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
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	
<b>Dados com base desde 2011 ou início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal	0,97%	
Retorno Médio Anual	12,23%	
Retorno Total	137,56%	

Maior Retorno	3,50%
Menor Retorno	-0,91%
Qtde. mês Positivo	80
Qtde. mês Negativo	10
Qtde. mês acima do Benchmark	34
Qtde. mês abaixo do Benchmark	56
Risco Mensal Período	0,80%
Risco Anual do Período	2,75%
Retorno Relativo ao Benchmark	-4,63%
Sharpe	0,68
Information Ratio	-1,25
Tracking Error	0,57%
VAR (95%)	2,28%
Sharpe Modificado	0,93
Beta (12 meses)	0,83
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 Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos 19/12/2018
Outras Observações:	Valor destinado ao pagamento de folha e consignados
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
<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"</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

<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>		
<p>Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</p> <table border="0" style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 50%; text-align: center;"> <p><b>PROPONENTE</b>  <b>Anderson Carlos Gomes de Oliveira</b>  Chefe de Divisão de Investimentos  CPF 052 430 264-25  Entidade Certificadora: ANBIMA  CPA 20 e CEA  Validade da Certificação: 05/12/2020</p> </td> <td style="width: 50%; text-align: center;"> <p><b>GESTOR AUTORIZADOR</b>  <b>José Marcos Alves de Barros</b>  Gerente de Investimentos  CPF 334 825 354 00  Entidade Certificadora: ANBIMA  CPA 20 e CEA  Validade da Certificação: 21/11/2021</p> </td> </tr> </table>		<p><b>PROPONENTE</b>  <b>Anderson Carlos Gomes de Oliveira</b>  Chefe de Divisão de Investimentos  CPF 052 430 264-25  Entidade Certificadora: ANBIMA  CPA 20 e CEA  Validade da Certificação: 05/12/2020</p>	<p><b>GESTOR AUTORIZADOR</b>  <b>José Marcos Alves de Barros</b>  Gerente de Investimentos  CPF 334 825 354 00  Entidade Certificadora: ANBIMA  CPA 20 e CEA  Validade da Certificação: 21/11/2021</p>
<p><b>PROPONENTE</b>  <b>Anderson Carlos Gomes de Oliveira</b>  Chefe de Divisão de Investimentos  CPF 052 430 264-25  Entidade Certificadora: ANBIMA  CPA 20 e CEA  Validade da Certificação: 05/12/2020</p>	<p><b>GESTOR AUTORIZADOR</b>  <b>José Marcos Alves de Barros</b>  Gerente de Investimentos  CPF 334 825 354 00  Entidade Certificadora: ANBIMA  CPA 20 e CEA  Validade da Certificação: 21/11/2021</p>		

**SAÚDE  
RECIFE**

Recife, 26 de dezembro de 2018

**RECI  
PREV**

**Ofício RECI-REV nº 295/2018 – GI**

*[Handwritten signature]*  
26 DEZ. 2018  
10:30  
RECIFE

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 4.300.000,00 (Quatro milhões e trezentos mil 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 295/2018

Atenciosamente,

*[Handwritten signature]*  
**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

*[Handwritten signature]*  
**ELCIO 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

**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 (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 du  
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du

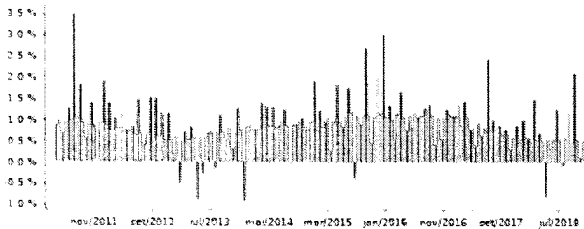
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17
Fundo	140,63	9,09	9,48	23,09	42,00	0,11	2,09	1,17	-0,08	1,23	0,29	-0,84	0,69	1,48	0,56	0,96	0,86
% do CDI	126,31	142,69	146,30	133,15	124,06	22,00	384,81	250,21	-13,55	227,52	55,59	-163,16	133,48	278,85	120,55	165,00	160,53
CDI	111,34	6,37	6,48	17,34	33,86	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54
Ibovespa	30,13	11,86	13,66	48,25	94,63	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16
IBX	65,77	12,30	14,28	49,55	93,59	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35
IGP-M	52,93	7,67	7,86	7,28	15,00	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89

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	2.406322807	6.806.406,65	6.270.729,17	2,34%	-2,36%	1,11%	-5,30	2,34%	2,09%	-0,84%	7
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,58%	0,46%	0

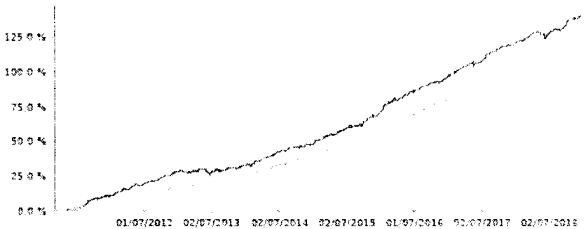
**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

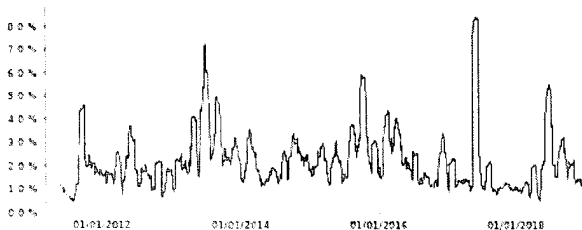
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 27/12/2018 (mensal)



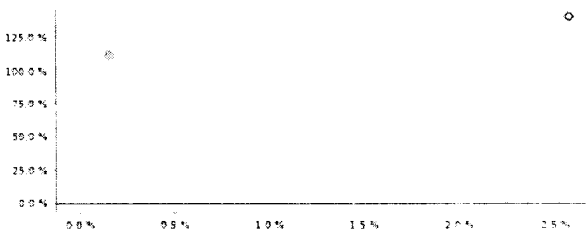
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 27/12/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 27/12/2018 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 27/12/2018 (diária)

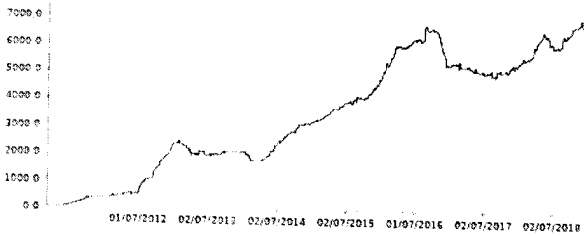


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM. Nenhuma destas marcas ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas 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 do Fundo. Garantia 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 de 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 as taxas de câmbio da fonte: Quantum Axis.

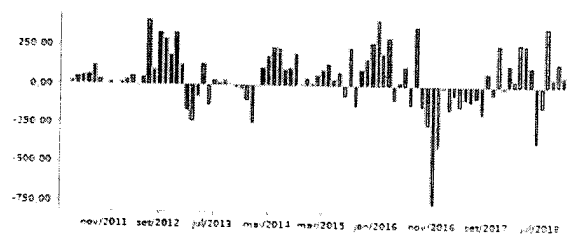
**BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**

27/12/2018

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 27/12/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 27/12/2018 (mensal)



Composição da Carteira

nov/2018

Performance dos Fundos em Carteira

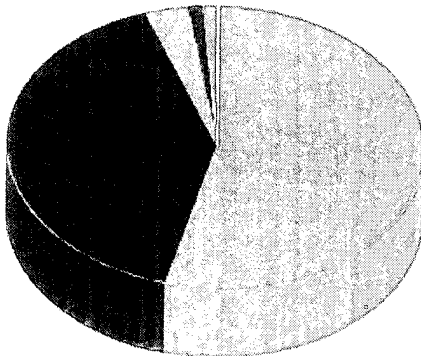
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(FI) na carteira											

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

Tipo de Aplicação	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18
Títulos Públicos	98,75%	98,87%	99,23%	99,56%	99,53%	99,46%	99,52%	98,81%
Operações Compromissadas	1,25%	1,13%	0,77%	0,44%	0,48%	0,54%	0,48%	1,19%
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%
Mercado Futuro - Posições compradas	-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)	6.923.282,00	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
Data da Divulgação	04/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	05/09/2018	03/08/2018	04/07/2018	06/06/2018	04/05/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

nov/2018



NTN-B - Venc. 15/05/2021	53,74 %
NTN-B - Venc. 15/08/2020	40,64 %
NTN-B - Venc. 15/05/2019	3,21 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc. 01/09/2022	1,25 %
NTN-B - Venc. 15/08/2022	1,17 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	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 %
Valores a pagar / Prov. Audit 28/12/2018	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Outros Valores a pagar	0,00 %
NTN-B - Venc. 15/05/2023	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, 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 do fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qual quer mecanismo de seguro ou Fundo de Garantia 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 Axis