



**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>	<b>296 /2018 - GI</b>	
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>		<b>OF. Nº:</b>	<b>296 /2018 - GI</b>	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	<b>27/12/18</b>	
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>				
<b>Valor:</b>				
R\$ 3.895.939,81		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
Três milhões, oitocentos e noventa e cinco mil, novecentos e trinta e nove reais e oitenta e um centavos				
Sim para todos os fundos desta APR				
<b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>				
<b>Fundo:</b>	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO			
<b>CNPJ do Fundo:</b>	13.077.415/0001-05			
<b>Segmento:</b>	FI Renda Fixa - Geral			
<b>Tipo de Ativo:</b>	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"			
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Resgate			
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 3.895.939,81			
<b>Quantidade de Cotas:</b>	1.964.035,94786371			
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 1,98363977			
<b>Data da Operação:</b>	27/12/2018			
<b>Data de Liquidação:</b>	27/12/2018			
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$	1.159.627.600,00		
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	0,336%			
<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 BACDEN</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 (%):	1,00
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
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):	0
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:	Sim
CNPJ do Fundo:	27.146.328/0001-77
Segmento:	Renda Fixa
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em 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)	<p>Objetivos:</p> <p>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 compromissadas, no limite de 5% do patrimônio líquido.</p> <p>Principais riscos do fundo:</p> <p>Risco do Fundo atribuído pelo Administrador</p> <p>Risco de Taxa de Juros (Risco 2)</p> <p>Risco Baixo</p>
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	0,75%
Retorno Médio Anual	9,44%
Retorno Total	96,76%

Maior Retorno		1,17%
Menor Retorno		0,39%
Qtde. mês Positivo		90
Qtde. mês Negativo		0
Qtde. mês acima do Benchmark		1
Qtde. mês abaixo do Benchmark		89
Risco Mensal Período		0,22%
Risco Anual do Período		0,75%
Retorno Relativo ao Benchmark		-6,00%
Sharpe		-1,21
Information Ratio		-13,36
Tracking Error		0,07%
VAR (95%)		1,11%
Sharpe Modificado		-61,76
Beta (12 meses)		0,80
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,07%
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 RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	19/12/2018
Outras Observações:	Recebemos nesta data Contribuições da Câmara Municipal do Recife no valor de R\$ 95.841,50. O Resgate de R\$ 3.895,939,81 é destinado ao pagamento da folha de dezembro no valor de R\$ 8.291.781,31.	
<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?		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
<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

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)

PROponente

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

Gestor/Autorizador

José Marcos Alves de Barros

Chefe de Investimentos

CPF 334.326.354-00

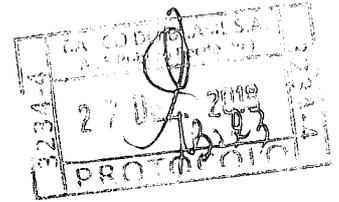
Entidade Certificadora ANBIMA

CPA 20 e CEA

Validade da Certificação: 21/11/2021

Recife, 27 de dezembro de 2018

Ofício RECIPREV nº 296/2018 – GAF



Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de 3.895.939,81 (Três milhões, oitocentos e noventa e cinco mil, novecentos e trinta e nove reais e oitenta e um centavos), 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 transferência via TED, conforme a seguir:

**A débito da conta 7.909-X, nessa agência:**

Banco: Banco Bradesco S.A. (237)

Agência: 0286-0

Conta Corrente: 65.000-5

Favorecido: Fundo Previdenciário Reciprev

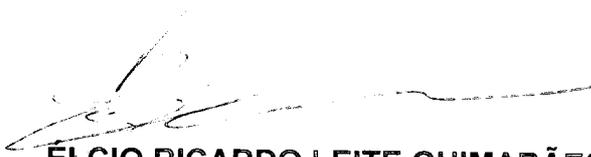
CNPJ: 07.749.668/0001-85

Valor: R\$ 8.291.781,31 (Oito milhões, duzentos e noventa e um mil, setecentos e oitenta e um reais e trinta e um centavos)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 296/2018

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

Folhas de dezembro/2018  
SANDRA MARIA GOMES GALINDO  
sex 21/12, 15:04 JOSE MARCOS ALVES DE BARROS;  
Boa Tarde, Zé Marcos!

Solicitamos o resgate de aplicações financeira da conta 65000-5 do Bradesco no valor de **R\$ 8.291,781,31**(oito milhões, duzentos e noventa e um mil, setecentos e oitenta e um reais e trinta e um centavos), sendo R\$ 8.282.993,45 (oito milhões, duzentos e oitenta e dois mil, novecentos e noventa e três reais e quarenta e cinco centavos, referente ao pagamento de dezembro/2018 dos **APO/PPR** e **PEN**, e R\$ 8.787,86 (oito mil, setecentos e oitenta e sete reais e oitenta e seis centavos), referente acertos, transmitido pela EMPREL com a data de pagamento para 28/12/2018, FUNDO RECIPIREV.

Informamos o valor liquido de **R\$ 20.749.272,15**(vinte milhões, setecentos e quarenta e nove mil, duzentos e setenta e dois reais e quinze centavos), sendo R\$ 20.708.300,22(vinte milhões, setecentos e oito mil, trezentos reais e vinte dois centavos),referente a folha de dezembro/2018 dos APO/PPR/PEN e R\$ 40.971,93( quarenta mil, novecentos e setenta e um reais e noventa e três centavos), referente acertos, transmitido pela EMPREL com a data de pagamento para 28/12/2018, FUNDO RECIFIN.

AUT. PREV. MUN. RECIFE - RECIPIREV  
SAÚDE RECIFE - Valor líquido **R\$ 54.755,64**(cinquenta e quatro mil, setecentos e cinquenta e cinco reais e sessenta e quatro centavos)

PREVIDÊNCIA - Valor líquido **R\$ 178.612,82**(cento e setenta e oito mil, seiscentos e doze reais e oitenta e dois centavos)

Sandra Galindo  
3355-1645

**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

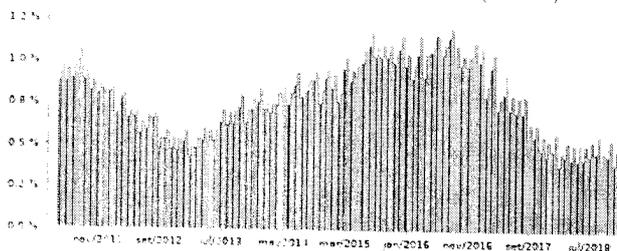
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17
Fundo	98,36	5,24	5,34	14,96	30,10	0,41	0,45	0,39	0,47	0,45	0,43	0,42	0,43	0,44	0,39	0,49	0,45
% do CDI	88,34	82,33	82,34	86,24	88,92	82,55	82,79	82,81	82,54	82,84	82,57	81,66	82,43	83,41	83,21	83,54	83,22
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	53,89	8,34	8,54	7,95	15,72	-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	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1.983639767	1.159.627,60	1.318.372,59	0,01%	-	0,01%	0,85	0,01%	0,49%	0,39%	0
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,58%	0,46%	0

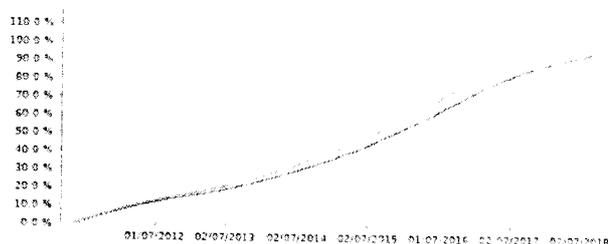
**Gráficos**

■ Fundo ■ CDI

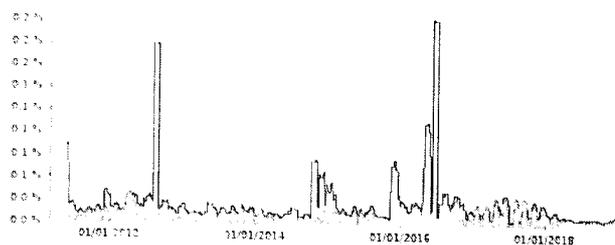
Retorno Mensal - 29/04/2011 a 27/12/2018 (mensal)



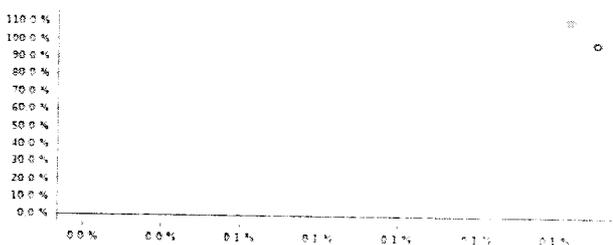
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 27/12/2018 (diária)



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

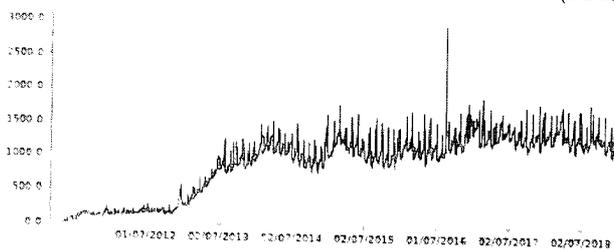


Risco x Retorno - 29/04/2011 a 27/12/2018 (diária)

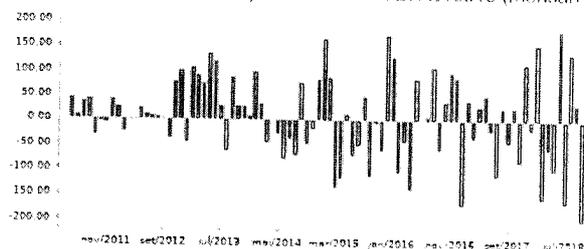


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualidade não é assumida pela OUBAN BOM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação distribuída ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. O Gestor da carteira de qualquer modalidade de segurança, desde que tenha a garantia de créditos. FIC: 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. A investidora é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento no aplicar seus recursos. Para avaliação da performance do Fundo Quartel, veja o relatório de análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações diárias.

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

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

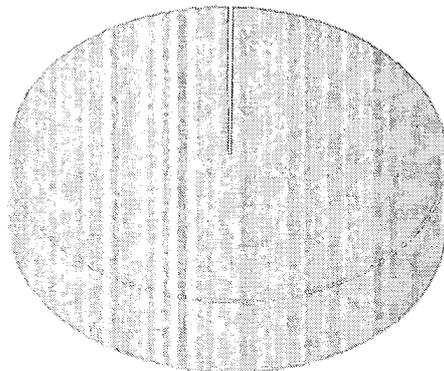
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,44	98,32	12,39	98,28	12,39	98,28	12,39	98,28	-	R\$ 1.318.550.113,79

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	abri/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%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.226.386,94	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
Data da Divulgação	05/12/2018	06/11/2018	03/10/2018	04/09/2018	03/08/2018	09/07/2018	07/06/2018	04/05/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

nov/2018



■ Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	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 OBIANFIM, pelo titular desta marca e 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. Gestão da carteira de qualquer mecanismo de hedge ou hedge da carteira. Características de Pagamentos: Final: Retornados de última no passado não representa garantia de pontualidade 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 os recursos investidos 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 a elaboração da parte superior de um fundo de investimento, o investidor realiza a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações diárias.