



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:	084 /2017 - GI	
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	084 /2017 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	18/07/17	
CNPJ: 05.244.336/0001-13	Dispositivo da Resolução do CMN		
Valor:	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"		
R\$ 1.300.000,00			
Um milhão e trezentos mil reais			
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 de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 1.300.000,00		
Quantidade de Cotas:	711.004,15663969		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,82840000		
Data da Operação:	18/07/2017		
Data de Liquidação:	18/07/2017		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.417.646.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,091701%		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS		
CNPJ do Administrador:	30.822.936/0001-69		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	05/12/2016		
Gestor:	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS		
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	05/12/2016		
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A.		
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	12/12/2016		
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 performar 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 de Renda Fixa - 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 compromissadas, 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	28/06/2017
Outras Observações:		
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSECTORIAL VALE II	
CNPJ do Fundo:	23.426.324/0001-91	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) - Aberto - Art. 7º, VI	
Tipo de operação realizada:	Aplicação	
Valor da operação:	R\$ 1.300.000,00	
Quantidade de Cotas:	12,89678376	
Valor da Cota (R\$):	R\$ 100.800,32542935	
Data da Operação:	18/07/2017	
Data de Liquidação:	18/07/2017	
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 10.069.993,55	

(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	11,430000%	
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4 / 7.909-X
Administrador:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	
CNPJ do Administrador:	62.285.390/0001-40	
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	12/12/2016	
Gestor:	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	
CNPJ do Gestor:	09.121.454/0001-95	
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	16/11/2016	
Distribuidor:	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	
CNPJ do Distribuidor:	62.285.390/0001-40	
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	12/12/2016	
Data de Início FI:	22/06/2017	
Taxa Administração do FI (%):	0,25% do PL paga pelo Fundo (tabela regressiva). Para o quotista, não há cobrança de taxa de administração.	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Liberum Rating	
Índice de Referência do FI :	125% do DI	
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:	A-	
Carência (dias):	0	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	90	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Cód. Negociação Bolsa:	Sem código	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR QUALIFICADO	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	X-X-X-X-X-X-X	
Segmento:	X-X-X-X-X-X-X	
Tipo de Ativo:	X-X-X-X-X-X-X	
% Carteira do Fundo:	X-X-X-X-X-X-X	
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 objetivo do Fundo é proporcionar a seus Quotistas, observada a política de investimetro e de composição da carteira definida em seu Regulamento, a valorização de suas Quotas por meio da aquisição pelo Fundo : (i) De Direitos de Crédito, juntamente com todos os direitos, privilégios, preferências, prerrogativas e ações assegurados aos titulares de tais Direitos de Crédito, tudo nos termos do Contrato de Cessão e(ii) de Arivos Financeiros. Os Direitos de Crédito que serão adquiridos pelo Fundo serão oriundos em diversos segmetos, sendo oriundos de operações de arrendamento mercantil ou do segmento de prestação de serviços.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado, de Crédito, Marconeconômicos, Concentração, operacioanais e demais riscos conforme regulamento e prospecto.
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade em razão do longo prazo de 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

Outras Observações:

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

Validade da Certificação: 04/02/2018

Gestor/Autorizador Certificação/Validade

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

Validade da Certificação: 03/05/2019

Responsável pela Liquidação da Operação:

Márcio Araújo Acioli

Gerente Administrativo e Financeiro

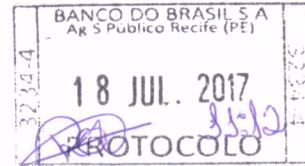
CPF: 111.494.264-20

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 18 de julho de 2017

Ofício RECIPREV nº 084/2017 – GI



Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 1.300.000,00 (Hum milhão e trezentos mil 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 seguinte TED:

Banco: Banco Paulista - 611
Agência: 001
Conta Corrente: 41.045-7
Favorecido: Fundo de Investimento em Direitos Creditórios Vale II
CNPJ: 23.426.324/0001-91
Valor: R\$ 1.300.000,00 (Um milhão e trezentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 084/2017

Atenciosamente,

JOSÉ MARGOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

MÁRCIO ARAÚJO ACIOLI
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilmo Senhor
PEDRO PAULO
Gerente de Relacionamento
Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE

NESTA
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



**PREFEITURA DO
RECIFE**

Recife, 18 de julho de 2017

Ofício RECIprev nº 16A/2017 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIprev CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 1.300.000,00 (Um milhão e trezentos mil reais), no **Fundo de Investimento em Direitos Creditórios Vale II CNPJ: 23.426.324/0001-91**.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através do Banco do Brasil S.A., Agência 3234-4, conta corrente 7.909-X, com os dados a seguir:

Banco: Banco Paulista - 611
Agência: 001
Conta Corrente: 41.045-7
Favorecido: Fundo de Investimento em Direitos Creditórios Vale II
CNPJ: 23.426.324/0001-91
Valor: R\$ 1.300.000,00 (Um milhão e trezentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 084/2017

Atenciosamente,

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
Gerente Administrativo e Financeiro

Entregado em 18/07/2017

[Assinatura]

JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
Gerente de Investimentos
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores
Mar 100 163 100 163 100 163 100 163 100 163

Prezados (as) Senhores (as)
Luiz Carlos Leme Jr/Ana Paula França
Tercon Investimentos Ltda
São Paulo - SP

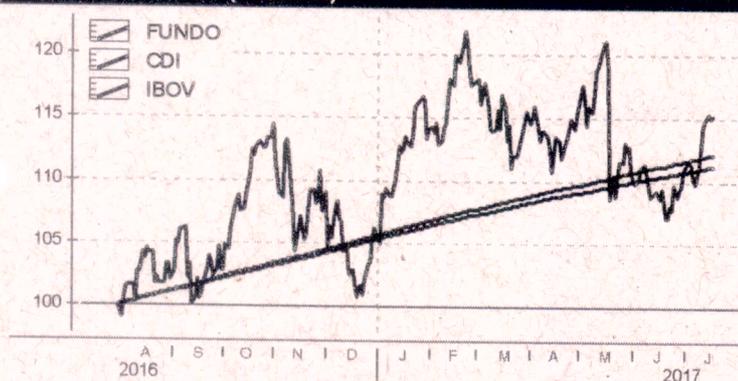
Características

	● FUNDO	● BB Top RF C FI
CNPJ	13077415000105	06006071000188
Início do Fundo	28/04/2011	06/08/2004
Código Anbima	272604	130168
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Baixa Soberano	Renda Fixa Duração Média Grau de Invest.
Gestão	BB Dtvn S.A	BB Dtvn S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dtvn S.A	BB Dtvn S.A
Taxa máx. adm. (%)	1,00	0,00
Taxa performance	-	-
Data da Última Cotação	18/07/2017	18/07/2017
Cota	1,8284	19,502
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.417.646	15.598.014
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.239.055	13.062.722
Fundo de cotas	Sim	Não
Valor Invest	100,01	76,62
Nome	BB Top RF Títulos Públicos Federais FI - Cotas d... LFT 210100 2022-09-01 - Operações compromiss...	
Investidor qualificado	Não	Não
Tipo de Investidor	Não Há Restrição	Reservado
Resolução 3792	Sim	-
Resolução 3922	Sim	-

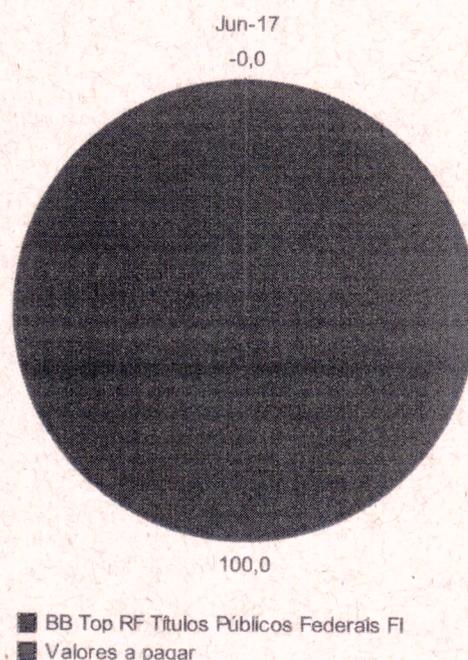
Retornos (%) (até 18/07/2017)

	fev 2017	mar 2017	abr 2017	mai 2017	jun 2017	jul 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,80	0,97	0,73	0,82	0,73	0,41	12,36	13,11	5,61	11,73	26,40	40,42	82,84
● CDI	0,86	1,05	0,79	0,93	0,81	0,46	13,24	14,00	6,13	12,66	28,50	43,81	91,83
● IBOV	3,08	-2,52	0,64	-4,12	0,30	3,88	-13,31	38,94	8,48	15,67	24,83	14,60	-0,51

Retorno Acumulado (252 dias)



Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Maior Retorno Mensal (%)	1,16
Menor Retorno Mensal (%)	0,41
Retorno Acumulado (%)	11,73
Volatilidade	0,09
Sharpe	-37,86
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,04

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economática é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.