



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: | 089 /2017 - GI |
| Unidade Gestora do RPPS | | OF. Nº: | 089 /2017 - GI |
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores | | Data: | 04/08/17 |
| CNPJ: 05.244.336/0001-13 | | Dispositivo da Resolução do CMN | |
| Valor: | | FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a" | |
| R\$ 226.000,00 | | | |
| Duzentos e vinte e seis 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\$ 226.000,00 | | |
| Quantidade de Cotas: | 123.086,97783345 | | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 1,83610000 | | |
| Data da Operação: | 04/08/2017 | | |
| Data de Liquidação: | 04/08/2017 | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 1.219.915.000,00 | | |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,018526% | | |
| 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 |
| | 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 RECIпреV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações | |
| | Data da reunião do Comitê de Investimentos | 25/07/2017 |
| Outras Observações: | Pagamento da Taxa de Administração do Fundo Previdenciário Reciprev | |
| Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s) | | |
| PROponente: Anderson 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: Marcia Araújo Acioli Gerente Administrativo e Financeiro CPF: 111.494.264-20 |

Recife, 04 de agosto de 2017

Ofício RECIPREV nº 089/2017 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 226.000,00 (Duzentos e vinte e seis 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 transferir o mesmo valor para a conta 7.897-2 da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde, nessa agência.

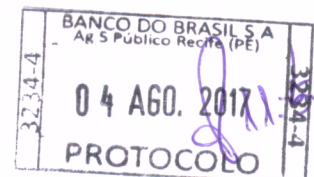
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 089/2017

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS 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



Taxa Administrativa

VALDSON FERREIRA DA SILVA

sex 04/08/2017 17:09

Para: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS <zemarcos@recife.pe.gov.br>;

Solicitamos transferir o valor de R\$ 150.666,67 (Cento e cinquenta mil, seiscentos e sessenta e seis reais e sessenta e sete centavos), da conta 7.908-1 para a conta 7.7897-2, e R\$ 226.000,00 (Duzentos e vinte e seis mil reais), da 7.909-X para a conta 7.7897-2 da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde, relativas as Taxas de Administração do mês de agosto de 2017.

Atenciosamente,

Valdson Ferreira da Silva

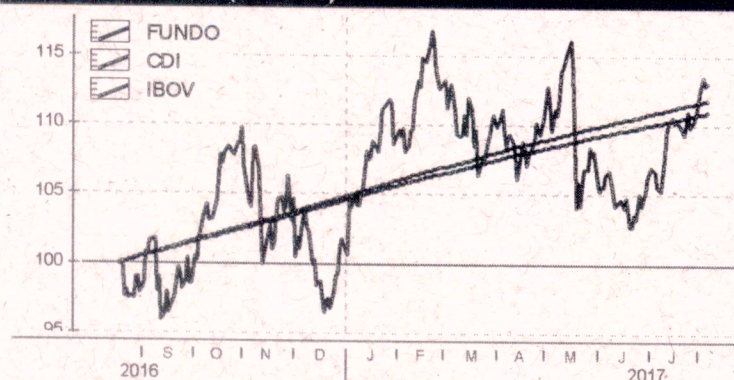
Gestor da Unidade Administrativa, Financeira e Gestão de Pessoas

| 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 | | 04/08/2017 | 04/08/2017 |
| Cota | | 1,8361 | 19,597 |
| Patrimônio Líquido (R\$ 000) | | 1.219.915 | 15.734.436 |
| Patrimônio Médio 12m (R\$ 000) | | 1.227.253 | 13.456.699 |
| Fundo de cotas | | Sim | Não |
| Valor Invest | | 100,01 | 38,69 |
| Nome | BB Top RF Títulos Públicos Federais FI - Cotas d... NTN-F 950199 2025-01-01 - Operações compromi... | | |
| Investidor qualificado | | Não | Não |
| Tipo de investidor | | Não Há Restrição | Reservado |
| Resolução 3792 | | Sim | - |
| Resolução 3922 | | Sim | - |

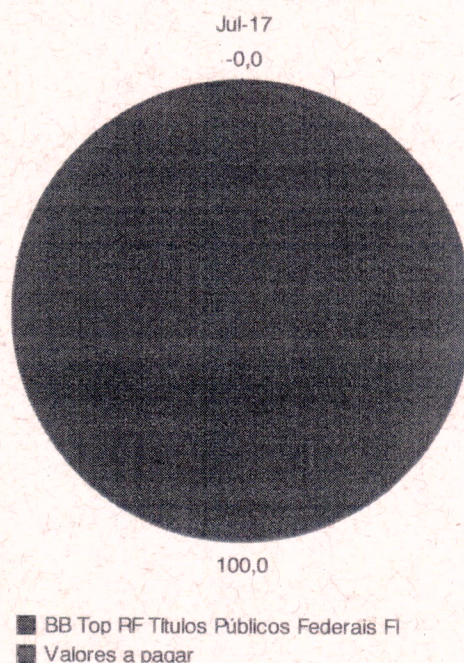
Retornos (%) (até 04/08/2017)

| | mar 2017 | abr 2017 | mai 2017 | jun 2017 | jul 2017 | ago 2017 | 2015 | 2016 | 2017 | 12m | 24m | 36m | do início |
|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|-----------|
| ● FUNDO | 0,97 | 0,73 | 0,82 | 0,73 | 0,71 | 0,12 | 12,36 | 13,11 | 6,05 | 11,48 | 26,20 | 40,44 | 83,61 |
| ● CDI | 1,05 | 0,79 | 0,93 | 0,81 | 0,80 | 0,14 | 13,24 | 14,00 | 6,64 | 12,43 | 28,31 | 43,85 | 92,74 |
| ● IBOV | -2,52 | 0,64 | -4,12 | 0,30 | 4,80 | 1,48 | -13,31 | 38,94 | -11,07 | 16,15 | 33,64 | 18,16 | 1,86 |

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 (%) | 1,05 |
| Menor Retorno Mensal (%) | 0,12 |
| Retorno Acumulado (%) | 11,48 |
| Volatilidade | 0,10 |
| Sharpe | -41,00 |
| VAR de 1 mês - 95% (%) | 0,05 |

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.