



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:	092 /2017 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	092 /2017 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	07/08/17
CNPJ: 05.244.336/0001-13		Dispositivo da Resolução do CMN	
Valor:		FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) – Fechado - Art. 7º, VII, "a"	
R\$ 737.825,23		FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	
Setecentos e trinta e sete mil, oitocentos e vinte e cinco reais e vinte e três centavos			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIRETOS EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL VALE (SÊNIORES SÉRIES 4)		
CNPJ do Fundo:	11.278.761/0001-26		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) – Fechado - Art. 7º, VII, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 737.825,23		
Quantidade de Cotas:	1,43950450		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 512.555,00000000		
Data da Operação:	07/08/2017		
Data de Liquidação:	07/08/2017		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 10.208.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	7,227912%		
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:	29/12/2009		
Taxa Administração do FI (%):	0,25		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Standard & Poors		

Índice de Referência do FI :			
Tx Performance do FI (%):	IPCA+7,00 %		
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:	B		
Carência (dias):	3.233		
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 QUALIFICADO		
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos o fundos:	Não		
CNPJ do Fundo:			
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 investimentos e de composição da carteira definida, a valorização de sua Quotas por meio da aquisição pelo fundo: (I) De Direitos de C[edito, juntamente com todos os direitos, privilégios, preferências, prerrogativas e ações asseguradas aos titulares de tais Direitos de Crédito, tudo nos termos do Contrato de Cessão e (II) de Ativos Financeiros.	
	Principais riscos do fundo:	Risco de Crédito e diversos outros conforme o regulamento do fundo (Risco 4)	
	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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações		
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	25/07/2017	
Outras Observações:	Pagamento de resgate parcial		
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:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 737.825,23		
Quantidade de Cotas:	401.712,43534600		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,83670000		
Data da Operação:	07/08/2017		
Data de Liquidação:	07/08/2017		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.296.920.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,056891%		
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 RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	25/07/2017
Outras Observações:	Aplicação de recursos	

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, 07 de agosto de 2017


Ofício RECIPREV nº 092/2017 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 737.825,23 (Setecentos e trinta e sete mil, oitocentos e vinte e cinco reais e vinte e três centavos), no 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.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 092/2017

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


MÁRCIO ARAÚJO ACIOLI
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

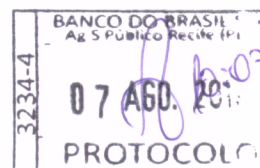
Ilmo Senhor

PEDRO PAULO

Gerente de Relacionamento

Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE

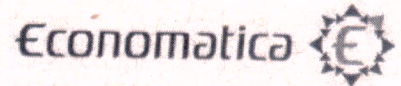
NESTA



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**

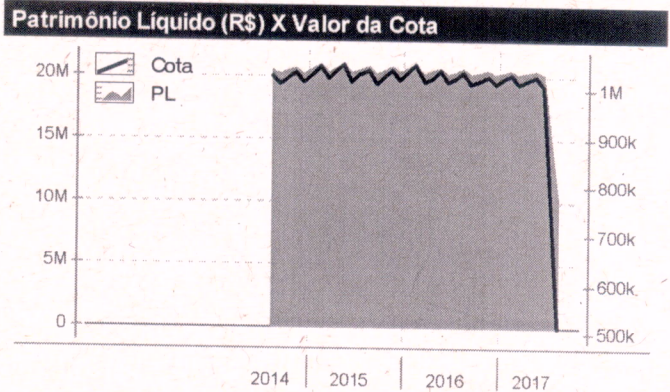
FIDC Multissetorial Vale-Sen



Características	
CNPJ	11278761000126
Início do Fundo	12/11/2013
Código Anbima	374725
Classificação Anbima	FIDC Fomento Mercantil
Gestão	Tercon Asset Management
Custodiante	-
Administrador	Gradual Cctvm S A
Taxa máx. adm. (%)	0,25
Taxa performance	-

Condições de Investimentos	
Aplicação inicial mínima	1.000.000
Aplicação adicional mínima	0
Resgate mínimo	0
Saldo mínimo	0
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+000
Prazo pgto resgate	D+000
Benchmark	Não se Aplica

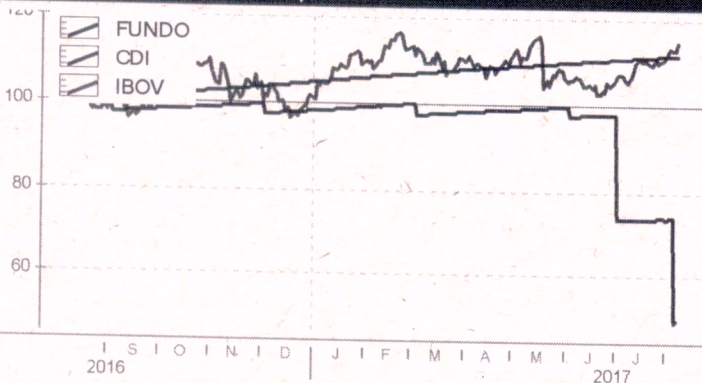
Data da Última Cotação	08/08/2017
Cota	512.555
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	10.208
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	19.032
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	-
Resolução 3922	-



Retornos (%) (até 07/08/2017)

	mar 2017	abr 2017	mai 2017	jun 2017	jul 2017	ago 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	-1,73	0,67	0,95	-1,90	-24,60	-32,65	0,31	-0,63	-49,37	-50,04	-50,42	-	-50,12
● CDI	1,05	0,79	0,93	0,81	0,80	0,17	13,24	14,00	6,67	12,41	28,16	43,72	42,79
● IBOV	-2,52	0,64	-4,12	0,30	4,80	3,06	-13,31	38,94	12,80	17,82	39,86	20,91	10,85

Retorno Acumulado (252 dias)



Composição da Carteira (por tipo de Investimento)

Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	6
Meses Negativos	6
Maior Retorno Mensal (%)	1,00
Menor Retorno Mensal (%)	-32,63
Retorno Acumulado (%)	-50,04
Volatilidade	49,22
Sharpe	-1,22
VAR de 1 mês - 95% (%)	19,62

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.

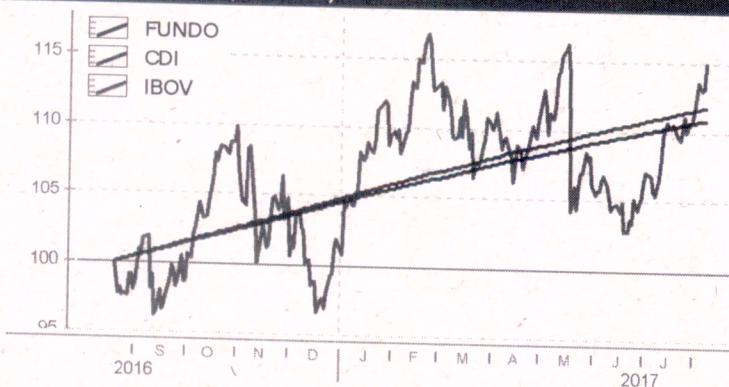
Características

CNPJ	● FUNDO	● BB Top RF C FI
Início do Fundo	13077415000105	06006071000188
Código Anbima	28/04/2011	06/08/2004
Classificação Anbima	272604	130168
Gestão	Renda Fixa Duração Baixa Soberano	Renda Fixa Duração Média Grau de Invest.
Custodiante	BB DtvM S.A	BB DtvM S.A
Administrador	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
	BB DtvM S.A	BB DtvM S.A
Taxa máx. adm. (%)	1,00	
Taxa performance		0,00
Data da Última Cotação	10/08/2017	10/08/2017
Cota	1,8367	19,603
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	1.296.920	15.685.903
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	1.228.768	13.458.115
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	-

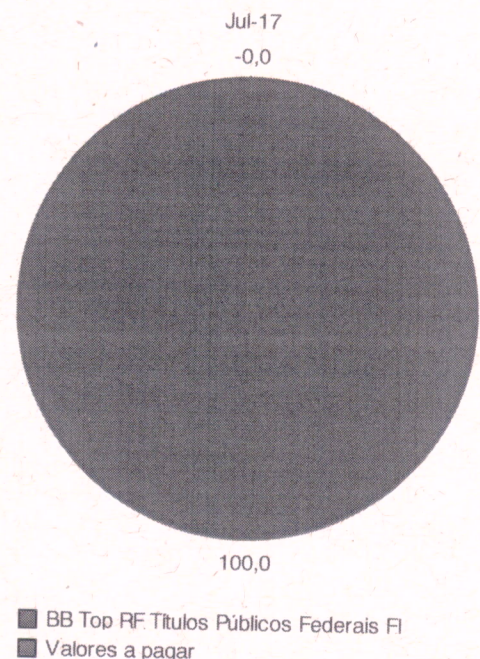
Retornos (%) (até 07/08/2017)

	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	0,15	12,36	13,11	6,09	11,45	26,05	40,32	83,67
● CDI	1,05	0,79	0,93	0,81	0,80	0,17	13,24	14,00	6,67	12,41	28,16	43,72	92,81
● IBOV	-2,52	0,64	-4,12	0,30	4,80	3,06	-13,31	38,94	12,80	17,82	39,86	20,91	3,45

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 (%)	0,24
Retorno Acumulado (%)	11,45
Volatilidade	0,10
Sharpe	-41,03
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.