



**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>	096 /2017 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		<b>OF. Nº:</b>	096 /2017 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	11/08/17	
CNPJ: 05.244.336/0001-13		<b>Dispositivo da Resolução do CMN</b>		
Valor:		FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"		
R\$ 13.200.161,36				
Treze milhões, duzentos mil, cento e sessenta e um reais e trinta e seis centavos				
<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>	Renda Fixa			
<b>Tipo de Ativo:</b>	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"			
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Aplicação			
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 13.200.161,36			
<b>Quantidade de Cotas:</b>	6.194.350,70858752			
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,13100000			
<b>Data da Operação:</b>	11/08/2017			
<b>Data de Liquidação:</b>	11/08/2017			
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 4.995.016.000,00			
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	0,264267%			
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X	
<b>Administrador:</b>	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS			
<b>CNPJ do Administrador:</b>	30.822.936/0001-69			
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	05/12/2016			
<b>Gestor:</b>	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS			
<b>CNPJ do Gestor:</b>	30.822.936/0001-69			
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	05/12/2016			
<b>Distribuidor:</b>	BANCO DO BRASIL S.A.			
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	00.000.000/0001-91			
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	12/12/2016			
<b>Data de Início FI:</b>	28/04/2011			
<b>Taxa Administração do FI (%):</b>	0,20			
<b>Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:</b>	Dispensado			

RECIFE, 28 DE ABRIL DE 2017.

SECRETARIA DE FINANÇAS PÚBLICAS - FUNDO DE INVESTIMENTO

13.322.205/0001-35

RENDAS FIXAS

FI 100% TÍTULOS TN - Art. 7º, I, "b"

R\$ 13.200.161,36

11/08/2017

0,264267%

30.822.936/0001-69

05/12/2016

BANCO DO BRASIL S.A.

00.000.000/0001-91

12/12/2016

28/04/2011

0,20

Dispensado



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	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	1	
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:	Não	
CNPJ do Fundo:	X-X-X-X-X	
Segmento:	X-X-X-X-X	
Tipo de Ativo:	X-X-X-X-X	
% Carteira do Fundo:	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 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
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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	25/07/2017
Outras Observações:		
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)		
<b>PROponente:</b> <b>Anderson Carlos Gomes de Oliveira</b> Chefe de Divisão de Investimentos CPF: 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 04/02/2018	<b>Gestor/Autorizador Certificação/Validade</b> <b>José Marcos Alves de Barros</b> Gerente de Investimentos CPF: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019	<b>Responsável pela Liquidação da Operação:</b> <b>Márcio Araújo Acloli</b> Gerente Administrativo e Financeiro CPF: 111.494.264-20



Recife, 11 de agosto de 2017

**Ofício RECIPREV nº 096/2017 – GI**

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar as seguintes operações:

- a) Aplicar o valor de R\$ 13.200.161,36 (Treze milhões, duzentos mil, cento e sessenta e um reais e trinta e seis centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35, vinculado à conta 7.909-X;
- b) Efetuar a seguinte TED a débito da conta 7.909-X:

Banco: CITIBANK N. 745

Agência: 001

Conta Corrente: 5643740

Favorecido: Western Asset Ativo FI Renda Fixa

CNPJ: 03.499.367/0001-90

Valor: R\$ 3.161.369,65 (Três milhões, cento e sessenta e um mil, trezentos e sessenta e nove reais e sessenta e cinco centavos)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 096/2017

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

Autorquia 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





## Características

CNPJ	13322205000135
Início do Fundo	28/04/2011
Código Anbima	272612
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	BB Dtvn S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dtvn S.A
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-

Data da Última Cotação	11/08/2017
Cota	2,131
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	4.995.016
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	5.483.062

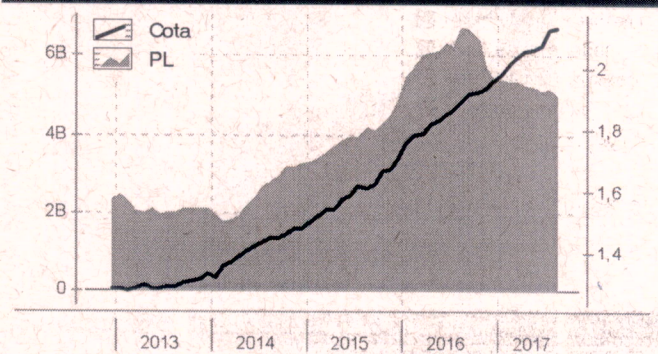
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

## Condições de Investimentos

Aplicação inicial mínima	10.000
Aplicação adicional mínima	0
Resgate mínimo	0
Saldo mínimo	0
Prazo emissão de cotas	D+000
Prazo conversão resgate	D+001
Prazo pgto resgate	D+001

Benchmark	IDKA IPCA 2A
-----------	--------------

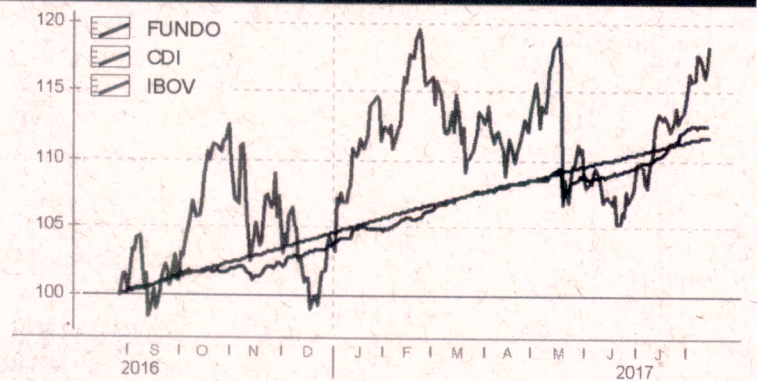
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



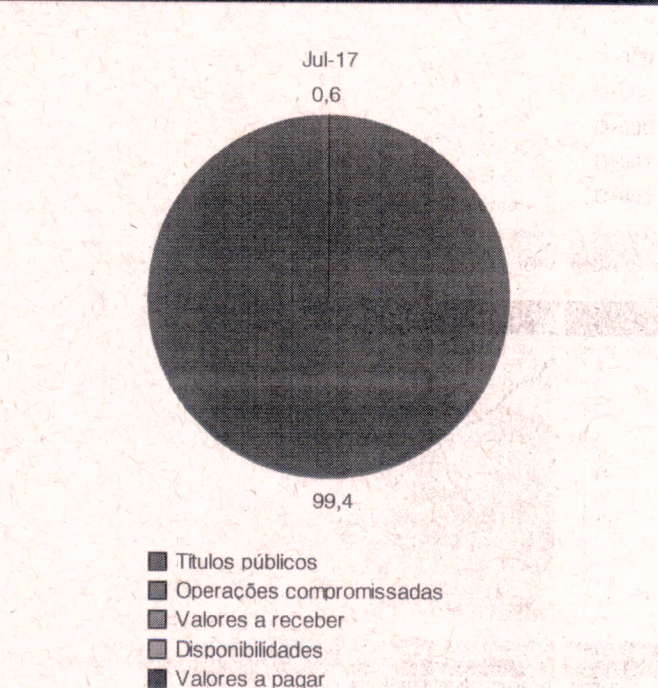
## Retornos (%) (até 11/08/2017)

	mar 2017	abr 2017	mai 2017	jun 2017	jul 2017	ago 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,41	0,76	0,39	0,61	2,44	0,28	15,38	14,89	8,58	12,59	32,71	48,42	113,10
● CDI	1,05	0,79	0,93	0,81	0,80	0,31	13,24	14,00	6,82	12,33	28,20	43,80	93,08
● IBOV	-2,52	0,64	-4,12	0,30	4,80	2,18	-13,31	38,94	11,84	15,54	37,26	18,98	2,57

## 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 (%)	2,44
Menor Retorno Mensal (%)	0,28
Retorno Acumulado (%)	12,59
Volatilidade	2,93
Sharpe	0,09
VAR de 1 mês - 95% (%)	1,38

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.