



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:	104 /2017 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	104 /2017 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	28/08/17
CNPJ: 05.244.336/0001-13		Dispositivo da Resolução do CMN	
Valor:		FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	
R\$ 9.707.998,21			
Nove milhões, setecentos e sete mil, novecentos e noventa e oito reais e vinte e um centavos			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO		
CNPJ do Fundo:	13.322.205/0001-35		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 9.707.998,21		
Quantidade de Cotas:	4.535.142,20867853		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,14061605		
Data da Operação:	28/08/2017		
Data de Liquidação:	29/08/2017		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 4.959.261.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,195755%		
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 (%):	0,20		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	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:	R\$ 0,00	
Segmento:	R\$ 0,00	
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00	
% Carteira do Fundo:	0,00	
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 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	15/08/2017
Outras Observações:	Pagamento: Folha e Consignado do mês de agosto de 2017	
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

Recife, 28 de agosto de 2017

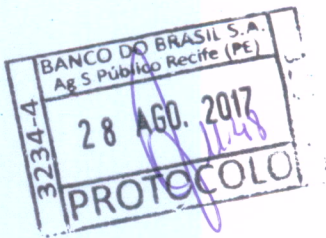
Ofício RECIPREV nº 104/2017 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 9.707.998,21 (Nove milhões, setecentos e sete mil, novecentos e noventa e oito reais e vinte e um centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35, vinculado à conta 7.909-X, e transferir o mesmo valor para a conta 10.156-7, nessa agência.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 104/2017

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



Folha APO/PPR C/08/2017
VALDSON FERREIRA DA SILVA
Hoje, 28/08/2017 JOSE MARCOS ALVES DE BARROS

Zé, Bom dia!

Vimos solicitar o resgate de aplicações financeiras, e que sejam transferidos da conta 7.909-X para conta a 10.156-7, ambas no Banco do Brasil S.A., o valor total de R\$ 9.707.998,21, referente ao pagamento da folha de APO/PPR e Consignações de agosto/2017 do Fundo Previdenciário Reciprev.

Valor da folha de pagamento R\$ 7.907.373,70

Valor das consignações R\$ 1.800.624,51

Atenciosamente,

Valdson Ferreira da Silva

de conta
de R\$
de

Características

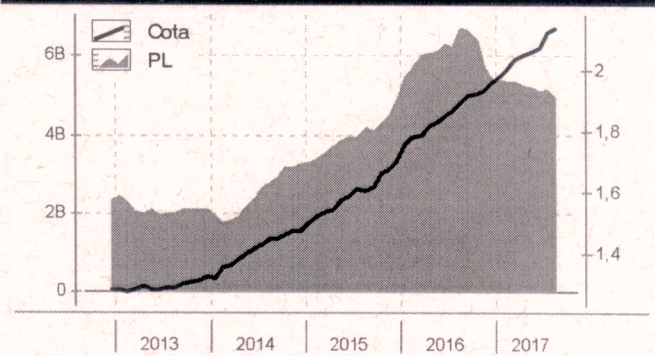
CNPJ	13322205000135
Início do Fundo	28/04/2011
Código Anbima	272612
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	BB Dtvn S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB Dtvn S.A
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-
Data da Última Cotação	29/08/2017
Cota	2,1406
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	4.959.261
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	5.480.083
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

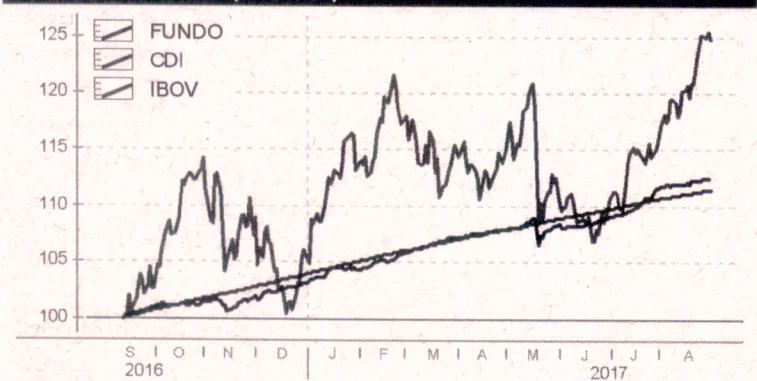
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



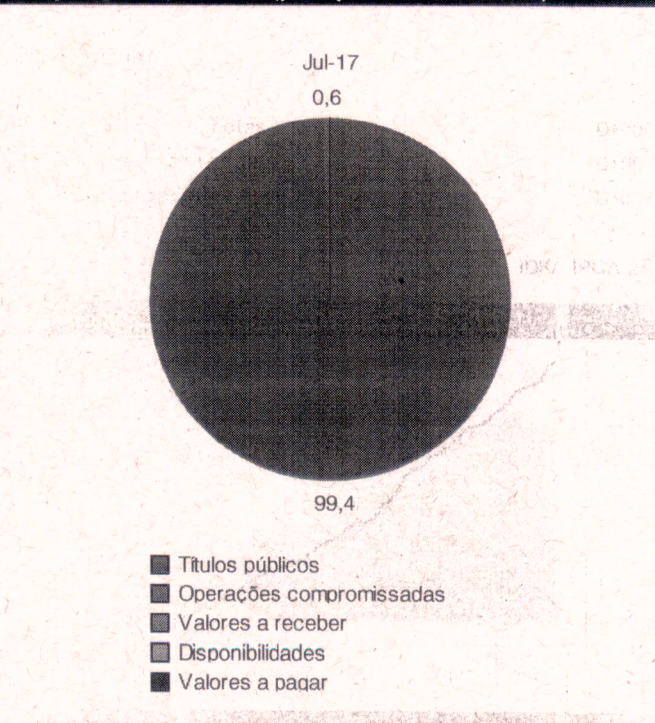
Retornos (%) (até 29/08/2017)

	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	0,73	15,38	14,89	9,07	12,97	32,74	47,30	114,06
● CDI	1,05	0,79	0,93	0,81	0,80	0,73	13,24	14,00	7,27	12,09	27,86	43,58	93,88
● IBOV	-2,52	0,64	-4,12	0,30	4,80	8,21	-13,31	38,94	18,44	21,70	51,27	16,38	8,61

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 (%)	0,39
Retorno Acumulado (%)	12,97
Volatilidade	2,91
Sharpe	0,28
VAR de 1 mês - 95% (%)	1,37

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.