



**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 Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>		<b>Nº / ANO:</b>	105 /2017 - GI	
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>		<b>OF. Nº:</b>	105 /2017 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		<b>Data:</b>	28/08/17	
<b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>		<b>Dispositivo da Resolução do CMN</b>		
<b>Valor:</b>		FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"		
R\$ 60.000.000,00				
Sessenta milhões de reais				
<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>	Resgate			
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 60.000.000,00			
<b>Quantidade de Cotas:</b>	28.029.314,24528060			
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$ 2,14061605			
<b>Data da Operação:</b>	28/08/2017			
<b>Data de Liquidação:</b>	29/08/2017			
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 4.959.261.000,00			
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	1,209858%			
<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			

EXIBIDA ÀS FUNDOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO  
CNPJ: 13.322.205/0001-35  
Data: 28/08/2017  
Valor: R\$ 60.000.000,00  
Quantidade de Cotas: 28.029.314,24528060  
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: 1,209858%  
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 RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	15/08/2017
Outras Observações:		
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	
CNPJ do Fundo:	07.442.078/0001-05	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	
Tipo de operação realizada:	Aplicação	
Valor da operação:	R\$ 60.000.000,00	
Quantidade de Cotas:	13.694.880,82880400	
Valor da Cota (R\$):	R\$ 4,38119913	
Data da Operação:	28/08/2017	
Data de Liquidação:	29/08/2017	
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 5.538.232.000,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,083378%	
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:	24/07/2005	
Taxa Administração do FI (%):	0,20	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Índice de Referência do FI :	IMA-B	
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 busca retorno dos investimentos através do sub-índice IMA-B. Para isso, aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais, registrados no SELIC e/ou em suas operações compromissadas. Deve, 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 5)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Alto
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	15/08/2017
Outras Observações:		
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)		
<b>PROPONENTE:</b> Andreson Carlos Gomes de Oliveira 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> José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 334.326.854-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019	<b>RESPONSÁVEL PELA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO:</b> Márcio Ataíde Acioli Gerente Administrativo e Financeiro CPF: 111.494.264-20

Recife, 28 de agosto de 2017

**Ofício RECIPREV nº 105/2017 – GI**

Senhor Gerente,

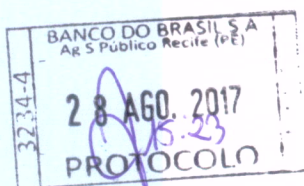
Solicitamos resgatar o valor de R\$ 60.000.000,00 (Sessenta milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35, e aplicar o mesmo valor no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.442.078/0001-05, ambos vinculados à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 105/2017

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



## Características

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

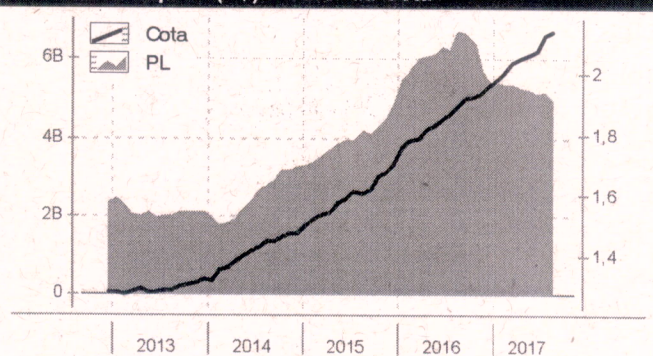
Data da Última Cotação	29/08/2017
Cota	2,1406
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	4.959.261
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	5.480.083
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

## 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
-----------	--------------

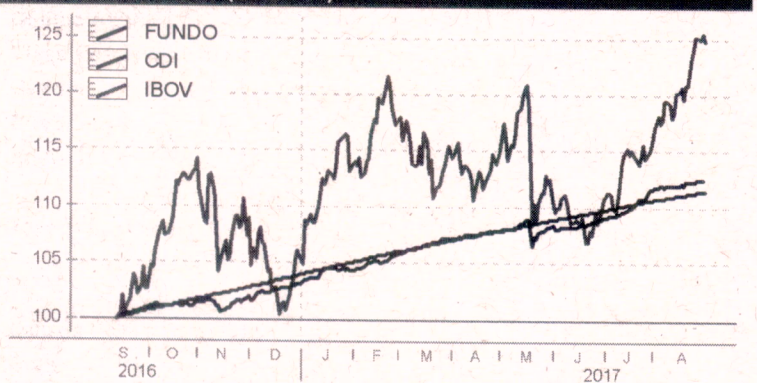
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



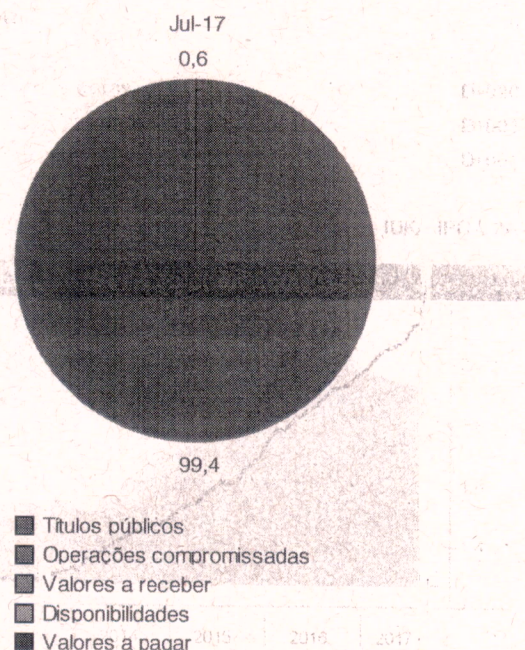
## Retornos (%) (até 29/08/2017)

	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.

# BB Prev RF Ima B Tit Publ FI

Economática



## Características

CNPJ	07442078000105
Início do Fundo	24/06/2005
Código Anbima	242901
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	BB DtvM S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB DtvM S.A

Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-

Data da Última Cotação	29/08/2017
Cota	4,3812
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	5.538.232
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	5.604.102

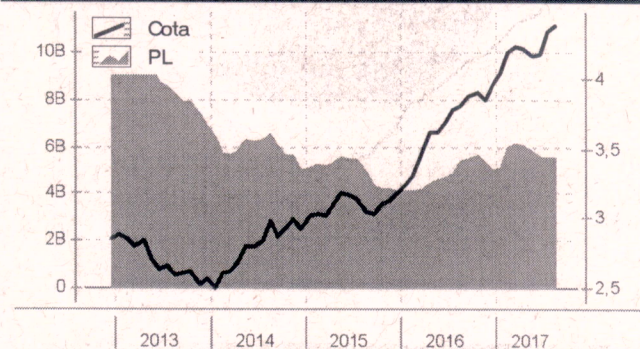
Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

## 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	IMA-B
-----------	-------

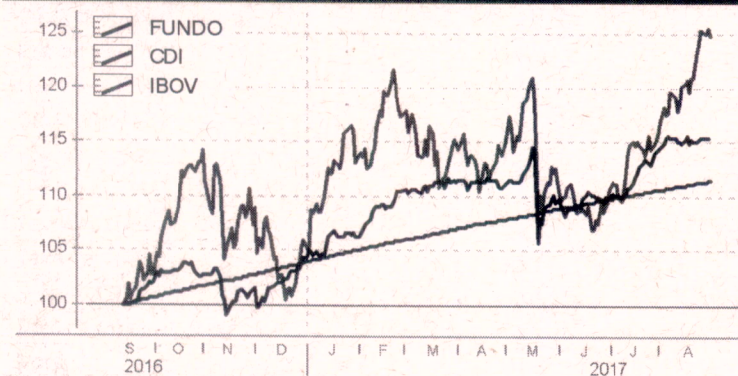
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



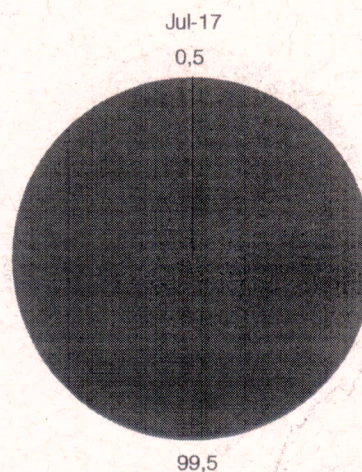
## Retornos (%) (até 29/08/2017)

	mar 2017	abr 2017	mai 2017	jun 2017	jul 2017	ago 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	1,02	-0,34	-1,20	0,15	3,96	1,00	8,53	24,52	10,62	14,66	42,71	47,40	151,61
● 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	119,21
● 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	4,59

## Retorno Acumulado (252 dias)



## Composição da Carteira (por tipo de Investimento)



- Titulos públicos
- Operações compromissadas
- Valores a receber
- Disponibilidades
- Valores a pagar

## Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	9
Meses Negativos	3
Maior Retorno Mensal (%)	3,96
Menor Retorno Mensal (%)	-1,26
Retorno Acumulado (%)	14,66
Volatilidade	10,06
Sharpe	0,28
VAR de 1 mês - 95% (%)	4,65

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.