



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

AUTORIZAÇÃO
DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR

Nº / ANO: 123 /2016

Unidade Gestora do RPPS:
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos
Servidores

OF. Nº: 123/2016 – GI

Data: 09/09/2016

CNPJ: 05.244.336/0001-13

VALOR (R\$): 11.900.000,00 (Onze milhões e novecentos mil
reais)

Dispositivo da Resolução do CMN:
Art. 7º, IV, "a" e Art. 7º, I, "b"

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO

Descrição da operação:

Resgate no valor de R\$ 11.900.000,00 (Onze milhões e novecentos mil reais), do fundo BB Previdenciário RF Fluxo CNPJ: 13.077.415/0001-05; para ser aplicado conforme a seguir:

- R\$ 1.900.000,00 (Hum milhão e novecentos mil reais), no fundo BB Previdenciário RF Perfil CNPJ: 13.077.418/0001-49;
- R\$ 10.000.000,00 (Dez milhões de reais), no fundo BB Previdenciário RF IDKA 2 TP FI CNPJ: 13.322.205/0001-35.

A aplicação no fundo BB Previdenciário RF Perfil CNPJ: 13.077.418/0001-49 e BB Previdenciário RF IDKA 2 TP FI CNPJ: 13.322.205/0001-35, estão aderentes à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev.

Os fundos BB Previdenciário RF Perfil CNPJ: 13.077.418/0001-49 e BB Previdenciário RF IDKA 2 TP FI CNPJ: 13.322.205/0001-35, encontram-se credenciados pelo Fundo Previdenciário Reciprev.

O resgate e as aplicações acima foram definidos e autorizados na reunião do Comitê de Investimentos do dia 31.08.2016.

Anexo: Lâminas dos fundos e ofício

CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Renda Fixa – Art. 7º, IV, "a"

Instituição Financeira: BB Gestão de Recursos DTVM S.A


CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69

Fundo: BB Previdenciário RF Fluxo
CNPJ do Fundo: 13.077.415/0001-05
Índice de Referência: CDI

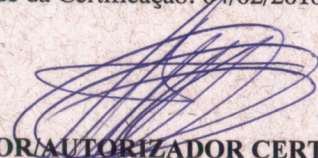
Segmento: Renda Fixa
Tipo de Ativo: Renda Fixa – Art. 7º, IV, "a"
Instituição Financeira: BB Gestão de Recursos DTVM S.A
CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69
Fundo: BB Previdenciário RF Perfil
CNPJ do Fundo: 13.077.418/0001-49
Índice de Referência: CDI
Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 5.425.957.000,00 (posição de 06/09/2016)
% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,04%

Segmento: Renda Fixa
Tipo de Ativo: Renda Fixa – Art. 7º, IV, "a"
Instituição Financeira: BB Gestão de Recursos DTVM S.A
CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69
Fundo: BB Previdenciário RF IDKA 2 TP FI
CNPJ do Fundo: 13.322.205/0001-35
Índice de Referência: IDKA 2
Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 6.622.749.000,00 (posição de 06/09/2016)
% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,15%


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

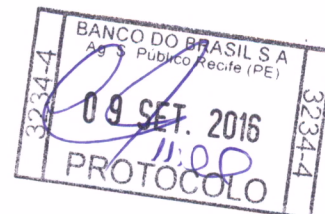

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos
CPF: 334.326.354-00
Entidade Certificadora: ANBIMA
Validade da Certificação: 03/05/2019

RESPONSÁVEL PELA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO:


Márcio Araújo Acioli
Gerente Administrativo e Financeiro
CPF: 111.494.264-20

Recife, 09 de setembro de 2016

Ofício RECI PREV nº 123/2016 – GI



Senhor Gerente,


Solicitamos efetuar as seguintes operações:

- a) Resgatar o valor de R\$ 11.900.000,00 (Onze milhões e novecentos mil reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- b) Aplicar o valor de R\$ 1.900.000,00 (Um milhão e novecentos mil reais), no fundo BB Previdenciário RF Perfil CNPJ: 13.077.418/0001-49;
- c) Aplicar o valor de R\$ 10.000.000,00 (Dez milhões de reais), no fundo BB Previdenciário RF IDKA 2 TP FI CNPJ: 13.322.205/0001-35.

Ambas vinculadas à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 123/2016

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
Gerente Administrativo e Financeiro

Ilmo Senhor
PEDRO PAULO
Gerente de Relacionamento
Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE
NESTA

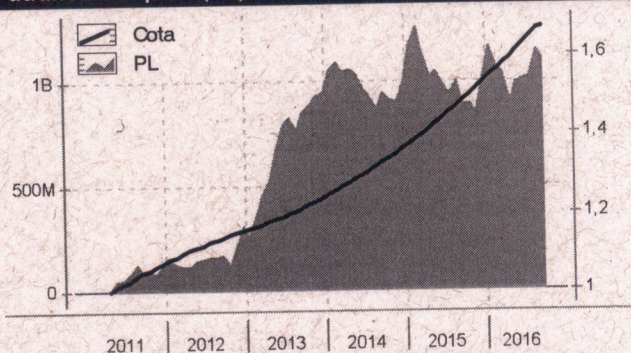
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife
Av. Manoel Borba 488, Cep: 50070-000 , Boa Vista, Recife - PE
Fone/Fax: (81) 3355.1650 / 3355.1647



| Características | |
|--------------------------------|---------------------------------------|
| CNPJ | 13077415000105 |
| Início do Fundo | 28/04/2011 |
| Código Anbima | 272604 |
| Classificação Anbima | Renda Fixa Duração Média Grau de I... |
| Gestão | BB Dvm S.A |
| Custodiante | Banco do Brasil S.A. |
| Administrador | BB Dvm S.A |
| Taxa máx. adm. (%) | 1,00 |
| Taxa performance | - |
| Data da Última Cotação | 08/09/2016 |
| Cota | 1,6669 |
| Patrimônio Líquido (R\$ 000) | 1.102.912 |
| Patrimônio Médio 12m (R\$ 000) | 1.013.751 |
| 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 | 1.000 |
| 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 | CDI |

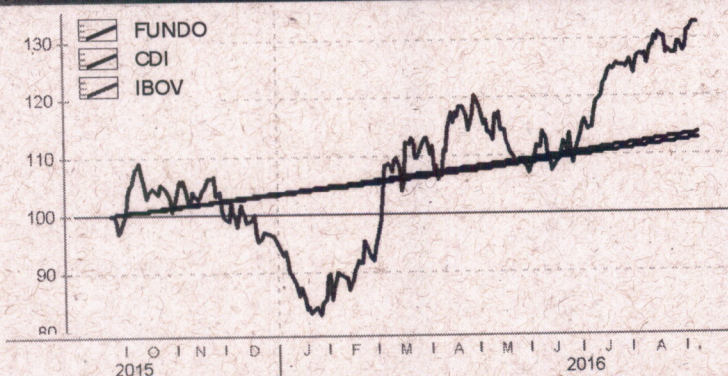
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



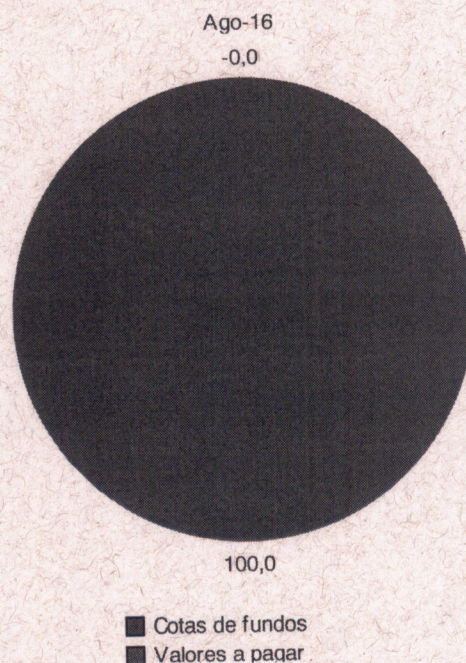
Retornos (%) (até 08/09/2016)

| | abr 2016 | mai 2016 | jun 2016 | jul 2016 | ago 2016 | set 2016 | 2014 | 2015 | 2016 | 12m | 24m | 36m | do início |
|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| ● FUNDO | 0,92 | 1,07 | 1,17 | 1,05 | 1,16 | 0,25 | 9,97 | 12,36 | 8,90 | 13,22 | 26,29 | 38,06 | 66,69 |
| ● CDI | 1,05 | 1,11 | 1,16 | 1,11 | 1,21 | 0,26 | 10,81 | 13,24 | 9,50 | 14,13 | 28,26 | 41,33 | 73,61 |
| ● IBOV | 7,70 | -10,09 | 6,30 | 11,22 | 1,03 | 4,02 | -2,91 | -13,31 | 38,94 | 28,80 | 1,76 | 12,06 | -8,29 |

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 (%) | 1,17 |
| Menor Retorno Mensal (%) | 0,25 |
| Retorno Acumulado (%) | 13,22 |
| Volatilidade | 0,08 |
| Sharpe | -10,25 |
| VAR de 1 mês - 95% (%) | 0,04 |

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.

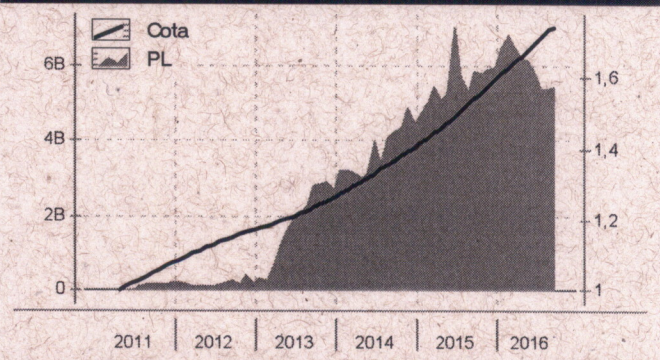
Características

| | |
|--------------------------------|---------------------------------------|
| CNPJ | 13077418000149 |
| Início do Fundo | 28/04/2011 |
| Código Anbima | 272493 |
| Classificação Anbima | Renda Fixa Duração Média Grau de I... |
| Gestão | BB Dsvm S.A |
| Custodiante | Banco do Brasil S.A. |
| Administrador | BB Dsvm S.A |
| Taxa máx. adm. (%) | 0,30 |
| Taxa performance | - |
| Data da Última Cotação | 06/09/2016 |
| Cota | 1,7427 |
| Patrimônio Líquido (R\$ 000) | 5.425.957 |
| Patrimônio Médio 12m (R\$ 000) | 5.970.929 |
| 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 | 1.000 |
| 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 | CDI |

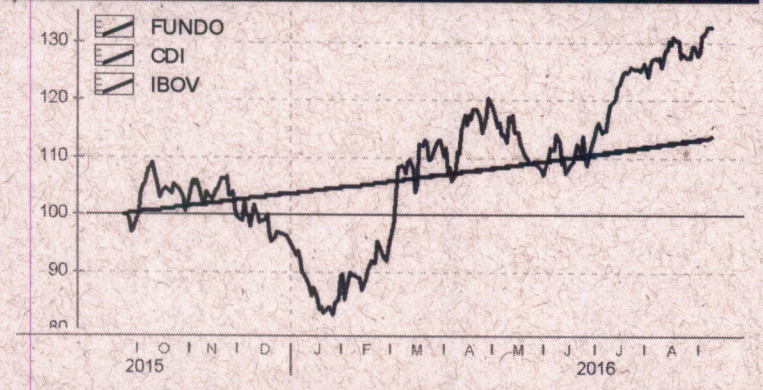
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



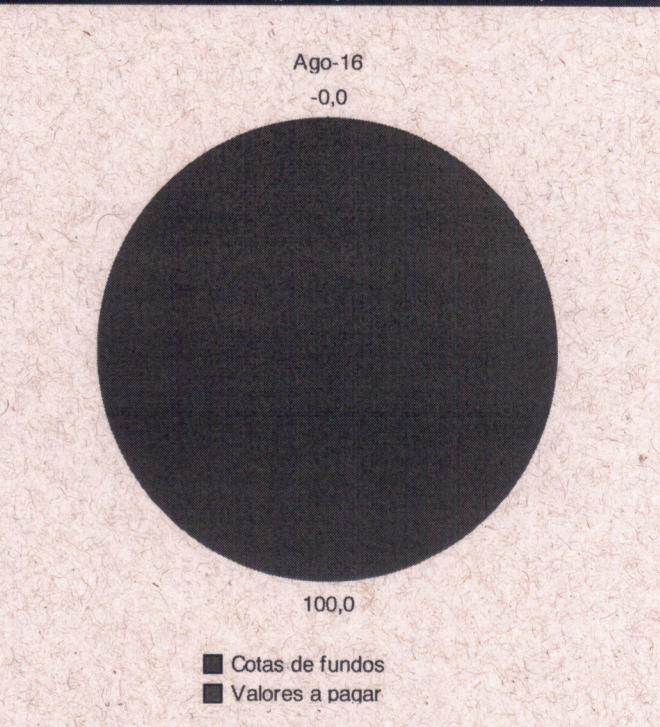
Retornos (%) (até 06/09/2016)

| | abr 2016 | mai 2016 | jun 2016 | jul 2016 | ago 2016 | set 2016 | 2014 | 2015 | 2016 | 12m | 24m | 36m | do início |
|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| ● FUNDO | 0,98 | 1,14 | 1,07 | 1,13 | 1,25 | 0,22 | 11,02 | 13,46 | 9,28 | 14,01 | 28,39 | 41,58 | 74,27 |
| ● CDI | 1,05 | 1,11 | 1,16 | 1,11 | 1,21 | 0,21 | 10,81 | 13,24 | 9,44 | 14,13 | 28,24 | 41,25 | 73,52 |
| ● IBOV | 7,70 | -10,09 | 6,30 | 11,22 | 1,03 | 3,85 | -2,91 | -13,31 | 38,71 | 29,32 | -0,91 | 11,87 | -8,44 |

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 (%) | 1,25 |
| Menor Retorno Mensal (%) | 0,22 |
| Retorno Acumulado (%) | 14,01 |
| Volatilidade | 0,17 |
| Sharpe | -0,68 |
| VAR de 1 mês - 95% (%) | 0,08 |

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.

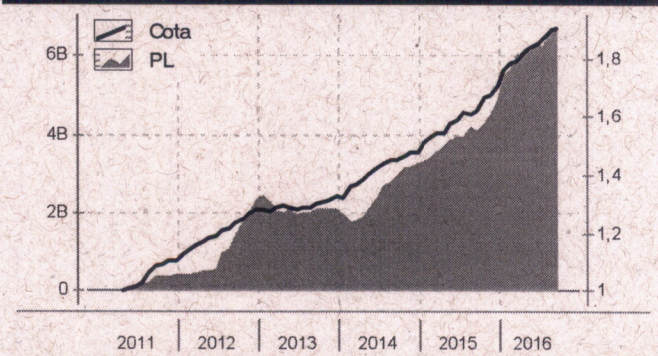
Características

| | |
|--------------------------------|----------------------|
| CNPJ | 13322205000135 |
| Início do Fundo | 28/04/2011 |
| Código Anbima | 272612 |
| 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 | 06/09/2016 |
| Cota | 1,9026 |
| Patrimônio Líquido (R\$ 000) | 6.622.749 |
| Patrimônio Médio 12m (R\$ 000) | 5.724.687 |
| 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 |

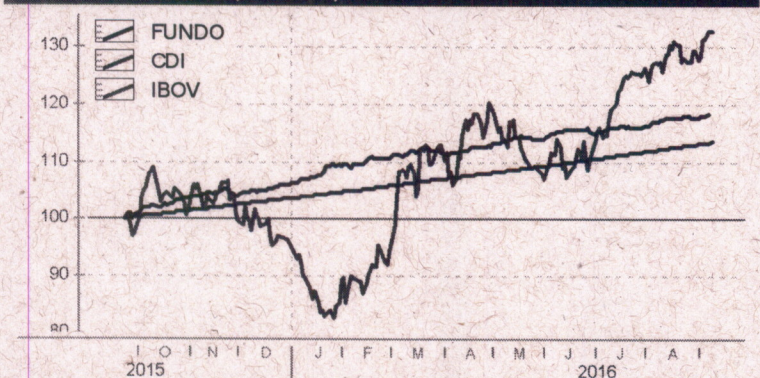
Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



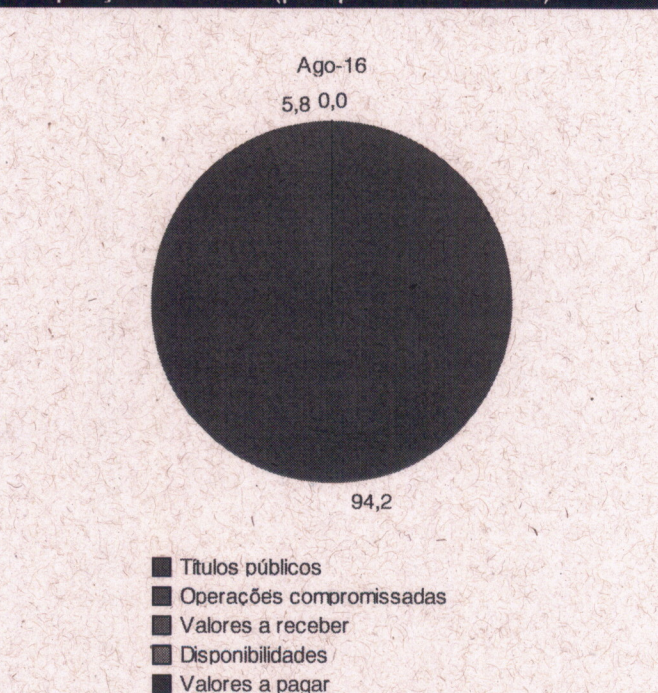
Retornos (%) (até 06/09/2016)

| | abr 2016 | mai 2016 | jun 2016 | jul 2016 | ago 2016 | set 2016 | 2014 | 2015 | 2016 | 12m | 24m | 36m | do início |
|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| ● FUNDO | 1,66 | 0,75 | 0,82 | 1,06 | 1,28 | 0,43 | 11,23 | 15,38 | 11,38 | 18,50 | 30,79 | 47,15 | 90,26 |
| ● CDI | 1,05 | 1,11 | 1,16 | 1,11 | 1,21 | 0,21 | 10,81 | 13,24 | 9,44 | 14,13 | 28,24 | 41,25 | 73,52 |
| ● IBOV | 7,70 | -10,09 | 6,30 | 11,22 | 1,03 | 3,85 | -2,91 | -13,31 | 38,71 | 29,32 | -0,91 | 11,87 | -8,44 |

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 (%) | 3,02 |
| Menor Retorno Mensal (%) | 0,43 |
| Retorno Acumulado (%) | 18,50 |
| Volatilidade | 3,02 |
| Sharpe | 1,28 |
| VAR de 1 mês - 95% (%) | 1,43 |

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.