



PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDORES
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:	162 /2017 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	162 /2017 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	16/11/17
CNPJ: 05.244.336/0001-13	Dispositivo da Resolução do CMN	
Valor:	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	
R\$ 16.000.000,00	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	
Dezessies milhões de reais		
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:		
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:	Resgate	
Valor da operação:	R\$ 11.027.774,95	
Quantidade de Cotas:	5.891.220,12393824	
Valor da Cota (R\$):	R\$ 1,87190000	
Data da Operação:	16/11/2017	
Data de Liquidação:	16/11/2017	
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.299.444.000,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,848653%	
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:	27/10/2017	
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:	27/10/2017	
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A.	
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91	
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	24/10/2017	
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 RECIPIEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações		
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/11/2017	
Outras Observações:	Seguintes operações: a) Recebimento de juros no valor de R\$ 567.250,10, do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO; b) Recebimento de juros no valor de R\$ 4.602.741,68 dos Títulos TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045); c) Recebimento de juros no valor de R\$ 45.000,00, do fundo BB RECEBIVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII; d) Pagamento de folha no valor de R\$ 16.405,79; e) Pagamento de Tarifa de Custódia de Títulos no valor de R\$ 360,94; f) Pagamento da Taxa de Administração relativo ao mês de novembro/2017, no valor de R\$ 226.000,00.		
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:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 16.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	7.322.319,34465242		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,18510000		
Data da Operação:	16/11/2017		
Data de Liquidação:	16/11/2017		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 5.271.472.000,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,303521%		
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:	27/10/2017	
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:	27/10/2017	
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A.	
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91	
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	24/10/2017	
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	14/11/2017
Outras Observações:		
<p>Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</p> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div style="text-align: center;"> <p>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</p> </div> <div style="text-align: center;"> <p>Gestor/Autorizador José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 334.326.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA Validade da Certificação: 03/05/2019</p> </div> </div>		

**SAÚDE
RECIFE**

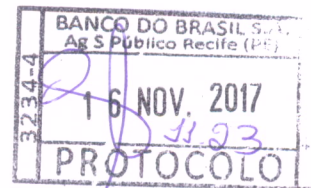
**RECI
PREV**

Recife, 16 de novembro de 2017

Ofício RECIPREV nº 162/2017 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar as seguintes operações:



- a) Resgatar o valor de R\$ 11.027.774,95 (Onze milhões, vinte e sete mil, setecentos e setenta e quatro reais e noventa e cinco centavos), do 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;
- b) Aplicar o valor de R\$ 16.000.000,00 (Dezesseis milhões de reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35, vinculado a conta 7.909-X;
- c) Transferir o valor de R\$ 226.000,00 (Duzentos e vinte e seis mil reais), da conta 7.909-X para a conta 7.897-2, da Autarquia nessa agência;
- d) Transferir o valor de R\$ 150.666,67 (Cento e cinquenta mil, seiscentos e sessenta e seis reais e sessenta e sete centavos), da conta 7.908-1 para a conta 7.897-2, da Autarquia nessa agência;

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 162/2017

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



**PREFEITURA DO
RECIFE**

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

Resgate
SANDRA MARIA GOMES GALINDO
Hoje, 16:14 JOSE MARCOS ALVES DE BARROS; ANNA PAULA ALMEIDA
NUNES E SILVA;

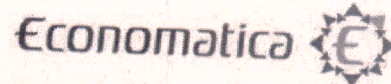
Zé Marcos, boa tarde!

Vimos solicitar o resgate de aplicações financeiras da conta no Banco do Brasil da 7.909-X o valor total de R\$ 17.948,09 (dezesete mil novecentos e quarenta e oito reais e nove centavos), referente a remessa de pagamento para serem transmitidos eletronicamente no dia 16/11/2017 pela EMPREL, competência setembro e outubro/2017 do Fundo Previdenciário Reciprev.

Sandra Galindo

3355-1645

BB Prev RF Fluxo Fc FI



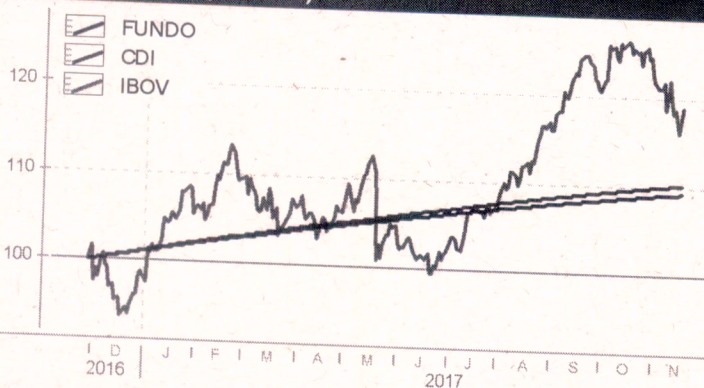
Características

		● FUNDO	● BB Top RF C FI
CNPJ		13077415000105	06006071000188
Início do Fundo		28/04/2011	06/08/2004
Código Anbima		272604	130168
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Baixa Soberano		Renda Fixa Duração Média Grau de Invest.
Gestão		BB DtvM S.A	BB DtvM S.A
Custodiante		Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
Administrador		BB DtvM S.A	BB DtvM S.A
Taxa máx. adm. (%)		1,00	0,00
Taxa performance		-	-
Data da Última Cotação			
Cota		16/11/2017	16/11/2017
Patrimônio Líquido (R\$ 000)		1.8719	20,045
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)		1.299.444	16.209.450
Fundo de cotas		1.248.363	14.762.691
Valor Invest		Sim	Não
Nome do invest		100,01	42,20
Investidor qualificado	BB Top RF Títulos Públicos Federais FI - Cotas d... LFT 210100 2022-09-01 - Operações compromiss...		
Tipo de investidor		Não	Não
Resolução 3792		Não Há Restrição	Reservado
Resolução 3922		Sim	Sim

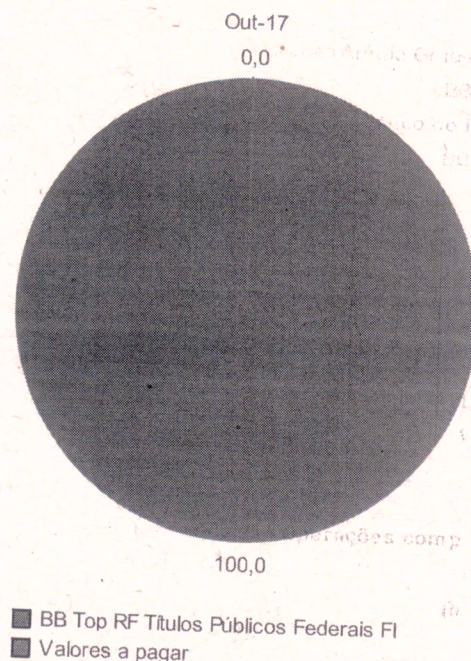
Retornos (%) (até 16/11/2017)

	jun 2017	jul 2017	ago 2017	set 2017	out 2017	nov 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,73	0,71	0,70	0,56	0,56	0,24	12,36	13,11	8,12	9,79	24,25	39,19	87,19
● CDI	0,81	0,80	0,80	0,64	0,64	0,28	13,24	14,00	9,03	10,82	26,40	42,69	97,07
● IBOV	0,30	4,80	7,46	4,88	0,02	-2,42	-13,31	38,94	20,40	19,34	54,79	40,06	10,41

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 (%)	9,79
Volatilidade	0,12
Sharpe	-54,52
VAR de 1 mês - 95% (%)	0,06

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

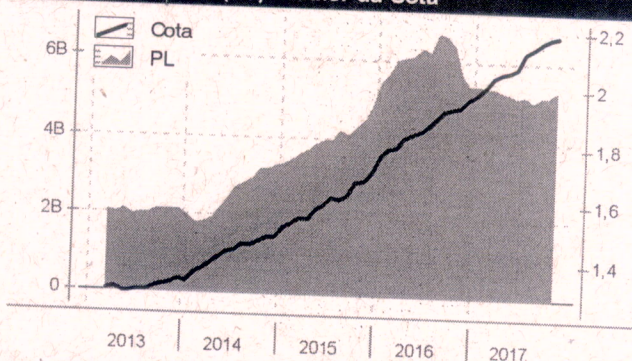
CNPJ	13322205000135
Início do Fundo	28/04/2011
Código Anbima	272612
Classificação Anbima	Renda Fixa Indexados
Gestão	BB DtvM S.A
Custodiante	Banco do Brasil S.A.
Administrador	BB DtvM S.A
Taxa máx. adm. (%)	0,20
Taxa performance	-

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

Data da Última Cotação	16/11/2017
Cota	2,1851
Patrimônio Líquido (R\$ 000)	5.271.472
Patrimônio Médio 12m (R\$ 000)	5.214.286

Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota

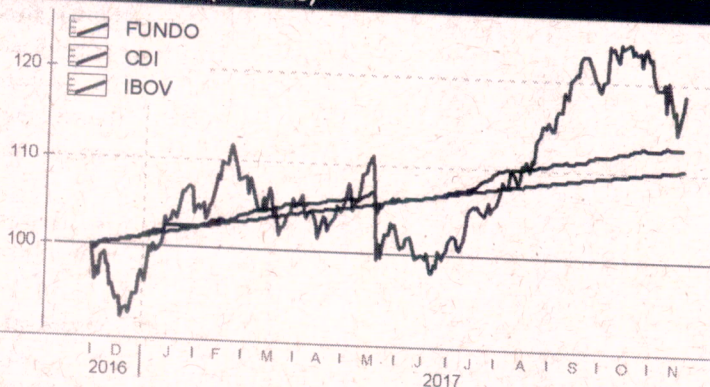


Alavancado	Não
Investimento no Exterior	Não se Aplica
Investidor qualificado	Não
Tipo de investidor	Não Há Restrição
Resolução 3792	Sim
Resolução 3922	Sim

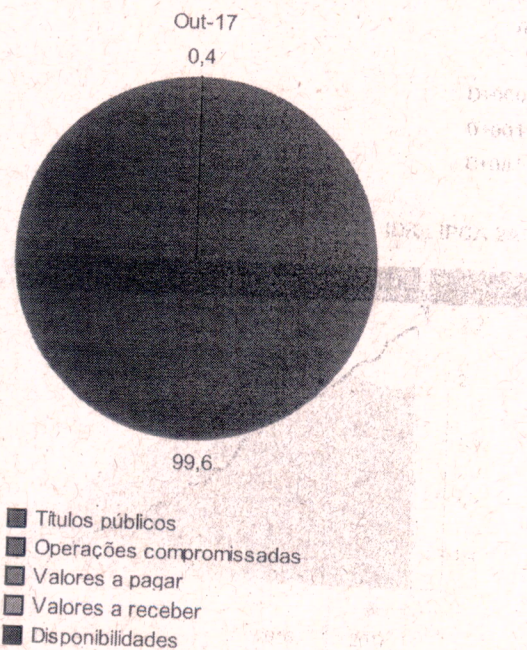
Retornos (%) (até 16/11/2017)

	jun 2017	jul 2017	ago 2017	set 2017	out 2017	nov 2017	2015	2016	2017	12m	24m	36m	do início
● FUNDO	0,61	2,44	0,98	0,86	0,76	0,20	15,38	14,89	11,34	13,95	30,00	49,23	118,51
● CDI	0,81	0,80	0,80	0,64	0,64	0,28	13,24	14,00	9,03	10,82	26,40	42,69	97,07
● IBOV	0,30	4,80	7,46	4,88	0,02	-2,42	-13,31	38,94	20,40	19,34	54,79	40,06	10,41

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 (%)	0,20
Retorno Acumulado (%)	13,95
Volatilidade	2,83
Sharpe	1,02
VAR de 1 mês - 95% (%)	1,33

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.