



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° 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N° 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO: 37 /2014
Unidade Gestora do RPPS: Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	OF. Nº: 37 /2014 – GI
CNPJ: 05.244.336/0001-13	Data: 26/03/2014
VALOR (R\$): R\$ 19.000.000,00 (Dezenove milhões de reais)	Dispositivo da Resolução do CMN: Art. 7º, IV e Art. 7º, I, "b"

HISTÓRICO DA OPERAÇÃO

Descrição da operação: Trata-se de resgate no valor de R\$19.000.000,00 (dezenove milhões de reais) do fundo BB Previdenciário Renda Fixa Perfil Fundo de Investimentos em Cotas de FI CNPJ: 13.077.418/0001-49, e em seguida aplicado no BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos IPCA VI FI CNPJ: 19.523.306/0001-50, a importância total de R\$ 19.000.000,00 (dezenove milhões de reais), autorizadas pelo Comitê de Investimentos de 26.03.2014.

O BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos IPCA VI FI CNPJ: 19.523.306/0001-50, é um fundo composto exclusivamente por títulos NTN-B (Títulos do Governo Federal), com retorno esperado de IMA-B, mas como a sua composição é formada por NTN-B com vencimentos em 2020, 2022 e 2024, espera-se no mínimo IPCA+6% ao ano. Deste modo, o fundo está aderente à meta atuarial do Fundo Previdenciário Reciprev. Trata-se de um fundo novo da BB Gestão de Recursos DTVM S.A, com marcação à mercado dos papéis que compõem o referido fundo.

O BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos IPCA VI FI CNPJ: 19.523.306/0001-50, está aderente à política de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev e encontra-se credenciado. Trata-se de uma boa oportunidade para a carteira de investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev dentro do processo de diversificação e rentabilização no longo prazo previsto na Política de Investimentos.

Por tratar-se de um fundo de longo prazo o BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos IPCA VI FI CNPJ: 19.523.306/0001-50, está sujeito ao Atestado de Compatibilidade de Aplicações de Recursos previsto na Portaria N° 440, de 09 de outubro de 2011, Art. 3º IX § 4º. Referido atestado de compatibilidade encontra-se como anexo desta APR.

Os prazos e valores de retorno do BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos IPCA VI FI CNPJ: 19.523.306/0001-50, são de até 15.08.2024, distribuídos da seguinte forma: NTN-B/2020 R\$ 1.934.200,00 (15.08.2020); NTN-B/2022 R\$ 12.285.400,00 (15.08.2022); NTN-B/2024 R\$ 4.748.100,00 (15.08.2024), e operações compromissadas – 01 dia – recursos utilizados para administração do fundo R\$ 32.200,00.

O BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos IPCA VI FI CNPJ: 19.523.306/0001-50, é do segmento de renda fixa e está enquadrado na Resolução do CMN 3.922 de 25.11.2010, no Art. 7º, I, "b".

CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Renda Fixa – art. 7º, IV

Instituição Financeira: BB Gestão de Recursos DTVM S.A

CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69

Fundo: BB Previdenciário Renda Fixa Perfil Fundo de Investimentos em Cotas de FI

CNPJ do Fundo: 13.077.418/0001-49

Índice de Referência: CDI

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Renda Fixa – art. 7º, I, "b"

Instituição Financeira: BB Gestão de Recursos DTVM S.A

CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69

Fundo: BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos IPCA VI FI

CNPJ do Fundo: 19.523.306/0001-50

Índice de Referência: IMA-B

Patrimônio Líquido do Fundo: R\$ 237.420.151,37

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 8,00% (R\$ 19.000.000,00/R\$ 237.420.151,37)

PROPONENTE:

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

Validade da Certificação: 13/09/2016

GESTOR/AUTORIZADOR CERTIFICAÇÃO/VALIDADE

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

CPF: 334.326.354-00

Entidade Certificadora: ANBIMA

Validade da Certificação: 13/09/2016

RESPONSÁVEL PELA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO:

Márcio Araújo Acioli

Gerente Administrativo e Financeiro

CPF: 111.494.264-20

Recife, 26 de março de 2014

Ofício RECIPREV nº 37/2014 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 19.000.000,00 (dezenove milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTOS EM COTAS DE FI 13.077.418/0001-49, e aplicar o valor de R\$ 19.000.000,00 (dezenove milhões de reais), no BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 19.523.306/0001-50, vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação: APR 37/2014

Atenciosamente,


JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

MÁRCIO ARAUJO ACIOLI
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilma Senhora

Luciana Veloso

Gerente de Negócios

Banco do Brasil S/A Agência Setor Público – Recife/PE

Av. Rio Branco, 240 – 7º Andar – Bairro do Recife

NESTA



PORTARIA MPS Nº 440, DE 09 DE OUTUBRO DE 2013 - DOU DE 11/10/2013

"Art. 3º IX § 4º As aplicações que apresentem prazos para desinvestimento, inclusive prazos de carência e para conversão de cotas de fundos de investimentos, deverão ser precedidas de atestado do responsável legal pelo RPPS, evidenciando a sua compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do regime.

ATESTADO DE COMPATIBILIDADE DE APLICAÇÕES DE RECURSOS

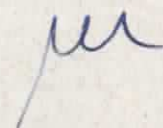
Com base na Portaria MPS Nº 440, de 09 de outubro de 2013, Art. 3º IX § 4º, apresentamos as projeções de despesas, receitas e saldos do Fundo Previdenciário Reciprev até o ano 2029, decorrentes do Estudo Atuarial realizado pela Caixa Econômica Federal em dezembro/2012.

Ano	Qtde. Aposentadorias e Pensões	Despesas Anual	Receitas Anual	Saldos Anual
2013	105	4.147.722,21	94.450.517,51	753.463.837,59
2014	208	7.447.593,90	106.949.581,13	898.173.655,08
2015	335	11.278.350,31	121.342.080,49	1.062.127.804,56
2016	415	13.813.038,94	129.549.004,24	1.241.591.438,13
2017	488	16.582.768,46	134.197.081,97	1.433.701.237,93
2018	565	19.332.173,50	138.868.378,57	1.639.259.517,28
2019	639	21.842.215,88	144.382.548,40	1.860.155.420,83
2020	733	25.350.677,13	148.539.877,43	2.094.953.948,38
2021	855	30.801.192,67	152.156.612,90	2.342.006.603,40
2022	1.018	36.820.152,97	155.667.714,12	2.601.374.560,75
2023	1.215	44.481.316,29	158.822.232,61	2.871.797.950,72
2024	1.529	56.175.458,41	161.713.525,32	3.149.643.894,67
2025	2.120	78.780.163,07	164.035.109,76	3.423.877.475,04
2026	2.580	95.897.616,24	166.371.067,42	3.699.783.574,72
2027	3.018	113.134.417,44	168.438.755,25	3.977.074.927,01
2028	3.413	126.992.298,04	170.513.938,75	4.259.221.063,35
2029	4.618	159.590.213,92	172.235.686,39	4.527.419.799,62

Estudo Atuarial 2012 - realizado pela CEF (Base Dezembro-2012)

Deste modo, as receitas anuais são suficientes para cobrir as despesas anuais no mínimo até o ano de 2029, justificando a realização da aplicação no ativo a seguir por estar compatível com as obrigações presentes e futuras do Fundo Previdenciário Reciprev.





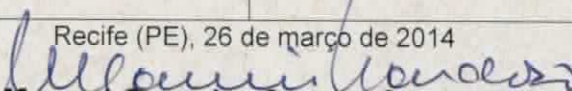


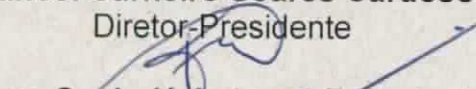
RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS	
Valor da aplicação	R\$ 19.000.000,00 (Dezenove milhões de reais)
Segmento	Renda Fixa
Tipo de Ativo	Renda Fixa - Art 7º, I, "b"
Instituição Financeira	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.
CNPJ da Instituição Financeira	30.822.936/0001-69
Fundo	BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos IPCA VI Fundo de Investimento
CNPJ do Fundo	19.523.306/0001-50
Índice de Referência	IMA-B
Patrimônio Líquido do Fundo	R\$ 237.420.151,37
% do Patrimônio Líquido do Fundo	Posição de 8,00% (R\$ 237.420.151,37/R\$ 19.000.000,00).
% da Aplicação – Política de Investimento Art 7º, I, "b"	A soma de todas as aplicações neste artigo encontra-se enquadrado na Política de Investimento
Prazo da aplicação	Os prazos e valores de retorno do BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos IPCA VI FI CNPJ: 19.523.306/0001-50, são de até 15.08.2024, distribuídos da seguinte forma: NTN-B/2020 R\$ 1.934.200,00 (15.08.2020); NTN-B/2022 R\$ 12.285.400,00 (15.08.2022); NTN-B/2024 R\$ 4.748.100,00 (15.08.2024), e operações compromissadas – 01 dia – recursos utilizados para administração do fundo R\$ 32.200,00.
Justificativas da aplicação	APR Nº 37/2014

Recife (PE), 26 de março de 2014


Manoel Carneiro Soares Cardoso
Diretor-Presidente


Francisco Canindé Antunes Furtado Junior
Diretor Executivo


José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos