



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 Unidade Gestora do RPPS Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 Valor: R\$ 169.419.515,97 Cento e sessenta e nove milhões, quatrocentos e dezenove mil, quinhentos e quinze reais e noventa e sete centavos	Nº / ANO:	091 /2020 - GI	
	OF. Nº:	091 /2020 - GI	
	Data:	10/06/20	
		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL RF LP		
CNPJ do Fundo:	14.504.578/0001-90		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 99.122.303,88		
Quantidade de Cotas:	3.748.630,38451700		
Valor da Cota (R\$):	R\$	26,4422719000	
Data da Operação:	10/06/2020		
Data de Liquidação:	12/06/2020		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.242.111.290,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	7,980%		
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.		
CNPJ do Administrador:	90.400.888/0001-42		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	25/10/2019		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 2.538.035.803,80		
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	0,72%		
Gestor:	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA		
CNPJ do Gestor:	10.231.177/0001-52		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	22/10/2019		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	2.273.292.670,22	
% Recursos do Gestor com RPPS	0,81%		
Empresa de Rating	Moody's		
Conceito	MQ1		
Representação do conceito	Excelente		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim		
Distribuidor:	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA		
CNPJ do Distribuidor:	10.231.177/0001-52		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	22/10/2019		

Data de Início FI:	29/12/2011	
Taxa Administração do FI (%):	0,00	
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	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0 dias	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	1	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Sim	
CNPJ do Fundo:	11.180.605/0001-28	
Segmento:	Renda Variável	
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
% Carteira do Fundo:	1,00	
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 por objetivo investir em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa que busquem acompanhar as variações do Índice de Mercado ANBIMA – IMA-B, por meio da aplicação de seus recursos, preponderantemente, em cotas de fundos de investimento e/ou fundos de investimento em cotas de fundos de investimento.
	Principais riscos do fundo:	Risco de mercado
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,95%	
Retorno Médio Anual	12,01%	
Retorno Total	159,70%	

Maior Retorno	7,11%
Menor Retorno	-7,17%
Qtde. mês Positivo	72
Qtde. mês Negativo	29
Qtde. mês acima do Benchmark	18
Qtde. mês abaixo do Benchmark	83
Risco Mensal Período	2,26%
Risco Mensal 12 MESES	2,97%
Risco Anual do Período	7,84%
Retorno Relativo ao Benchmark	-3,14%
Sharpe	0,35
Information Ratio	-2,01
Tracking Error	0,21%
VAR HISTÓRICO (95%)	4,70%
VAR 12 MESES (95%)	4,26%
Sharpe Modificado	0,39
Beta (12 meses)	0,93
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,07%
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 Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos 10/06/2020
Outras Observações:	
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo

O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI
CNPJ do Fundo:	26.507.132/0001-06
Segmento:	FI Renda Fixa - Geral
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
Tipo de operação realizada:	Resgate
Valor da operação:	R\$ 70.297.212,09
Quantidade de Cotas:	5.532.038,68290203
Valor da Cota (R\$):	R\$ 12,7072886000
Data da Operação:	10/06/2020
Data de Liquidação:	12/06/2020
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.042.871.660,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	6,741%
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A. 3234-4 7.909-X
Administrador:	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.
CNPJ do Administrador:	90.400.888/0001-42
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	25/10/2019
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 2.538.035.803,80
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	0,72%
Gestor:	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA
CNPJ do Gestor:	10.231.177/0001-52
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	22/10/2019
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$ 2.273.292.670,22
% Recursos do Gestor com RPPS	0,81%
Empresa de Rating	Moody's
Conceito	MQ1
Representação do conceito	Excelente
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Sim
Distribuidor:	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA
CNPJ do Distribuidor:	10.231.177/0001-52
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	22/10/2019
Data de Início FI:	09/05/2017
Taxa Administração do FI (%):	0,00
Índice de Referência do FI :	IPCA
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
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve realizar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado
Carência (dias):	0 dias
Data Listagem Bolsa:	Não listado
Resgate (dias):	1
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Sim
CNPJ do Fundo:	07.966.986/0001-06;13.455.197/0001-03;11.180.605/0001-28
Segmento:	Renda Variável
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
% Carteira do Fundo:	90,82%;8,89%; 0,33%
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 por objetivo buscar superar o IPCA no longo prazo, investindo em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa relacionados à variação das taxas de juros (pós ou pré-fixados), de índices de preços, ou ambos, excluindo estratégias que impliquem em risco de moeda estrangeira e/ou de renda variável, por meio da aplicação de seus recursos, preponderantemente, em cotas de fundos de investimento e/ou fundos de investimento em cotas de fundos de investimento.	
	Principais riscos do fundo:	Risco de mercado	
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio	
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo		
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior			
Retorno Médio Mensal	0,64%		
Retorno Médio Anual	8,01%		
Retorno Total	26,00%		
Maior Retorno	2,25%		
Menor Retorno	-2,09%		
Qtde. mês Positivo	32		
Qtde. mês Negativo	4		
Qtde. mês acima do Benchmark	27		
Qtde. mês abaixo do Benchmark	9		
Risco Mensal Período	0,77%		
Risco Mensal 12 MESES	0,80%		
Risco Anual do Período	2,67%		
Retorno Relativo ao Benchmark	14,75%		
Sharpe	0,64		
Information Ratio	1,54		
Tracking Error	3,15%		
VAR HISTÓRICO (95%)	1,91%		
VAR 12 MESES (95%)	1,99%		
Sharpe Modificado	0,77		
Beta (12 meses)	-0,31		
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,98%		
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 Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações		
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	10/06/2020	
Outras Observações:			
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco			
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"			
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não		
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não		
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não		
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não		
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não		
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não		
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco			
Art. 7º, VII, "a"			
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo		
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo		
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo		
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo		
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo		

Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco
Art. 8º, IV, "a"

O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo

Fundo:	SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS		
CNPJ do Fundo:	13.455.117/0001-01		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 99.419.515,97		
Quantidade de Cotas:	#VALOR!		
Valor da Cota (R\$):	25,9835263000		
Data da Operação:	12/06/2020		
Data de Liquidação:	12/06/2020		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 1.030.335.040,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	9,649%		
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%		
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
Administrador:	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.		
CNPJ do Administrador:	90.400.888/0001-42		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	25/10/2019		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 2.538.035.803,80		
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de	0,72%		
Gestor:	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA		
CNPJ do Gestor:	10.231.177/0001-52		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	22/10/2019		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	2.273.292.670,22	
% Recursos do Gestor com RPPS	0,81%		
Empresa de Rating	Moody's		
Conceito	MQ1		
Representação do conceito	Excelente		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos	Sim		
Distribuidor:	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA		
CNPJ do Distribuidor:	10.231.177/0001-52		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	22/10/2019		
Data de Início FI:	06/09/2011		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		
Índice de Referência do FI :	IMA-B 5		
Tx Performance do FI (%):	Não possui		
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance	Não possui		
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve	Não possui		
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado		

Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0 dias	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	1	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Sim	
CNPJ do Fundo:	13.455.148/0001-62	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
% 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 buscará alcançar o seu objetivo por meio da aplicação dos recursos de sua carteira de investimentos, preponderantemente, em cotas de fundos de investimento, que prevejam na composição de sua carteira, ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa atrelados à variação dos índices de preços e/ou das taxas de juros.
	Principais riscos do fundo:	Variação do cupom de IPCA e demais riscos conforme regulamento
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos =	Curto Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,91%	
Retorno Médio Anual	11,52%	
Retorno Total	157,19%	
Maior Retorno	3,10%	
Menor Retorno	-1,75%	
Qtde. mês Positivo	93	
Qtde. mês Negativo	11	
Qtde. mês acima do Benchmark	14	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	90	
Risco Mensal Período	0,86%	
Risco Mensal 12 MESES	1,38%	
Risco Anual do Período	2,97%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-1,58%	
Sharpe	0,74	
Information Ratio	-2,44	
Tracking Error	0,08%	
VAR HISTÓRICO (95%)	2,33%	
VAR 12 MESES (95%)	2,16%	
Sharpe Modificado	1,03	
Beta (12 meses)	0,80	
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,03%	
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 Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Data da reunião do Comitê de Investimentos : 10/06/2020	
Outras Observações:		
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, VII, "a"		
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo	

Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco
Art. 8º, IV, "a"

O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo



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
CPA 20 e CEA
Validade da Certificação: 05/12/2020

GESTOR / ADMINISTRADOR
José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos
CPF: 334.326.354-00
Entidade Certificadora: ANBIMA
CPA 20 e CEA
Validade da Certificação: 21/11/2021

 ASSINADO DIGITALMENTE POR
JOSE MARCOS ALVES DE BARROS
CPF: 334.326.354-00 DATA: 19/06/2020 08:55
 LOCAL: RECIFE-PE

REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

 ASSINADO DIGITALMENTE POR
ANDRESON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA
CPF: 052.430.264-25 DATA: 19/06/2020 09:26
 LOCAL: RECIFE-PE

REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

Período de “Quarentena”- Corona Vírus
(Covid-19)



Recife, 10 de junho de 2020

Ofício nº 091/2020 GI

Ilmo Senhor
**Wellington Nunes
Santander**
Nesta

Gerente

Solicitamos efetuar as seguintes operações em nome do cotista: FUNDOPREVIDENCIÁRIO RECIPREV CNPJ: 07.749.668/0001-85:

- a) Resgate total do fundo SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL RF LP CNPJ: 14.504.578/0001-90;
- b) Resgate total do fundo SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI CNPJ: 26.507.132/0001-06;
- c) Aplicar o valor decorrente do resgate total do fundo SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL RF LP e a diferença entre o resgate total do fundo SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI e R\$ 70.000.000,00 e aplicar tudo no fundo SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF CNPJ: 13.455.117/0001-01.

Na oportunidade, pedimos encaminhar TED com os dados a seguir, após os resgates e no dia 12/06/2020:

Banco: Banco do Brasil S. A.
Agência: 3434-4
Conta Corrente: 7.909-X
Favorecido: FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV
CNPJ: 07.749.668/0001-85
Valor: R\$ 70.000.000,00 (Setenta milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 091//2020


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

ELCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO



PREFEITURA DO
RECIFE

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - AMPASS
Av. Manoel Borba 488, CEP:50070-000, Boa Vista, Recife – PE
Fone: (81) 3355-1650 / 3355-1647
www.reciprev.gov.pe.br

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 26.507.132/0001-06	Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00
Gestão: Santander Brasil Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00
Administrador: Banco Santander	Saldo Mínimo: R\$ 10.000,00
Taxa de Administração: 0,40%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 440264	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du
Início do Fundo: 09/05/2017	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	27,07	1,83	8,42	20,34	26,07	0,48	0,44	0,09	0,27	0,34	0,40	0,19	1,75	1,79	-0,37	0,99	2,25
% do CDI	128,81	112,23	175,94	177,06	129,91	204,94	156,05	27,22	90,55	90,75	107,64	48,88	364,64	385,21	-74,56	174,41	480,92
CDI	21,02	1,63	4,79	11,49	20,07	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	42,86	-18,12	-4,32	29,81	51,62	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	45,42	-17,88	-3,20	32,88	54,11	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	18,90	2,91	6,33	14,21	19,83	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	12,7072886	1.042.871,66	599.295,40	2,01%	-1,64%	0,95%	3,04	2,00%	1,79%	-0,37%	6
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

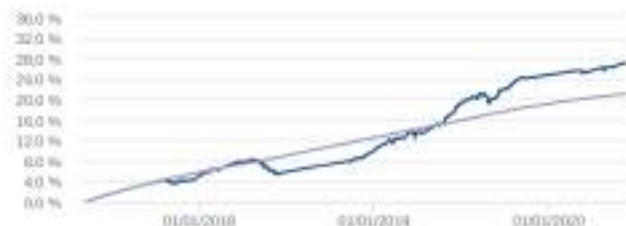
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 10/05/2017 a 10/06/2020 (mensal)



Retorno Acumulado - 10/05/2017 a 10/06/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 10/05/2017 a 10/06/2020 (diária)



Risco x Retorno - 10/05/2017 a 10/06/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 10/05/2017 a 10/06/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 10/05/2017 a 10/06/2020 (mensal)



Composição da Carteira mai/2020

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

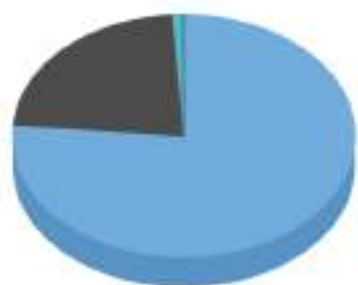
:: SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA

10/06/2020

Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	76,55	0,09	99,52	264,93	100,65	264,93	100,65	264,93	100,65	-	
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22,58	0,50	550,08	168,21	146,47	168,21	146,47	168,21	146,47	-	
SANTANDER IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92	1,78	1.959,88	264,68	165,61	264,68	165,61	264,68	165,61	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	
Cotas de Fundos	100,05%	100,03%	100,04%	100,08%	100,03%	100,03%	100,06%	100,03%	
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Valores a pagar	-0,05%	-0,04%	-0,04%	-0,08%	-0,03%	-0,03%	-0,06%	-0,03%	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	994.985,52	871.769,86	877.373,79	889.776,36	853.720,75	687.082,65	536.156,16	476.037,70	
Data da Divulgação	09/06/2020	18/05/2020	30/04/2020	06/03/2020	07/02/2020	08/01/2020	06/12/2019	08/11/2019	

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)									mai/2020
--	--	--	--	--	--	--	--	--	----------



Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	76,55 %
Cotas de SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22,58 %
Cotas de SANTANDER IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92 %
Outros Valores a pagar	-0,05 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 14.504.578/0001-90	Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00
Gestão: Santander Brasil Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00
Administrador: Banco Santander	Saldo Mínimo: R\$ 10.000,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,20%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 294081	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du
Início do Fundo: 29/12/2011	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	164,42	-2,25	6,70	35,04	46,68	1,49	1,26	-7,17	0,43	0,24	1,98	-2,48	3,34	2,84	-0,43	1,26	3,71
% do CDI	147,88	-138,00	140,11	304,99	232,59	633,91	441,08	-2.117,86	145,45	64,31	528,68	-651,13	696,77	613,41	-85,79	221,28	790,60
CDI	111,19	1,63	4,79	11,49	20,07	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	66,84	-18,12	-4,32	29,81	51,62	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	102,84	-17,88	-3,20	32,88	54,11	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	65,13	2,91	6,33	14,21	19,83	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	26,4422719	1.242.111,29	1.218.567,68	12,38%	-12,93%	5,88%	4,30	12,37%	3,34%	-7,17%	7
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

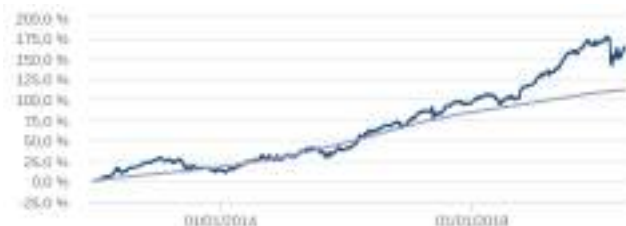
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

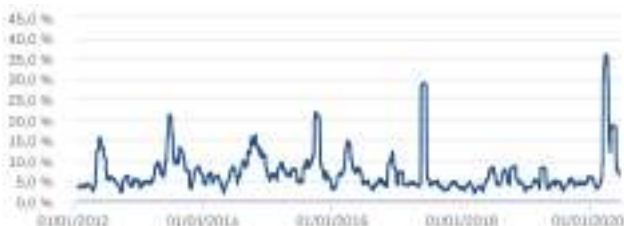
Retorno Mensal - 30/12/2011 a 10/06/2020 (mensal)



Retorno Acumulado - 30/12/2011 a 10/06/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 30/12/2011 a 10/06/2020 (diária)



Risco x Retorno - 30/12/2011 a 10/06/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 30/12/2011 a 10/06/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 30/12/2011 a 10/06/2020 (mensal)



Composição da Carteira

mai/2020

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

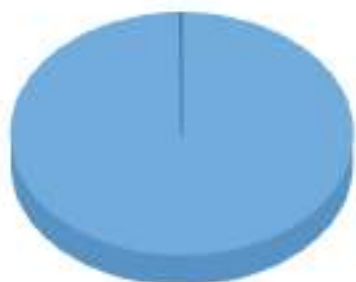
:: SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP

10/06/2020

Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
SANTANDER IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	100,01	1,78	1.959,88	264,68	165,61	264,68	165,61	264,68	165,61	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)										
Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19		
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,00%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%
Valores a receber	0,08%	0,00%	1,01%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,24%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,09%	-0,01%	-1,02%	-0,02%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,26%	-0,01%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.300.485,93	1.212.263,39	1.314.979,65	1.413.979,78	1.294.763,18	1.008.932,51	1.030.045,61	1.516.704,22		
Data da Divulgação	09/06/2020	09/05/2020	30/04/2020	06/03/2020	07/02/2020	08/01/2020	06/12/2019	08/11/2019		

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)									
mai/2020									



■ Cotas de SANTANDER IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	100,01 %
■ Outros Valores a pagar	-0,09 %
■ Outros Valores a receber	0,08 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 13.455.117/0001-01	Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00
Gestão: Santander Brasil Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00
Administrador: Banco Santander	Saldo Mínimo: R\$ 10.000,00
Taxa de Administração: 0,10%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,20%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 286028	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du
Início do Fundo: 06/09/2011	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Fundo	159,84	2,33	9,00	24,69	36,11	2,13	0,49	-1,75	0,62	0,54	1,22	-0,30	1,63	1,72	0,03	0,95	1,70
% do CDI	134,99	142,04	188,69	215,18	180,18	902,12	170,33	-516,30	211,94	143,54	324,64	-79,18	340,67	371,12	6,19	167,60	363,14
CDI	118,40	1,64	4,77	11,47	20,04	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47
Ibovespa	63,93	-19,76	-5,62	28,33	47,40	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06
IBX	107,28	-19,50	-4,52	31,39	49,85	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10
IGP-M	67,54	2,93	6,30	14,12	19,89	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	25,9835263	1.030.335,04	1.241.170,35	4,98%	-5,40%	2,36%	0,75	4,98%	2,13%	-1,75%	8
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,57%	0,24%	0

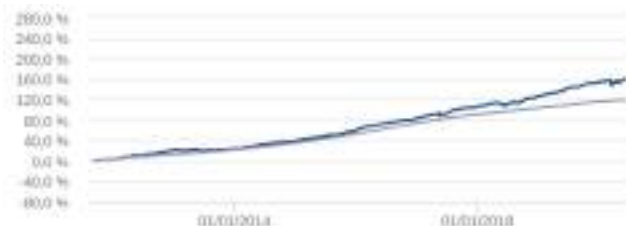
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 08/09/2011 a 12/06/2020 (mensal)



Retorno Acumulado - 08/09/2011 a 12/06/2020 (diária)



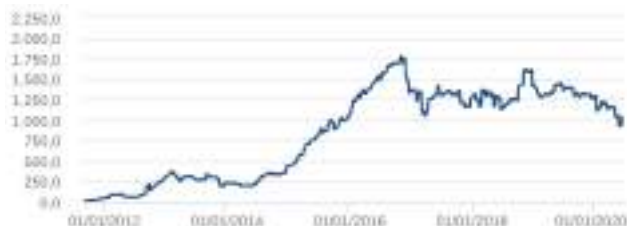
Volatilidade Anualizada - 08/09/2011 a 12/06/2020 (diária)



Risco x Retorno - 08/09/2011 a 12/06/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 08/09/2011 a 12/06/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 08/09/2011 a 12/06/2020 (mensal)



Composição da Carteira

mai/2020

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

:: SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA

12/06/2020

Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	100,05	0,32	317,12	162,46	137,21	162,46	137,21	162,46	137,21	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	
Cotas de Fundos	100,05%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,04%	100,01%	
Valores a receber	0,00%	0,11%	0,02%	0,01%	0,12%	0,00%	0,00%	0,00%	
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Valores a pagar	-0,03%	-0,12%	-0,03%	-0,02%	-0,12%	-0,01%	-0,04%	-0,01%	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	919.402,11	1.142.331,14	1.150.828,12	1.191.923,04	1.150.142,38	1.270.875,32	1.298.833,75	1.319.606,23	
Data da Divulgação	09/06/2020	09/05/2020	30/04/2020	06/03/2020	07/02/2020	08/01/2020	06/12/2019	08/11/2019	

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)									mai/2020

■ Cotas de SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	100,05 %
■ Outros Valores a pagar	-0,03 %
■ Outros Valores a receber	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %