



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 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:	153 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	153 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	18/06/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 30.000.000,00	Fundos de Ações em geral - Art. 8º, II, "a"		
Trinta milhões de reais			
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES		
CNPJ do Fundo:	02.436.763/0001-05		
Segmento:	FI de Ações - Geral		
Tipo de Ativo:	Fundos de Ações em geral - Art. 8º, II, "a"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 30.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	1.116,87517757		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 26.860,65605		
Data da Operação:	18/06/2019		
Data de Liquidação:	19/06/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	685.279.340,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	4,378%		
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:	14/11/2018		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 2.639.334.329,40		
% 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.	0,87%		
Gestor:	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA		
CNPJ do Gestor:	10.231.177/0001-52		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	14/11/2018		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	2.463.844.541,47	
% Recursos do Gestor com RPPS	0,96%		
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:	14/11/2018		

Data de Início FI:	03/04/1998	
Taxa Administração do FI (%):	2,50	
Índice de Referência do FI :	IBOVESPA	
Tx Performance do FI (%):	0,20	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	IBOVESPA	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	100,00	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	SIM	
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):	4	
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:	15.323.164/0001-27	
Segmento:	Renda Variável	
Tipo de Ativo:	Fundos de Ações em geral - Art. 8º, II, "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 obter rentabilidade que busque acompanhar as variações superiores ao desempenho do Índice da Bolsa de Valores de São Paulo – IBOVESPA por meio da aplicação dos recursos da sua carteira de investimentos, preponderantemente, em cotas de fundos de investimento classificados como "Ações". A rentabilidade do FUNDO variará conforme o comportamento do IBOVESPA, sendo também impactada pelos custos e despesas do FUNDO e da taxa de administração de 2,5% (dois inteiros e cinco décimos por cento) ao ano, que corresponde à taxa de administração máxima do FUNDO. Para analisar o impacto das despesas do FUNDO na rentabilidade obtida o investidor deve consultar o item 9 da Lâmina de Informações Essenciais. Tal objetivo de investimento não constitui garantia ou promessa de rentabilidade pelo ADMINISTRADOR
	Principais riscos do fundo:	Perda em decorrência da desvalorização das ações (Risco: 5)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Alto
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	0,73%	
Retorno Médio Anual	9,08%	
Retorno Total	107,80%	

Maior Retorno	11,43%
Menor Retorno	-11,26%
Qtde. mês Positivo	56
Qtde. mês Negativo	45
Qtde. mês acima do Benchmark	57
Qtde. mês abaixo do Benchmark	44
Risco Mensal Período	4,86%
Risco Mensal 12 MESES	5,41%
Risco Anual do Período	16,84%
Retorno Relativo ao Benchmark	48,42%
Sharpe	-0,06
Information Ratio	0,65
Tracking Error	7,69%
VAR HISTÓRICO (95%)	8,84%
VAR 12 MESES (95%)	10,20%
Sharpe Modificado	-0,06
Beta (12 meses)	0,91
Erro Quadrático Médio (EQM)	2,24%
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 Prvidência 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 12/06/2019
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

<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>
<p>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?</p>	<p>Pergunta não se aplica ao fundo</p>
<p>Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</p> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">PROPONENTE</p> <p style="text-align: center;">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</p> </div> <div style="width: 45%;"> <p style="text-align: center;">GESTOR/AUTORIZADOR</p> <p style="text-align: center;">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</p> </div> </div>	

Recife, 18 de junho de 2019

Ofício RECIprev nº 153/2019 – GI

Prezados (as) Senhores (as),

Solicitamos efetuar a aplicação em nome do cotista: **FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIprev CNPJ: 07.749.668/0001-85**; no valor de R\$ 30.000.000,00 (Trinta milhões de reais), no fundo SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES CNPJ: 02.436.763/0001-05.

Na oportunidade, informamos que foi encaminhado TED nesta data através do Banco do Brasil S.A., Agência 3234-4, conta corrente 7.909-X, com os dados a seguir:

Banco: Banco Santander (033)
Agência: 3084
Conta Corrente: 13000288-7
Favorecido: SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES
CNPJ: 02.436.763/0001-05
Valor: R\$ 30.000.000,00 (Trinta milhões de reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 153/2019


Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilmos Sr.
Wellington Nunes Passos Júnior
Banco Santander
Recife - Pe

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

Executado em 18/06/2019
REC

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores - Reciprev / Saúde Recife
CNPJ: 07.749.668/0001-85
CNPJ: 02.436.763/0001-05



Recife, 18 de junho de 2019

Ofício RECIPREV nº 4A/2019 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos efetuar a TED a seguir vinculado à conta 7.909-X:

Banco: Banco Santander (033)
Agência: 3084
Conta Corrente: 13000288-7
Favorecido: SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES
CNPJ: 02.436.763/0001-05
Valor: R\$ 30.000.000,00 (Trinta milhões de reais)

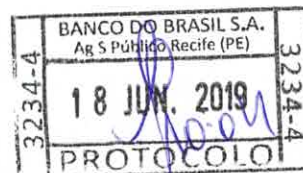
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 153/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

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



Características	Informações Operacionais
CNPJ: 02.436.763/0001-05	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: Santander Brasil Asset Management	Aplicação Adicional: R\$ 100,00
Administrador: Banco Santander	Saldo Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração: 2,00%	Resgate Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração (Máxima): 2,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Ações Valor/Crescimento	Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
Código de Referência: 53872	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du
Início do Fundo: 03/04/1998	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18
Fundo	2.586,07	13,40	43,49	63,08	108,99	1,32	1,98	-0,24	-1,86	8,81	0,41	2,18	11,43	3,97	-5,72	9,21	-5,01
% do CDI	167,79	458,57	679,81	435,25	369,54	243,16	381,25	-51,92	-377,21	1.621,92	83,40	441,90	2.105,70	849,14	-1.008,75	1.699,03	-967,36
CDI	1.541,28	2,92	6,40	14,49	29,49	0,54	0,52	0,47	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52
ibovespa	762,16	14,13	43,67	62,23	101,98	0,70	0,98	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20
IBX	1.731,77	14,75	45,45	62,83	104,01	1,14	1,06	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19
IGP-M	397,01	3,74	6,70	12,77	13,43	0,45	0,92	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	26.860.656054	685.279,34	623.858,90	20,84%	-11,22%	9,90%	-38,47	20,84%	11,43%	-5,72%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 06/04/1998 a 19/06/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 06/04/1998 a 19/06/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 06/04/1998 a 19/06/2019 (diária)

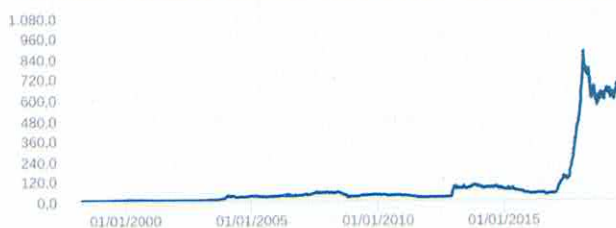


Risco x Retorno - 06/04/1998 a 19/06/2019 (diária)



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.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 06/04/1998 a 19/06/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 06/04/1998 a 19/06/2019 (mensal)



Composição da Carteira

mai/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses PL Médio
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
SANTANDER VALOR FI AÇÕES	99,94	3,14	978,68	186,87	200,61	186,87	200,61	186,87	200,61	-	R\$ 1.189.008.086,2

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18
Cotas de Fundos	99,94%	99,96%	99,97%	99,85%	99,92%	100,42%	99,95%	99,86%
Valores a receber	0,47%	0,38%	0,26%	0,37%	0,44%	1,36%	1,25%	1,27%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,41%	-0,34%	-0,23%	-0,22%	-0,36%	-1,78%	-1,20%	-1,13%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	634.761,82	632.078,52	628.242,67	637.184,92	656.052,04	610.979,79	627.746,06	624.811,72
Data da Divulgação	07/06/2019	08/05/2019	05/04/2019	12/03/2019	07/02/2019	08/01/2019	06/12/2018	07/11/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

mai/2019

■ Cotas de SANTANDER VALOR FI AÇÕES	99,94 %
■ Outros Valores a receber	0,47 %
■ Outros Valores a pagar	-0,41 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %

