



**RECIFE**  
PREFEITURA DA CIDADE



**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 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<br><br>Unidade Gestora do RPPS<br>Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores<br>CNPJ: 05.244.336/0001-13<br>Valor: | Nº / ANO:   | 049 /2018 - GI |         |
|  | OF. Nº:   | 049 /2018 - GI |         |
|  | Data:   | 20/02/18       |         |
| R\$ 6.500.000,00   | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"  |                |         |
| Seis milhões e quinhentos mil reais  | FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"  |                |         |
| <b>HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:</b>   |   |                |         |
| 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 Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"  |                |         |
| Tipo de operação realizada:  | Resgate   |                |         |
| Valor da operação:   | R\$ 6.499.681,43  |                |         |
| Quantidade de Cotas:   | 3.422.866,62278161  |                |         |
| Valor da Cota (R\$):   | R\$ 1,89890000  |                |         |
| Data da Operação:  | 20/02/2018  |                |         |
| Data de Liquidação:  | 20/02/2018  |                |         |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):   | R\$ 1.380.977.000,00  |                |         |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo:  | 0,470658%   |                |         |
| 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 Renda Fixa - Geral - 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 RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações  |  |         |
|   | Data da reunião do Comitê de Investimentos   | 23/01/2018   |         |
| Outras Observações:   |  |  |         |
| Fundo:  | SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF   |  |         |
| CNPJ do Fundo:  | 13.455.117/0001-01   |  |         |
| Segmento:   | Renda Fixa   |  |         |
| Tipo de Ativo:  | FI 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"   |  |         |
| Tipo de operação realizada:   | Aplicação  |  |         |
| Valor da operação:  | R\$ 6.500.000,00   |  |         |
| Quantidade de Cotas:  | 312.605,20367431   |  |         |
| Valor da Cota (R\$):  | R\$ 20,79300000  |  |         |
| Data da Operação:   | 20/02/2018   |  |         |
| Data de Liquidação:   | 20/02/2018   |  |         |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):  | R\$ 1.175.524.000,00   |  |         |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo:   | 0,552945%  |  |         |
| 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:   | 20/11/2017   |  |         |
| Gestor:   | SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA   |  |         |
| CNPJ do Gestor:   | 10.231.177/0001-52   |  |         |
| Data do Termo de Credenciamento do Gestor:  | 20/11/2017   |  |         |
| Distribuidor:   | SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA   |  |         |
| CNPJ do Distribuidor:   | 10.231.177/0001-52   |  |         |
| Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:  | 20/11/2017   |  |         |
| Data de Início FI:  | 06/09/2011   |  |         |
| Taxa Administração do FI (%):   | 0,20   |  |         |
| Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:   | Dispensado   |  |         |
| 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 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:   | Sim  |   |
| CNPJ do Fundo:  | 13.455.148/0001-62   |   |
| Segmento:   | Renda Fixa   |   |
| Tipo de Ativo:  | FI 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 do fundo (Risco: 3)  |
|   | Risco do Fundo atribuído pelo Administrador  | Risco Médio   |
| 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   | 23/01/2018  |
| Outras Observações:   |  |   |
| Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)  | <p style="text-align: center;"> <b>PROponente</b><br/> <b>Andreson Carlos Gomes de Oliveira</b><br/> Chefe de Divisão de Investimentos<br/> CPF: 052.430.264-25<br/> Entidade Certificadora: ANBIMA<br/> Validade da Certificação: 04/02/2018 </p> <p style="text-align: center;"> <b>Gestor Autorizador</b><br/> <b>José Marcos Alves de Barros</b><br/> Gerente de Investimentos<br/> CPF: 334.326.354-00<br/> Entidade Certificadora: ANBIMA<br/> Validade da Certificação: 03/05/2019 </p> |   |

**SAÚDE  
RECIFE**

**RECI  
PREV**

Recife, 20 de fevereiro de 2018

**Ofício RECIPREV nº 049/2018 – 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\$ 6.500.000,00 (Seis milhões e quinhentos mil reais), no fundo Santander FIC FI IMA-B 5 Renda Fixa Crédito Privado CNPJ: 13.455.117/0001-01.

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: Santander (033)  
Agência: 2281  
Conta Corrente: 13001615-6  
Favorecido: Santander FIC FI IMA-B 5 Renda Fixa Crédito Privado  
CNPJ: 13.455.117/0001-01  
Valor: 6.500.000,00 (Seis milhões e quinhentos mil reais)

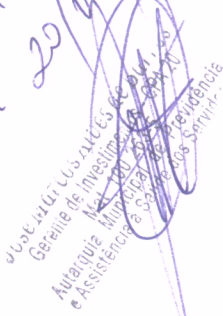
Justificativa da aplicação ou resgate: APR 049/2018

Atenciosamente,

  
**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
**FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR**  
Diretor Executivo

Prezados (as) Senhores (as)  
Cristhian José Pedrosa de Oliveira/Wellington Nunes Passos  
Júnior/Fátima Sorbello  
**Santander Brasil Gestão de Recursos Ltda**  
Nesta

*Examinado por eu  
em 20/02/2018*  


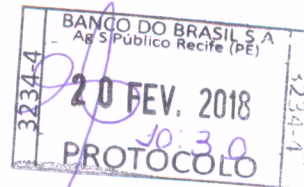
  
**PREFEITURA DO  
RECIFE**

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

**SAÚDE  
RECIFE**

**RECI  
PREV**

Recife, 20 de fevereiro de 2018



**Ofício RECIPREV nº 8A/2018 – GI**

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 6.499.681,43 (Seis milhões, quatrocentos e noventa e nove mil, seiscentos e oitenta e um reais e quarenta e três centavos), no 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, e efetuar a TED conforme a seguir:

Banco: Santander (033)  
Agência: 2281  
Conta Corrente: 13001615-6  
Favorecido: Santander FIC FI IMA-B 5 Renda Fixa Crédito Privado  
CNPJ: 13.455.117/0001-01  
Valor: R\$ 6.500.000,00 (Seis milhões e quinhentos mil reais)

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 049/2018

Atenciosamente,

  
**JOSÉ MARGOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
**FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR**  
DIRETOR EXECUTIVO

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



**PREFEITURA DO  
RECIFE**

## 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 Dtvn S.A                       | BB Dtvn S.A                              |
| Custodiante                    | Banco do Brasil S.A.              | Banco do Brasil S.A.                     |
| Administrador                  | BB Dtvn S.A                       | BB Dtvn S.A                              |
| Taxa máx. adm. (%)             | 1,00                              | 0,00                                     |
| Taxa performance               | -                                 | -  |
| Data da Última Cotação         | 21/02/2018                        | 21/02/2018                               |
| Cota                           | 1,8989                            | 20,396                                   |
| Patrimônio Líquido (R\$ 000)   | 1.380.977                         | 15.477.226                               |
| Patrimônio Médio 12m (R\$ 000) | 1.245.605                         | 15.526.057                               |
| Fundo de cotas                 | Sim                               | Não                                      |
| Valor Invest                   | -                                 | -  |
| Nome do invest                 | -                                 | -  |
| Investidor qualificado         | Não                               | Não                                      |
| Tipo de investidor             | Não Há Restrição                  | Não Há Restrição                         |
| Resolução 3792                 | Sim                               | -  |
| Resolução 3922                 | Sim                               | -  |

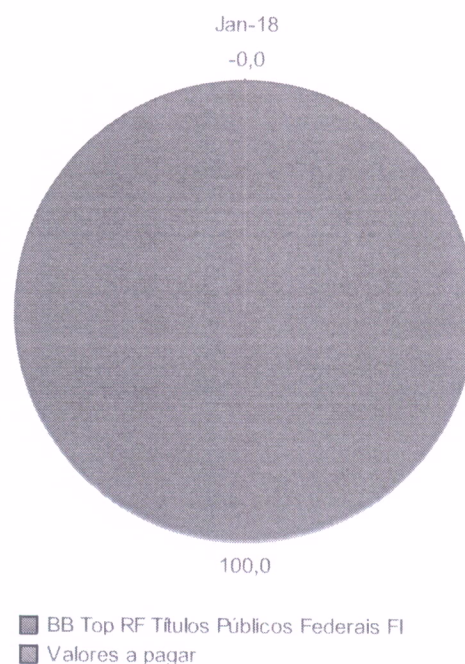
## Retornos (%) (até 20/02/2018)

|         | set 2017 | out 2017 | nov 2017 | dez 2017 | jan 2018 | fev 2018 | 2016  | 2017  | 2018  | 12m   | 24m    | 36m   | do início |
|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-----------|
| ● FUNDO | 0,56     | 0,56     | 0,48     | 0,45     | 0,49     | 0,26     | 13,11 | 8,87  | 0,75  | 7,91  | 22,09  | 37,47 | 89,89     |
| ● CDI   | 0,64     | 0,64     | 0,57     | 0,54     | 0,58     | 0,31     | 14,00 | 9,93  | 0,90  | 8,98  | 24,27  | 41,03 | 100,47    |
| ● IBOV  | 4,88     | 0,02     | -3,15    | 6,16     | 11,14    | 1,05     | 38,94 | 26,86 | 12,31 | 25,20 | 106,54 | 67,46 | 30,65     |

## 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 (%) | 0,97   |
| Menor Retorno Mensal (%) | 0,28   |
| Retorno Acumulado (%)    | 7,91   |
| Volatilidade             | 0,11   |
| Sharpe                   | -59,61 |
| VAR de 1 mês - 95% (%)   | 0,05   |

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                 | 13455117000101                        |
| Início do Fundo      | 06/09/2011                            |
| Código Anbima        | 286028                                |
| Classificação Anbima | Renda Fixa Indexados                  |
| Gestão               | Santander Brasil Gestao de Recurs...  |
| Custodiante          | Santander Securities Services Bras... |
| Administrador        | Banco Santander (Brasil) SA           |
| Taxa máx. adm. (%)   | 0,10                                  |
| Taxa performance     | -                                     |

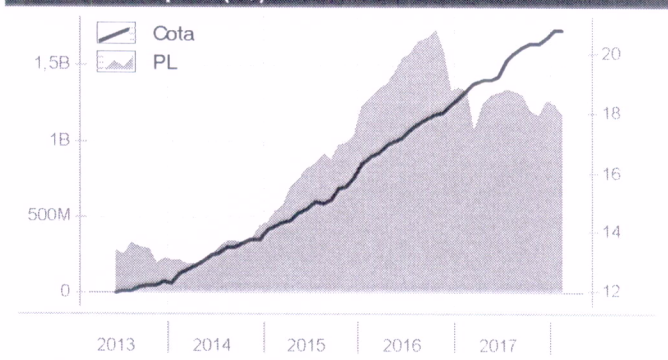
|                                |            |
|--------------------------------|------------|
| Data da Última Cotação         | 20/02/2018 |
| Cota                           | 20,793     |
| Patrimônio Líquido (R\$ 000)   | 1.175.524  |
| Patrimônio Médio 12m (R\$ 000) | 1.244.538  |

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 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   | 50.000  |
| Aplicação adicional mínima | 1.000   |
| Resgate mínimo             | 1.000   |
| Saldo mínimo               | 10.000  |
| Prazo emissão de cotas     | D+000   |
| Prazo conversão resgate    | D+000   |
| Prazo pgto resgate         | D+001   |
| Benchmark                  | IMA-B 5 |

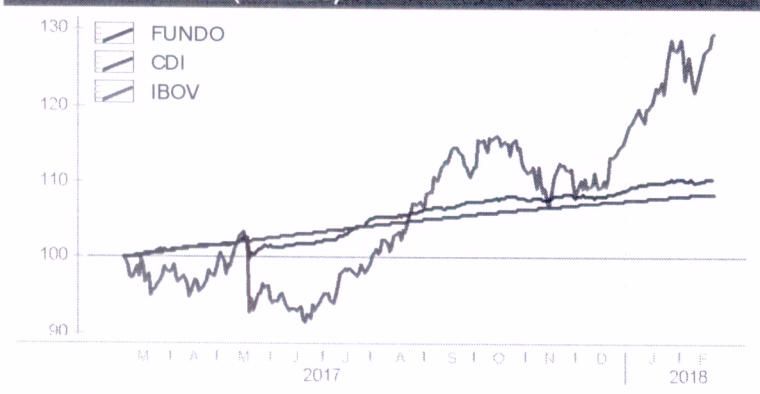
## Patrimônio Líquido (R\$) X Valor da Cota



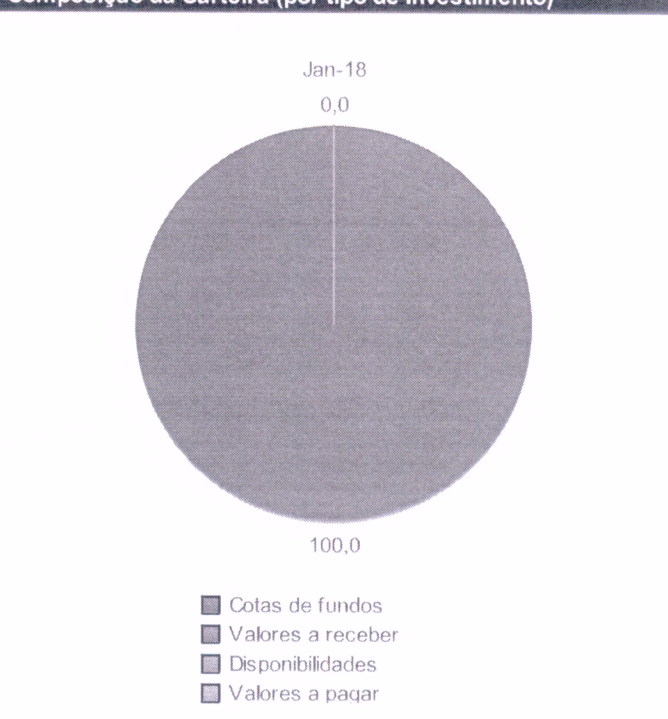
## Retornos (%) (até 20/02/2018)

|         | set 2017 | out 2017 | nov 2017 | dez 2017 | jan 2018 | fev 2018 | 2016  | 2017  | 2018  | 12m   | 24m    | 36m   | do início |
|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-----------|
| ● FUNDO | 0,99     | 0,46     | 0,11     | 0,87     | 1,31     | 0,06     | 15,27 | 12,38 | 1,37  | 11,65 | 25,98  | 47,88 | 107,93    |
| ● CDI   | 0,64     | 0,64     | 0,57     | 0,54     | 0,58     | 0,31     | 14,00 | 9,93  | 0,90  | 8,98  | 24,27  | 41,03 | 92,26     |
| ● IBOV  | 4,88     | 0,02     | -3,15    | 6,16     | 11,14    | 1,05     | 38,94 | 26,86 | 12,31 | 25,20 | 106,54 | 67,46 | 51,58     |

## 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 (%) | 2,82  |
| Menor Retorno Mensal (%) | 0,05  |
| Retorno Acumulado (%)    | 11,65 |
| Volatilidade             | 3,48  |
| Sharpe                   | 0,74  |
| VAR de 1 mês - 95% (%)   | 1,63  |

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.