



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:	273 /2018 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	273 /2018 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	28/11/18
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 7.119.147,69		FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"	
Sete milhões, cento e dezenove mil, cento e quarenta e sete reais e sessenta e nove centavos			
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	SANTANDER FIC DE FI INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI		
CNPJ do Fundo:	02.224.354/0001-45		
Segmento:	Renda Fixa		
Tipo de Ativo:	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 7.119.147,69		
Quantidade de Cotas:	41.379,82025664		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 172,04394910		
Data da Operação:	28/11/2018		
Data de Liquidação:	28/11/2018		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 4.595.300.080,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,154922%		
Banco/Agência/Conta:	Banco Bradesco S.A.	0286-0	65000-5
Administrador:	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.		
CNPJ do Administrador:	90.400.888/0001 42		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	14/11/2018		
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		
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:	27/11/1997		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado		
Índice de Referência do FI :	(DI)		
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:	01.591.605/0001-67	
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 por objetivo proporcionar rendimentos equivalentes aos das taxas de juros praticadas no mercado interfinanceiro, por meio da aplicação dos recursos de sua carteira de investimentos, com preponderância, em cotas de fundos de investimento e/ou fundos de investimento em cotas de fundos de investimento da classe Referenciado
	Principais riscos do fundo: Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco de Crédito (Risco: 1) Risco Muito Baixo
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Colegiado Deliberativo e Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS:	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/11/2018
Outras Observações:	Destinado ao pagamento da folha e consignações	
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?	Sim	
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Sim	
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 laude 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
<p>Anexo Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)</p> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div style="width: 45%;"> <p>PROPORANTE 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</p> </div> <div style="width: 45%;"> <p>GESTOR(A) AUTORIZADOR(A) 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>	

**SAÚDE
RECIFE**

**RECI
PREV**

Recife, 28 de novembro de 2018

Ofício RECIPREV nº 273/2018 – GI

Senhor Gerente,

Solicitamos o resgate total do fundo SANTANDER FIC DE FI INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI CNPJ: 02.224.354/0001-45.

Solicitamos, por favor, encaminhar TED, conforme dados a seguir:

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 Bradesco S.A. (237)
Agência: 0286-0
Conta Corrente: 65.000-5
Favorecido: FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV
CNPJ: 07.749.668/0001-85

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 273/2018

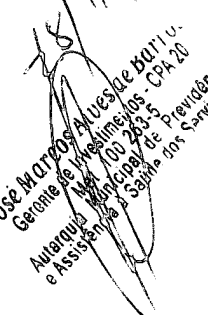
Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Prezados (as) Senhores (as)
Cristhian José Pedrosa de Oliveira/Wellington Nunes Passos/
assetinstituicoes@santanderam.com
asastre@santander.com.br
adriana.matheus@santanderam.com
Santander Brasil Gestão de Recursos Ltda
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

Transmitido em 28/11/2018

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
Gerente de Investimentos - CPA 20
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores


PREFEITURA DO
RECIFE

Características

CNPJ: 02.224.354/0001-45
 Gestor: Santander Brasil Asset Management
 Administrador: Banco Santander
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): 0,20%
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
 Código de Referência: 50563
 Início do Fundo: 27/11/1997

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 500.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 100,00
 Saldo Mínimo: R\$ 100,00
 Resgate Mínimo: R\$ 100,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

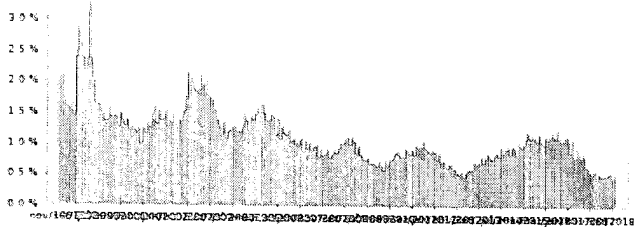
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18	fev/18	jan/18	dez/17	nov/17
Fundo	1.578,12	5,76	6,44	18,14	35,02	0,54	0,47	0,55	0,53	0,51	0,50	0,51	0,53	0,45	0,58	0,53	0,56
% do CDI	97,99	98,59	98,55	101,01	101,20	99,44	99,39	97,48	98,39	98,59	95,79	98,24	100,15	97,58	99,89	98,39	99,34
CDI	1.610,56	5,85	6,54	17,96	34,60	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52	0,53	0,46	0,58	0,54	0,57
Ibovespa	811,28	16,82	20,35	43,99	85,41	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88	0,01	0,52	11,14	6,16	-3,15
IBX	1.791,52	16,66	20,31	44,96	84,17	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82	0,08	0,42	10,74	6,35	-3,38
IGP-M	391,71	8,78	9,86	8,78	17,08	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57	0,64	0,07	0,76	0,89	0,52

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	172.0439491	4.595.300,08	5.113.438,67	0,02%	-	0,01%	0,99	0,01%	0,58%	0,45%	1
CDI	-	-	-	0,01%	-	0,01%	1,00	0,00%	0,58%	0,46%	0

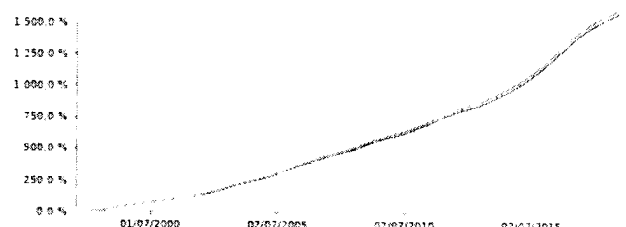
Gráficos

Fundo CDI

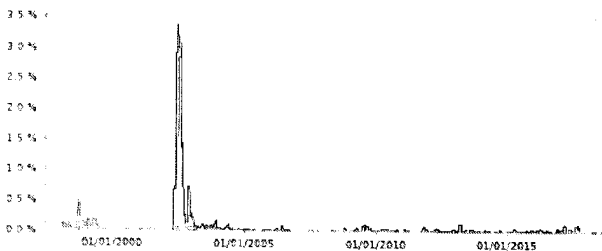
Retorno Mensal - 29/12/1997 a 28/11/2018 (mensal)



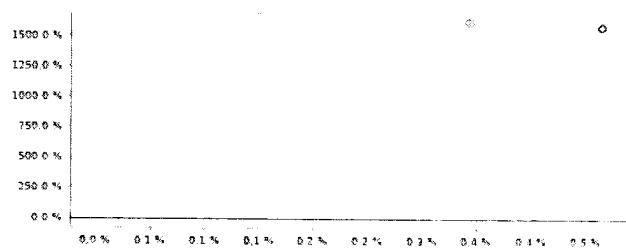
Retorno Acumulado - 29/12/1997 a 28/11/2018 (diária)



Volatilidade Anualizada - 29/12/1997 a 28/11/2018 (diária)



Risco x Retorno - 29/12/1997 a 28/11/2018 (diária)

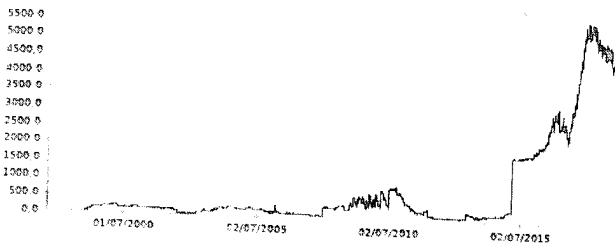


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos 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 fundo de fundo. Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas com o parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus investidores 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 (R\$). Para os cálculos foram utilizadas observações diárias. Fonte: Quantum Axis.

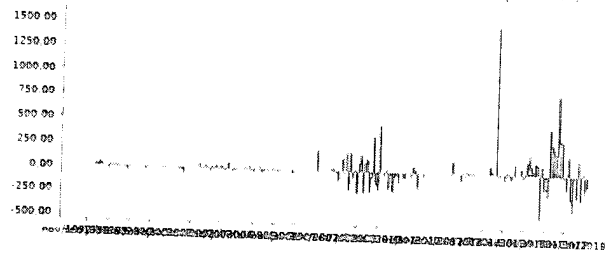
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI

28/11/2018

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/12/1997 a 28/11/2018 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/12/1997 a 28/11/2018 (mensal)



out/2018

Composição da Carteira

Performance dos Fundos em Carteira

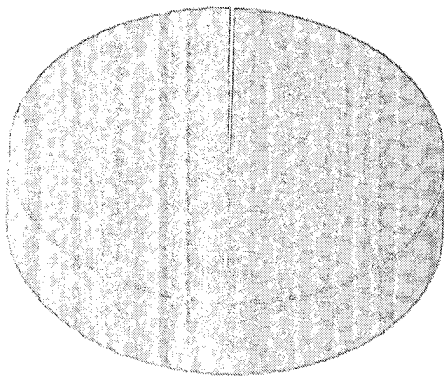
Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Volatilidade	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo		
SANTANDER PROFIT FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	100,03	0,45	102,40	2.094,64	103,89	2.094,64	103,89	2.094,64	103,89	-	RS 5.724.581.590,47

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

Tipo de Aplicação	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18	mar/18
Cotas de Fundos	100,03%	100,02%	100,02%	100,02%	100,02%	100,19%	100,03%	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	-0,03%	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,19%	-0,03%	-0,03%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	4.574.398,32	4.677.542,36	4.825.752,88	4.768.481,98	5.005.435,64	4.813.993,60	5.020.928,15	5.012.799,39
Data da Divulgação	07/11/2018	05/10/2018	06/09/2018	06/08/2018	06/07/2018	06/06/2018	08/05/2018	06/04/2018

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)



■ Cotas de SANTANDER PROFIT FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	100,03 %
■ Outros Valores a pagar	-0,03 %
■ 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 CIBANFIUM, pelo titular desta carteira ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia de Administração do fundo. Gestor da carteira de qualquer mecanismo de seguro ou medida de proteção. 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 de cobrir as perdas 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 Aes.