

Relatório Mensal de Investimentos

Portaria MPS N° 519, de 24 de agosto de 2011, Art 3°, V



Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

Relatórios da Carteira de Investimentos RECIPEV

Data da Posição: 30/06/2016

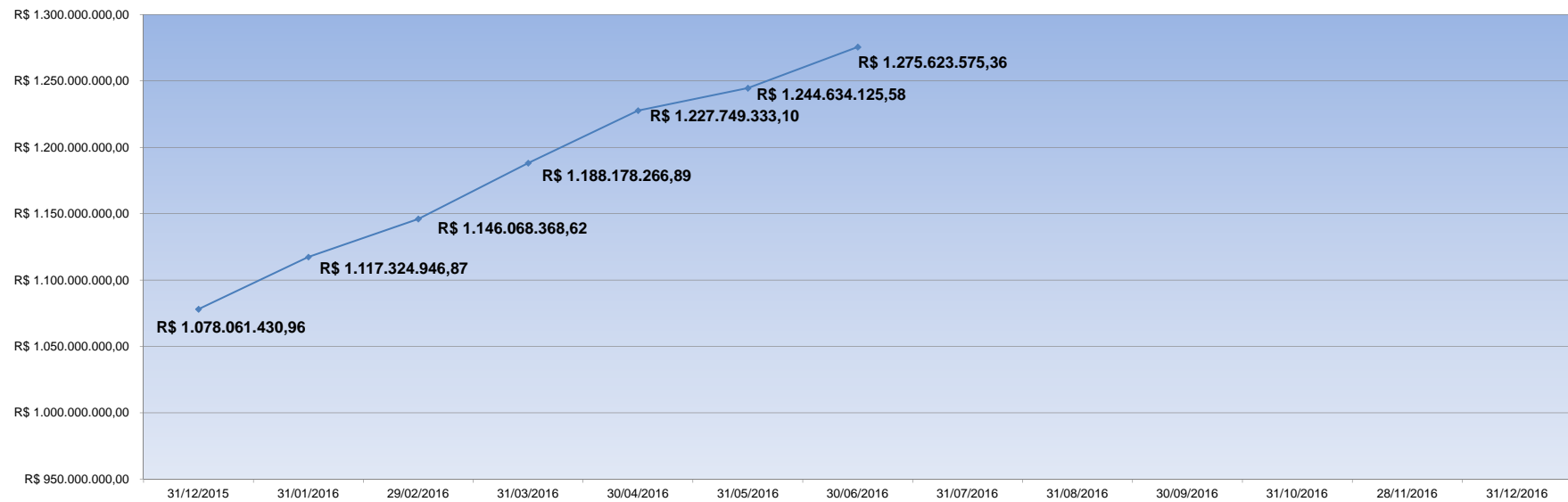
Composição da Carteira de Investimentos RECIPEV (Gestores)		
Renda Fixa		
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	578.634.949,30
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	330.125.675,78
TESOURO NACIONAL	R\$	148.788.701,60
BRAM – BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	R\$	38.490.303,74
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	19.153.266,95
GRADUAL CTVM S.A.	R\$	13.824.197,34
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	R\$	14.072.736,20
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	R\$	12.468.620,29
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	7.772.358,12
AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	5.796.301,07
NOVA S R M ADM DE RECURSOS S.A.	R\$	5.692.909,03
TOTAL RF	R\$	1.174.820.019,42
Renda Variável		
ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	18.897.678,96
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	R\$	17.070.090,35
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	13.746.223,50
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	7.333.778,86
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	7.106.334,50
MHFT INVESTIMENTOS S.A.	R\$	6.660.500,14
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$	5.269.990,97
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$	4.616.680,59
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	4.827.983,29
VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	R\$	4.142.167,96
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	4.224.336,69
AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	3.667.321,98
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$	3.240.468,16
TOTAL RV	R\$	100.803.555,94
PATRIMÔNIO	R\$	1.275.623.575,36

Composição da Carteira de Investimentos RECIPEV (Administradores)		
Renda Fixa		
BB GESTAO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	578.634.949,30
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	330.125.675,78
TESOURO NACIONAL	R\$	148.788.701,60
BANCO BRADESCO S.A.	R\$	38.490.303,74
GRADUAL CTVM S.A.	R\$	19.517.106,37
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	19.153.266,95
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$	14.072.736,20
SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	R\$	12.468.620,29
SOCOPA S.A.	R\$	7.772.358,12
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A	R\$	5.796.301,07
TOTAL RF	R\$	1.174.820.019,42
Renda Variável		
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	R\$	38.083.973,67
SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	R\$	17.070.090,35
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	13.746.223,50
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	13.208.941,66
BEM - DTVM LTDA	R\$	7.891.658,67
ICLA TRUST	R\$	6.660.500,14
VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	R\$	4.142.167,96
TOTAL RV	R\$	100.803.555,94
PATRIMÔNIO	R\$	1.275.623.575,36

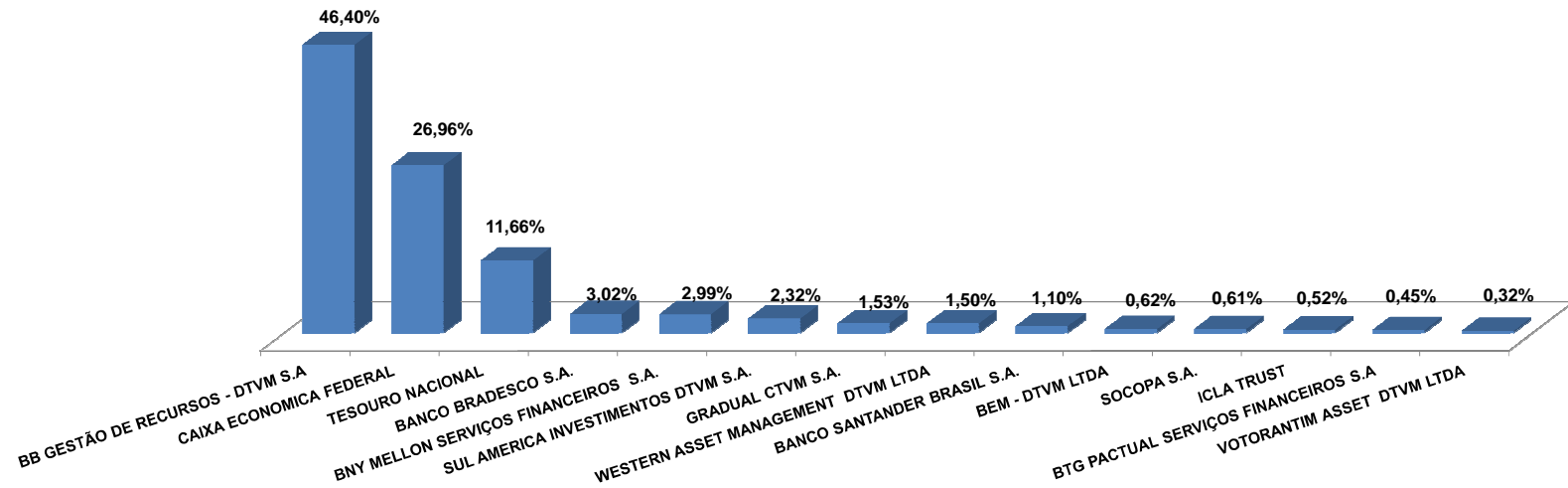
Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Rentabilidade RECIPREV (anual)	Tipo de fundo na Resolução 3.922/10	Artigo da Resolução 3.922/10
AZ LEGAN VALORE FI RF - CP	AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A	0,45%	7,75%	R\$ 5.796.301,07	19.782.311/0001-88	1,22%	6,67%	6,59%	RF - FI RENDA FIXA "CRÉDITO PRIVADO"	ARTIGO 7º,VII,"b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	0,05%	0,06%	R\$ 593.350,56	13.077.415/0001-05	1,17%	6,27%	6,50%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º,IV,"a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	5,28%	1,07%	R\$ 67.414.721,14	13.322.205/0001-35	0,82%	8,36%	7,44%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	2,20%	1,60%	R\$ 28.080.711,92	03.543.447/0001-03	0,91%	8,75%	8,54%	RF - FI Renda Fixa/Referenciados (IMA)	ARTIGO 7º,III, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	7,97%	2,17%	R\$ 101.626.107,44	07.442.078/0001-05	1,90%	15,96%	15,17%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	0,34%	0,41%	R\$ 4.283.355,34	13.327.340/0001-73	2,55%	20,67%	18,40%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 TP FIC FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	6,52%	1,08%	R\$ 83.230.290,46	11.328.882/0001-35	1,03%	7,34%	7,29%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	3,71%	0,82%	R\$ 47.387.860,26	13.077.418/0001-49	1,07%	6,49%	6,46%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º,IV,"a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	1,48%	7,44%	R\$ 18.878.014,26	15.486.093/0001-83	0,51%	13,90%	13,97%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º,IV,"a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	5,93%	7,55%	R\$ 75.622.117,11	19.303.795/0001-35	1,14%	7,95%	7,96%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º,IV,"a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA VI FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	1,84%	8,13%	R\$ 23.502.167,83	19.523.306/0001-50	0,61%	13,39%	13,40%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	6,74%	3,68%	R\$ 85.933.305,77	20.734.937/0001-06	1,27%	7,36%	7,37%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VII FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	3,30%	2,03%	R\$ 42.082.947,21	19.523.305/0001-06	1,03%	8,76%	8,79%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
BRASESCO INST FIC FI RF IMA-B	BRAM – BRASESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	BANCO BRASESCO S.A.	3,02%	3,81%	R\$ 38.490.303,74	08.702.798/0001-25	1,94%	15,75%	15,25%	RF - FI Renda Fixa/Referenciados (IMA)	ARTIGO 7º,III, "a"
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	6,17%	5,18%	R\$ 78.720.880,00	20.139.299/0001-77	1,34%	4,16%	7,13%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
FI CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	7,38%	7,48%	R\$ 94.185.600,00	18.598.256/0001-08	1,11%	4,81%	7,80%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º,IV,"a"
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,51%	5,61%	R\$ 19.253.340,00	18.598.288/0001-03	0,73%	12,14%	15,54%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,82%	3,06%	R\$ 23.201.880,00	20.139.595/0001-78	0,74%	11,72%	15,46%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,41%	10,87%	R\$ 5.244.740,00	19.769.046/0001-06	2,73%	17,66%	21,37%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,65%	4,22%	R\$ 8.259.944,00	20.139.534/0001-00	2,73%	17,26%	21,24%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,19%	0,39%	R\$ 15.150.551,84	14.386.926/0001-71	0,88%	8,41%	4,32%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,44%	0,35%	R\$ 18.351.409,00	11.060.913/0001-10	0,92%	8,66%	8,22%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	3,13%	1,06%	R\$ 39.949.786,06	10.740.658/0001-93	1,92%	15,96%	25,23%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,64%	0,22%	R\$ 20.931.877,64	10.740.670/0001-06	1,06%	7,38%	7,37%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,30%	0,09%	R\$ 3.845.638,00	03.737.206/0001-97	1,16%	6,73%	6,72%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º,IV,"a"
FIDC CASAN SANEAMENTO SENIOR 1	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,24%	1,20%	R\$ 3.030.029,24	19.542.287/0001-00	1,61%	10,36%	10,36%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 4	GRADUAL CTVM S.A.	GRADUAL CTVM S.A.	0,23%	4,09%	R\$ 2.980.521,67	11.278.761/0001-26	1,12%	8,09%	8,09%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	GRADUAL CTVM S.A.	GRADUAL CTVM S.A.	0,35%	6,21%	R\$ 4.524.623,54	11.278.761/0001-26	1,27%	9,01%	9,01%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIDC SUL INVEST - MULTISSETORIAL SENIOR 6	GRADUAL CTVM S.A.	GRADUAL CTVM S.A.	0,26%	1,97%	R\$ 3.296.110,72	09.257.784/0001-02	1,05%	8,22%	8,22%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIDC SUL INVEST - MULTISSETORIAL SENIOR 7	GRADUAL CTVM S.A.	GRADUAL CTVM S.A.	0,24%	1,81%	R\$ 3.022.941,40	09.257.784/0001-02	1,11%	8,60%	8,60%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIQ FIDC - BRAZIL PLUS	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	SOCOPA S.A.	0,61%	19,54%	R\$ 7.772.358,12	14.239.052/0001-20	1,39%	8,12%	8,12%	RF - FIDC ABERTO	ARTIGO 7º,VI
FIQ FIDC - SRM SENIOR 3	NOVA S R M ADM DE RECURSOS S.A.	GRADUAL CTVM S.A.	0,45%	6,89%	R\$ 5.692.909,03	09.260.031/0001-56	1,39%	8,12%	8,12%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TP RF	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	1,10%	0,92%	R\$ 14.072.736,20	13.455.117/0001-01	0,92%	8,73%	8,31%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I, "b"
SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RF CP	SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA	SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	0,98%	1,22%	R\$ 12.468.620,29	04.899.128/0001-90	1,17%	5,90%	5,90%	RF - FI RENDA FIXA "CRÉDITO PRIVADO"	ARTIGO 7º,VII,"b"
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	11,66%	0,00%	R\$ 148.788.701,60		3,82%	26,06%	26,06%	RF - TÍTULOS TESOURO NACIONAL - SELIC	Art. 7º, I, "a"
WESTERN ASSET DI REFERENCIADO FI	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	1,10%	1,32%	R\$ 13.972.140,88	00.819.875/0001-10	1,20%	6,67%	6,63%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º,IV,"a"
WESTERN ASSET IMABS ATIVO FI RF	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	0,41%	4,95%	R\$ 5.181.126,07	17.517.577/0001-78	0,99%	11,36%	4,05%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º, I, "b"
Renda Fixa			92,10%		R\$ 1.174.820.019,42			1,56%			

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPIREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Rentabilidade RECIPIREV (anual)	Tipo de fundo na Resolução 3.922/10	Artigo da Resolução 3.922/10
AZ LEGAN BRASIL FIA	AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	BEM - DTVM LTDA	0,29%	9,07%	R\$ 3.667.321,98	14.550.994/0001-24	5,04%	13,28%	13,28%	RV - FUNDO DE AÇÕES	ARTIGO 8º,III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	0,25%	3,05%	R\$ 3.240.468,16	11.392.165/0001-72	4,71%	10,12%	10,12%	RV - FUNDO DE AÇÕES	ARTIGO 8º,III
BB AÇÕES PIPE FIC FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	0,38%	5,40%	R\$ 4.827.983,29	17.116.227/0001-08	7,11%	21,95%	21,95%	RV - FUNDO DE AÇÕES	ARTIGO 8º,III
BRZ VALOR FIC FIA	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	0,12%	2,67%	R\$ 1.505.713,19	07.124.064/0001-43	3,16%	12,04%	12,04%	RV - FUNDO DE AÇÕES	ARTIGO 8º,III
FI CAIXA BRASIL IPCA VII M CP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,78%	10,27%	R\$ 9.986.223,50	14.120.236/0001-76	1,13%	8,03%	8,03%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	0,41%	4,83%	R\$ 5.269.990,97	20.716.161/0001-93	0,63%	7,36%	7,36%	RV - FI IMOBILIÁRIO	ARTIGO 8º,VI
FII - CAIXA RIO BRAVO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,29%	2,41%	R\$ 3.760.000,00	17.098.794/0001-70	2,14%	24,74%	24,74%	RV - FI IMOBILIÁRIO	ARTIGO 8º,VI
FII - REIT RIVIERA	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	0,56%	22,79%	R\$ 7.106.334,50	16.841.067/0001-99	1,56%	10,64%	10,64%	RV - FI IMOBILIÁRIO	ARTIGO 8º,VI
FIP - ÁTICO FLORESTAL	ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	0,64%	4,64%	R\$ 8.130.686,10	12.312.767/0001-35	-0,13%	-0,77%	-0,77%	RV - FI EM PARTICIPAÇÕES	ARTIGO 8º,V
FIP - ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA	ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	0,84%	3,14%	R\$ 10.766.992,85	11.490.580/0001-69	-0,14%	-0,79%	-0,79%	RV - FI EM PARTICIPAÇÕES	ARTIGO 8º,V
FIP - CAIS MAUA DO BRASIL	MHFT INVESTIMENTOS S.A.	ICLA TRUST	0,52%	4,11%	R\$ 6.660.500,14	17.213.821/0001-09	-0,11%	-0,65%	-0,65%	RV - FI EM PARTICIPAÇÕES	ARTIGO 8º,V
FIP - TERRAS BRASIL	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	0,24%	9,94%	R\$ 3.110.967,40	19.412.474/0001-79	-0,14%	-0,78%	-0,78%	RV - FI EM PARTICIPAÇÕES	ARTIGO 8º,V
QUELUZ VALOR FIA	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BEM - DTVM LTDA	0,33%	13,53%	R\$ 4.224.336,69	09.289.072/0001-75	4,25%	13,29%	13,29%	RV - FUNDO DE AÇÕES	ARTIGO 8º,III
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FIM CP	SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA	SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	1,10%	3,40%	R\$ 14.086.974,42	13.823.084/0001-05	1,16%	5,68%	5,66%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FIM CP	SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA	SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	0,23%	8,93%	R\$ 2.983.115,93	19.225.709/0001-13	1,02%	0,60%	0,60%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
VOTORANTIM ATUARIAL M CP FI	VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	0,32%	2,69%	R\$ 4.142.167,96	14.491.564/0001-89	0,99%	8,88%	8,88%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
XP LONG SHORT FIC FIM	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	0,57%	1,17%	R\$ 7.333.778,86	11.616.403/0001-86	1,77%	15,06%	12,97%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
Renda Variável			7,90%		R\$ 100.803.555,94			1,56%			
Total Geral			100,00%		R\$ 1.275.623.575,36			Rentabilidade Reciprev	1,56%		

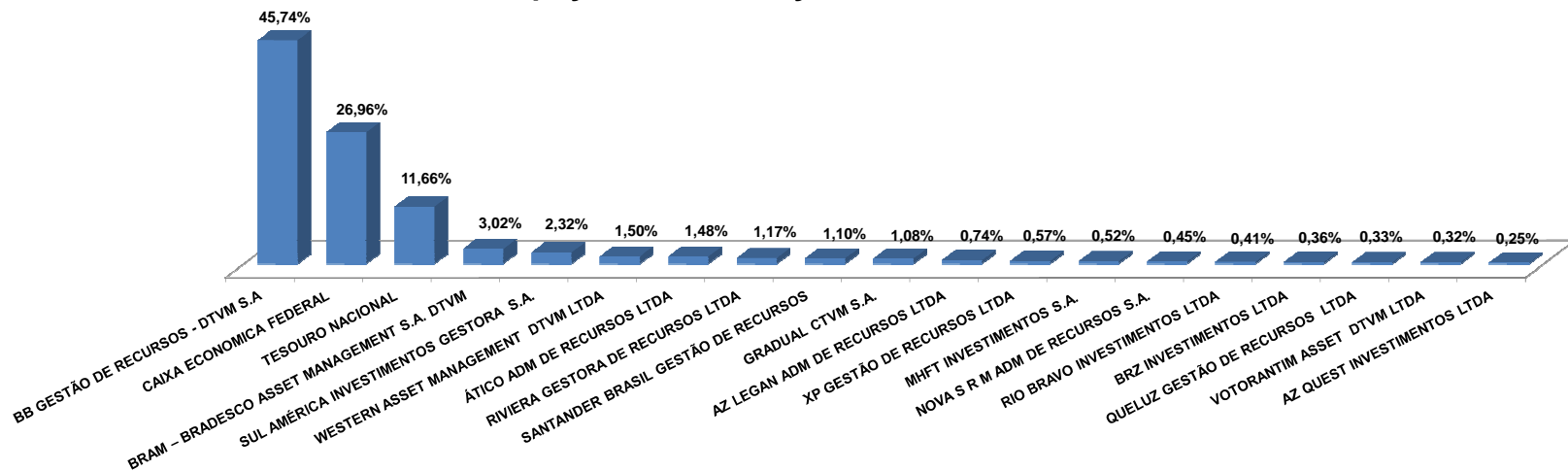
Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV



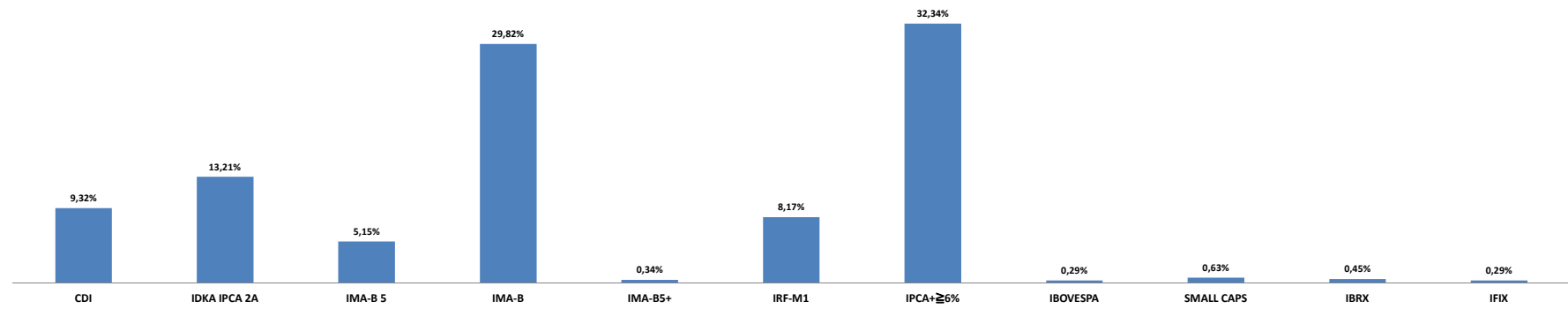
Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



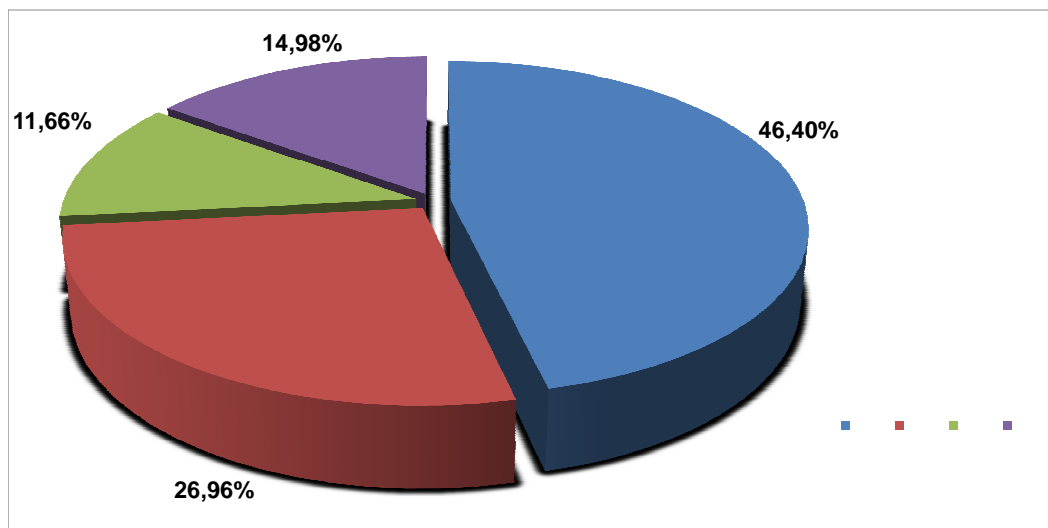
Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV



Percentual de Composição da Carteira RECIPREV por Benchmark



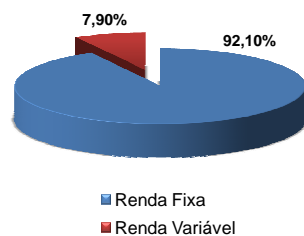
Resumo do Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



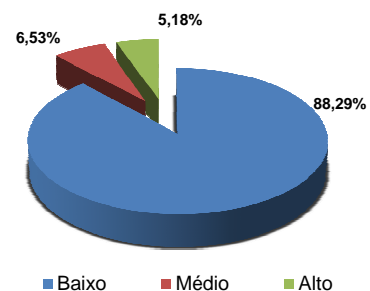
Administrador	
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	46,40%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	26,96%
TESOURO NACIONAL	11,66%
INSTITUIÇÕES PRIVADAS	14,98%
TOTAL	100,00%

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV

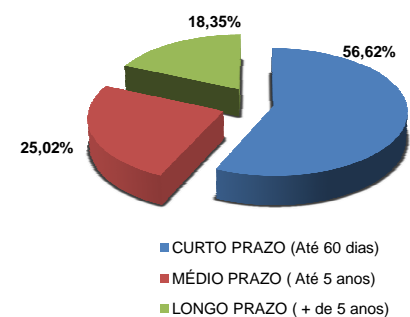
Renda Fixa X Renda Variável



Composição por Nível de Risco



Prazos Gerais de Liquidação



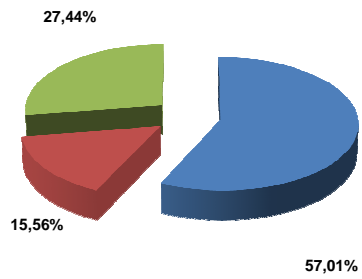
oBS:

Prazo de Liquidação: O prazo de liquidação de um produto pode ou não ser igual ao prazo de resgate do mesmo. O prazo de resgate consta do regulamento do produto, já o prazo de liquidação leva em conta a venda do mesmo no mercado secundário, a preço de mercado. Por exemplo, um produto com prazo de resgate de 10 anos, pode ser vendido a preço de mercado em pouco tempo, como é o caso dos fundos imobiliários ou NTN-B, etc.

PRAZOS DE LIQUIDAÇÃO DA CARTEIRA						
CARTEIRA GERAL						
	RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL	
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	677.387.947,64	R\$	44.924.927,81	R\$	722.312.875,45
MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)	R\$	278.356.892,14	R\$	40.837.169,63	R\$	319.194.061,77
LONGO PRAZO (+ de 5 anos)	R\$	219.075.179,64	R\$	15.041.458,51	R\$	234.116.638,15
TOTAL	R\$	1.174.820.019,42	R\$	100.803.555,94	R\$	1.275.623.575,36
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.						
	RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL	
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	332.616.397,12	R\$	-	R\$	332.616.397,12
MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)	R\$	85.933.305,77	R\$	4.827.983,29	R\$	90.761.289,06
LONGO PRAZO (+ de 5 anos)	R\$	160.085.246,40	R\$	-	R\$	160.085.246,40
TOTAL	R\$	578.634.949,30	R\$	4.827.983,29	R\$	583.462.932,59
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL						
	RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL	
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	98.229.262,54	R\$	3.760.000,00	R\$	101.989.262,54
MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)	R\$	172.906.480,00	R\$	9.986.223,50	R\$	182.892.703,50
LONGO PRAZO (+ de 5 anos)	R\$	58.989.933,24	R\$	-	R\$	58.989.933,24
TOTAL	R\$	330.125.675,78	R\$	13.746.223,50	R\$	343.871.899,28
TESOURO NACIONAL						
	RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL	
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	148.788.701,60	R\$	-	R\$	148.788.701,60
MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)	R\$	-	R\$	-	R\$	-
LONGO PRAZO (+ de 5 anos)	R\$	-	R\$	-	R\$	-
TOTAL	R\$	148.788.701,60	R\$	-	R\$	148.788.701,60
INTITUIÇÕES PRIVADAS						
	RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL	
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	97.753.586,37	R\$	41.164.927,81	R\$	138.918.514,18
MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)	R\$	19.517.106,37	R\$	26.022.962,84	R\$	45.540.069,21
LONGO PRAZO (+ de 5 anos)	R\$	-	R\$	15.041.458,51	R\$	15.041.458,51
TOTAL	R\$	117.270.692,74	R\$	82.229.349,16	R\$	199.500.041,89

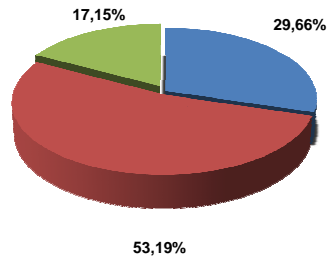
Prazos de Liquidação da Carteira de Investimentos

BB Gestão de Recursos - DTVM S.A



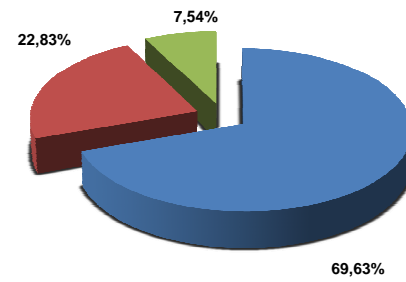
■ CURTO PRAZO (Até 60 dias)
■ MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)
■ LONGO PRAZO (+ de 5 anos)

Caixa Econômica Federal



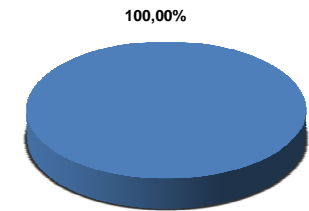
■ CURTO PRAZO (Até 60 dias)
■ MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)
■ LONGO PRAZO (+ de 5 anos)

Instituições Privadas



■ CURTO PRAZO (Até 60 dias)
■ MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)
■ LONGO PRAZO (+ de 5 anos)

Tesouro Nacional

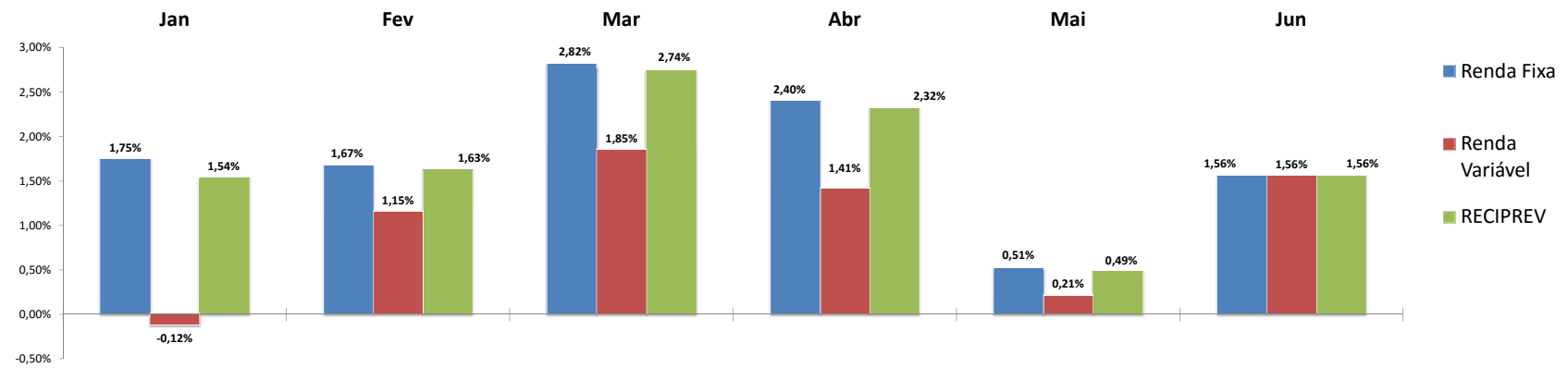


■ CURTO PRAZO (Até 60 dias)

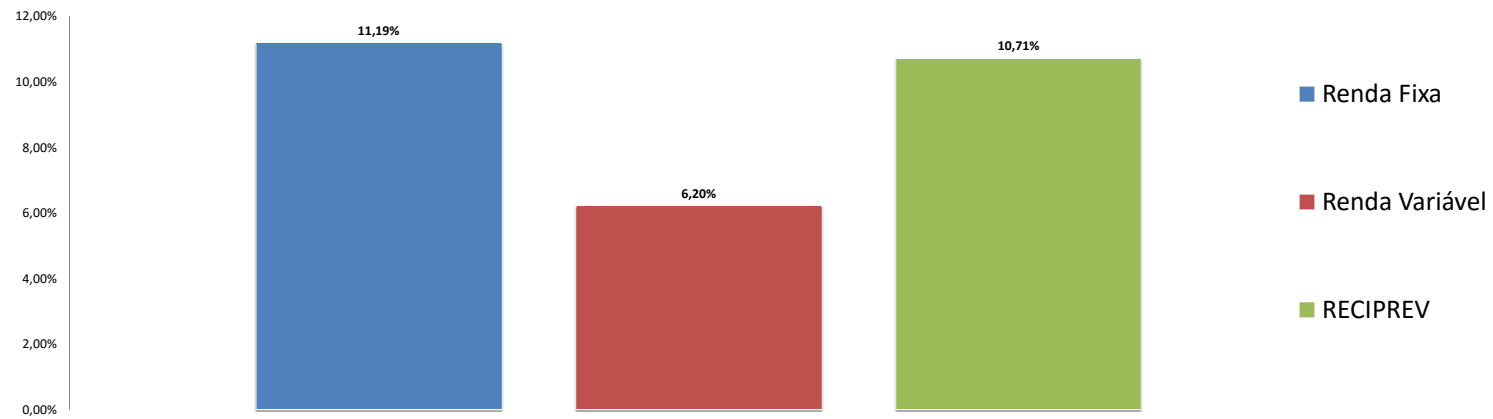
Política de Investimentos

	LIMITES DAS RESOLUÇÕES	CARTEIRA – RECIPREV	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO	POLÍTICA
RENDA FIXA – ART 7º				
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a"	100,00%	11,66%	14,00%	100,00%
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	100,00%	51,46%	18,00%	100,00%
Operações Compromissadas - Art. 7º, II	15,00%	0,00%	0,00%	15,00%
FI Renda Fixa/Referenciados (IMA, IDKA, IRFM,etc) - Art. 7º, III, "a"	80,00%	5,22%	11,00%	80,00%
Fundos de Índices de Renda Fixa (IMA, IDKA) - Art. 7º, III, "b"	80,00%	0,00%	0,00%	80,00%
FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	30,00%	19,95%	23,00%	30,00%
Fundos de Índices de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "b"	30,00%	0,00%	0,00%	30,00%
Poupança - Art. 7º, V, "a"	20,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, V, "b"	20,00%	0,00%	0,00%	20,00%
FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) – Aberto - Art. 7º, VI	15,00%	0,61%	4,00%	15,00%
FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) – Fechado - Art. 7º, VII, "a"	5,00%	1,77%	2,50%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, "b"	5,00%	1,43%	2,50%	5,00%
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	92,10%	75,00%	
RENDA VARIÁVEL – ART 8º				
FI Ações referenciados - Art. 8º, I	30,00%	0,00%	1,00%	30,00%
FI de Índices Referenciados em Ações - Art. 8º, II	20,00%	0,00%	1,00%	20,00%
FI em Ações - Art. 8º, III	15,00%	1,37%	8,00%	15,00%
FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV	5,00%	3,02%	5,00%	5,00%
FI em Participações - fechado - Art. 8º, V	5,00%	2,25%	5,00%	5,00%
FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI	5,00%	1,26%	5,00%	5,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	7,90%	25,00%	
TOTAL		100,00%	100,00%	

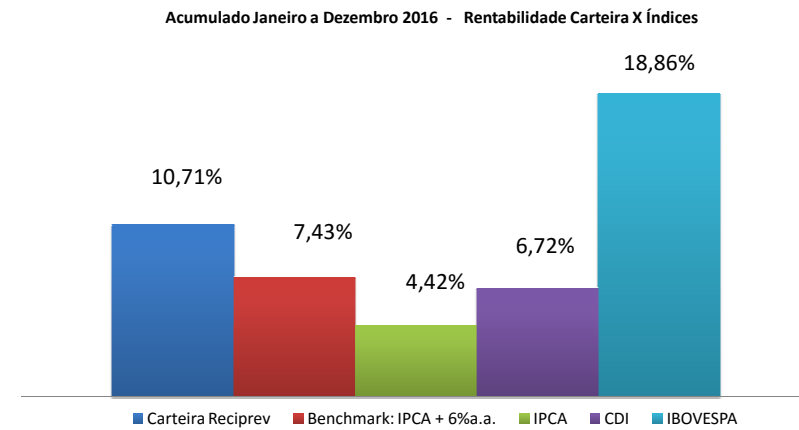
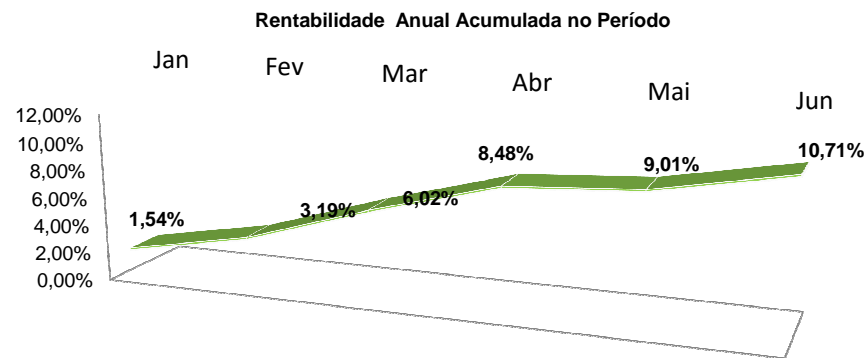
Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV



Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV



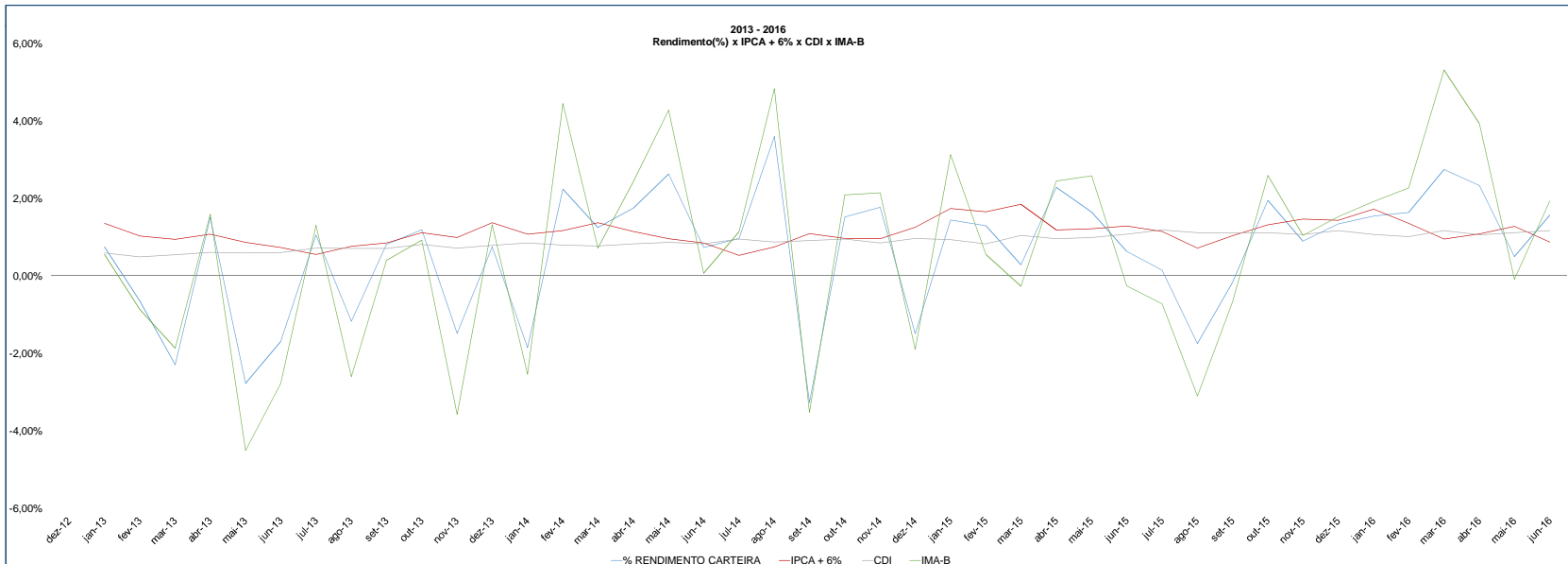
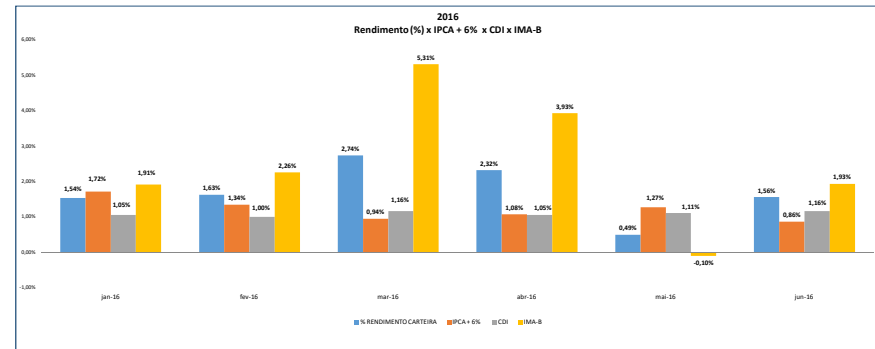
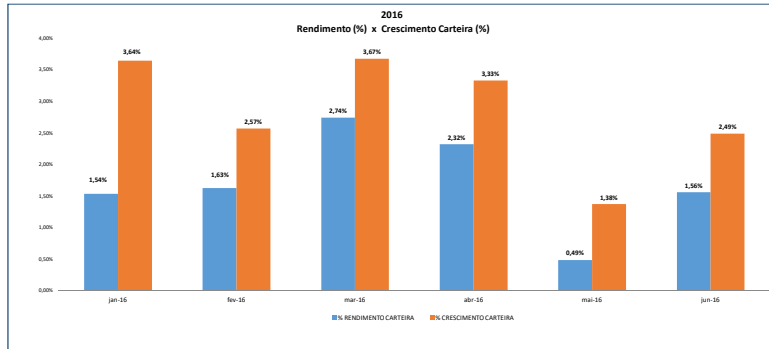
Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV



RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV - ANO DE 2016

DATA	SALDO		RENDIMENTO R\$	% RENDIMENTO CARTEIRA	
31/01/2016	R\$	1.117.324.946,85	R\$	16.578.716,11	1,54%
29/02/2016	R\$	1.146.068.368,62	R\$	18.174.298,93	1,63%
31/03/2016	R\$	1.188.178.266,89	R\$	31.411.365,20	2,74%
30/04/2016	R\$	1.227.749.333,10	R\$	27.567.111,51	2,32%
31/05/2016	R\$	1.244.634.125,58	R\$	6.017.056,21	0,49%
30/06/2016	R\$	1.275.623.575,36	R\$	19.445.425,92	1,56%
31/07/2016	R\$	-	R\$	-	0,00%
31/08/2016	R\$	-	R\$	-	0,00%
30/09/2016	R\$	-	R\$	-	0,00%
31/10/2016	R\$	-	R\$	-	0,00%
30/11/2016	R\$	-	R\$	-	0,00%
31/12/2016	R\$	-	R\$	-	0,00%
TOTAL		R\$		119.193.973,88	10,71%

GRÁFICO COMPARATIVO DA CARTEIRA RECIPREV



FLUXO MENSAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPEV

ANO	2016		
Mês	Junho		
RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES		COMPETÊNCIA	VALOR
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	Parcelamento 6/60 e Contribuição 05 de 2016 e Multa mês 03/2016 sobre parcelamento	R\$	6.468.255,12
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	05 de 2016	R\$	5.343.669,95
IASC (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	05 de 2016	R\$	70.400,95
IASC (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	05 de 2016	R\$	69.170,58
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	05 de 2016	R\$	30.815,49
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	-	R\$	-
CONTRIBUIÇÕES APO/PPR	05 de 2016	R\$	7.817,86
TOTAL		R\$	11.990.129,95
RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS		CNPJ	VALOR
FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	20.716.161/0001-93	R\$	60.000,00
FII - CAIXA RIO BRAVO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	17.098.794/0001-70	R\$	39.600,00
FII - REIT RIVIERA - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	16.841.067/0001-99	R\$	-
FIDC CASAN SANEAMENTO SENIOR 1 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.542.287/0001-00	R\$	43.520,59
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	15.486.093/0001-83	R\$	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.303.795/0001-35	R\$	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA VI FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.523.306/0001-50	R\$	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VII FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.523.305/0001-06	R\$	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	20.734.937/0001-06	R\$	-
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - (CUPOM/JUROS)	-	R\$	-
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.299/0001-77	R\$	-
FI CAIXA BRASIL 2018 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	18.598.256/0001-08	R\$	-
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	18.598.288/0001-03	R\$	-
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.595/0001-78	R\$	-
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	19.769.046/0001-06	R\$	-
FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.534/0001-00	R\$	-
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 4 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	11.278.761/0001-26	R\$	104.385,28
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	11.278.761/0001-26	R\$	422.044,30
FIDC SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL SENIOR 6 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	09.257.784/0001-02	R\$	-
FIDC SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL SENIOR 7 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	09.257.784/0001-02	R\$	-
TOTAL		R\$	669.550,17
FOLHA DE PAGAMENTO			VALOR
CONSIGNAÇÃO DA FOLHA DE APO/PPR		-R\$	336.093,66
TOTAL		-R\$	336.093,66
PAGAMENTOS DIVERSOS			VALOR
TARIFA DE CUSTÓDIA DO FUNDO FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		-R\$	13,20
TARIFA DE CUSTÓDIA TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)		R\$	-
CUSTO SELIC TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)		-R\$	382,28
OUTROS		R\$	-
TOTAL		-R\$	395,48
RESUMO GERAL			VALOR
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES		R\$	11.990.129,95
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS		R\$	669.550,17
TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS		-R\$	336.093,66
TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS		-R\$	395,48
TOTAL		R\$	12.323.190,98

SERVIDORES INGRESSARAM A PARTIR DE 17/12/1998	
APOSENTADOS E PENSIONISTAS	
TOTAL APOSENTADOS	173
TOTAL PENSIONISTAS	103
TOTAL GERAL	276
NÚMERO DE CONTRIBUINTES	
PREFEITURA	14.015
IASC	305
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE	70
INATIVOS	17
TOTAL DE CONTRIBUINTES	14.407
PERCENTUAL DAS CONTRIBUIÇÕES	
PATRONAL	15,94%
SEGURADOS	12,82%
PERCENTUAL TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES	28,76%

RESUMO ANUAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPEV

ANO	2016		
RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES ACUMULADAS DO ANO			VALOR
	PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	R\$	43.995.165,84
	PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	R\$	36.073.911,17
	IASC (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	R\$	443.023,92
	IASC (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	R\$	420.927,23
	CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	R\$	154.006,87
	CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	R\$	123.862,90
	CONTRIBUIÇÕES APO/PPR	R\$	45.059,43
	TOTAL	R\$	81.255.957,36
RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS ACUMULADAS DO ANO			VALOR
	FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	20.716.161/0001-93	R\$ 260.500,00
	FII - CAIXA RIO BRAVO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	17.098.794/0001-70	R\$ 200.654,72
	FII - REIT RIVIERA - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	16.841.067/0001-99	R\$ 251.078,33
	FIDC CASAN SANEAMENTO SENIOR 1 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.542.287/0001-00	R\$ 303.455,98
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	15.486.093/0001-83	R\$ 550.812,35
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.303.795/0001-35	R\$ 2.171.254,53
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA VI FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.523.306/0001-50	R\$ 666.834,69
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VII FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.523.305/0001-06	R\$ 1.180.206,06
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	20.734.937/0001-06	R\$ 2.390.256,65
	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - (CUPOM/JUROS)	-	R\$ 4.374.360,81
	FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.299/0001-77	R\$ 2.151.635,42
	FI CAIXA BRASIL 2018 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	18.598.256/0001-08	R\$ 2.576.022,12
	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	18.598.288/0001-03	R\$ 532.457,16
	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.595/0001-78	R\$ 709.612,93
	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	19.769.046/0001-06	R\$ 143.218,29
	FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.534/0001-00	R\$ 242.909,75
	FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 4 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	11.278.761/0001-26	R\$ 250.947,47
	FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	11.278.761/0001-26	R\$ 422.044,30
	FIDC SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL SENIOR 6 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	09.257.784/0001-02	R\$ -
	FIDC SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL SENIOR 7 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	09.257.784/0001-02	R\$ 282.555,65
	TOTAL	R\$	19.660.817,21
FOLHA DE PAGAMENTO ACUMULADA DO ANO			VALOR
	CONSIGNAÇÃO DA FOLHA DE APO/PPR	-R\$	2.815.056,00
	TOTAL	-R\$	2.815.056,00
PAGAMENTOS DIVERSOS ACUMULADO DO ANO			VALOR
	TARIFA DE CUSTÓDIA DO FUNDO FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS	-R\$	73,20
	TARIFA DE CUSTÓDIA TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	R\$	-
	CUSTO SELIC TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	-R\$	2.161,51
	OUTROS	R\$	-
	TOTAL	-R\$	2.234,71
RESUMO GERAL DO ANO			VALOR
	TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES	R\$	81.255.957,36
	TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS	R\$	19.660.817,21
	TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS	-R\$	2.815.056,00
	TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS	-R\$	2.234,71
	TOTAL	R\$	98.099.483,86

CALENDÁRIO DO CRONOGRAMA DE RECEBIMENTOS DOS FUNDOS ESPECÍFICOS - 2016

FUNDOS E TÍTULOS	CNPJ	CRONOGRAMA DE RECEBIMENTOS
FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	20.716.161/0001-93	TODOS OS MESES
FII - CAIXA RIO BRAVO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	17.098.794/0001-70	TODOS OS MESES
FII - REIT RIVIERA - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	16.841.067/0001-99	JAN/ABR/JUL/OUT
FIDC CASAN SANEAMENTO SENIOR 1 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.542.287/0001-00	TODOS OS MESES
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	15.486.093/0001-83	MAIO/NOV
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.303.795/0001-35	FEV/AGO
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA VI FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.523.306/0001-50	FEV/AGO
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VII FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.523.305/0001-06	FEV/AGO
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	20.734.937/0001-06	FEV/AGO
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - (CUPOM/JUROS)	-	MAIO/NOV
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.299/0001-77	FEV/AGO
FI CAIXA BRASIL 2018 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	18.598.256/0001-08	FEV/AGO
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	18.598.288/0001-03	FEV/AGO
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.595/0001-78	FEV/AGO
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	19.769.046/0001-06	FEV/AGO
FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.534/0001-00	FEV/AGO
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 4 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	11.278.761/0001-26	MAR/JUN/SET/DEZ
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	11.278.761/0001-26	JUN/DEZ
FIDC SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL SENIOR 6 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	09.257.784/0001-02	AGO
FIDC SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL SENIOR 7 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	09.257.784/0001-02	MAIO/NOV/DEZ

FUNDO	CNPJ	Gestor	Tipo	Enquadramento Resl. 3.922	Benchmark	Retorno Médio Mensal	Retorno Médio Anual	Maior Retorno	Menor Retorno	Qtde. mês Positivo	Qtde. mês Negativo	Qtde. mês acima do Benchmark	Qtde. mês abaixo do Benchmark	Risco Mensal Período	Risco Anual do Período	Retorno Relativo ao Benchmark	Sharpe	Information Ratio	Treck Error	VAR (95%)	Sharpe Modificado	Índice Beta (12 meses)	Erro Quadrático Médio (ECM)
FIO FIDC - BRAZIL PLUS	14.239.052/0001-20	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	RF	ARTIGO 7º, VI	120% CDI	1,26%	16,28%	1,41%	1,01%	21	0	16	5	0,10%	0,36%	100,41%	-0,08	-0,28	14,58%	7,78%	-0,0841	1,8729	4,18%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS	-	TESOURO NACIONAL	RF	ART. 7º, I, a	IPCA+6% ano	0,77%	9,58%	11,67%	-8,30%	39	27	32	34	4,21%	14,59%	81,79%	-0,09	1,65	9,74%	7,39%	0,2509	0,2804	3,06%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	11.392.165/0001-72	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	RV	ART. 8º, III	SMALL CAPS	0,76%	9,53%	9,27%	-10,30%	44	22	51	15	3,98%	13,80%	239,09%	0,14	-0,40	5,50%	3,70%	0,1695	1,2000	1,58%
FII - REIT RIVIERA	16.841.067/0001-99	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	RV	ART. 8º, VI	IPCA+7,5% ano	1,03%	13,07%	4,69%	-2,14%	23	8	11	20	1,62%	5,60%	91,82%	0,48	-8,84	0,11%	2,33%	-73,5447	0,9144	0,03%
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TP RF	13.455.117/0001-01	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	RF	ART 7º, I, b	IMA-B 5	0,95%	11,95%	2,96%	-1,20%	50	7	9	48	0,84%	2,92%	99,13%	0,61	0,61	0,57%	1,29%	3,3531	0,1540	0,17%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FIM CP	13.823.084/0001-05	INVESTIMENTOS GESTORA RV S.A.	RV	ART. 8º, IV	CDI	0,88%	11,07%	1,42%	0,28%	51	0	39	12	0,25%	0,86%	102,01%	0,34	0,77	0,28%	1,18%	-0,0269	0,4342	0,08%
SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RF CP	04.899.128/0001-90	INVESTIMENTOS GESTORA RF S.A.	RF	ART. 7º, VII, b	CDI	0,87%	10,94%	1,28%	0,50%	66	0	60	6	0,19%	0,65%	101,10%	-0,47	-0,32	8,44%	2,61%	-0,6893	1,6458	2,44%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FIM CP	19.225.709/0001-13	INVESTIMENTOS GESTORA RV S.A.	RV	ART. 8º, IV	IPCA+6% ano	0,87%	10,95%	2,25%	-3,36%	25	2	11	16	1,06%	3,66%	92,10%	3,62	2,61	0,52%	1,85%	86,0526	0,7984	0,15%
FIDC SUL INVEST - MULTISSETORIAL SENIOR 6	09.257.784/0001-02	GRADUAL CTVM S.A.	RF	ART. 7º, VII, a	IPCA+7,5% ano	1,29%	16,64%	2,19%	0,68%	30	0	14	16	0,34%	1,17%	99,72%	5,31	1,61	0,58%	1,94%	38,2662	0,7267	0,17%
FIDC SUL INVEST - MULTISSETORIAL SENIOR 7	09.257.784/0001-02	GRADUAL CTVM S.A.	RF	ART. 7º, VII, a	IPCA+8,5% ano	1,34%	17,28%	2,27%	0,74%	26	0	10	16	0,37%	1,27%	104,18%	-59,76	-12,03	1,25%	0,00%	14,7880	0,0228	1,35%
FIP - TERRAS BRASIL	19.412.474/0001-79	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	RV	ART. 8º, V	IPCA+6% ano	-0,11%	-1,35%	0,21%	-0,16%	1	24	0	25	0,07%	0,24%	72,37%	0,66	0,14	2,73%	2,47%	1,0487	2,0623	0,78%
VOTORANTIM ATUARIAL M CP FI	14.491.564/0001-89	VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	RV	ART. 8º, IV	IPCA+6% ano	1,10%	14,03%	2,91%	-1,06%	30	3	16	17	0,83%	2,88%	97,43%	0,37	2,29	0,10%	1,16%	-10,4786	1,2480	0,03%
WESTERN ASSET DI REFERENCIADO FI	00.819.875/0001-10	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	RF	ART. 7º, IV, a	CDI	0,87%	10,95%	1,20%	0,49%	66	0	58	8	0,18%	0,61%	101,14%	0,30	0,26	1,74%	3,14%	0,9003	1,3591	0,50%
XP LONG SHORT FIC FIM	11.616.403/0001-86	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	RV	ART. 8º, IV	CDI	1,07%	13,65%	3,62%	-2,41%	59	7	39	27	0,97%	3,37%	115,42%	0,87	0,91	3,22%	2,68%	1,0692	3,2227	0,95%
CARTEIRA RECIPREV	07.749.668/0001-85	RECIPREV	-	-	IPCA+6% ano	0,88%	11,14%	4,55%	-2,78%	51	15	29	37	1,47%	5,10%	88,42%	0,08	-0,49	5,08%	3,32%	0,1029	0,4927	1,47%

EXPLICAÇÕES DA PLANILHA ESTATÍSTICA

* Base de dados: Econômica; ANBIMA; CETIP; Fundos de Investimentos; Carteira Reciprev;

**Período de análise: A partir de janeiro de 2011 até o mês deste relatório. Consideramos para os cálculos o mês de início das atividades de captações dos ativos. Deste modo, não foi considerado as datas exatas em que a Reciprev efetuou as aplicações ou resgates no ativo. Este fato, altera os cálculos, em particular, no mês do referido evento, para mais ou para menos em todos os indicadores desta planilha, porém, não de forma significativa;

***Eventos diversos: Alguns dos indicadores apresentados podem não espelhar de forma adequada a análise do(s) ativo(s), tendo em vista diversas variáveis envolvidas, tais como: tempo de análise ou tempo de existência do ativo; tipo do ativo; objetivo do ativo entre outras variáveis;

****A Reciprev possui fundos imobiliários com os seguintes objetivos: a) de renda; b) recebíveis com retornos programados; c) recebíveis sem retorno programado. Todos os fundos são cotados na BM&FBovespa. Pelas características dos fundos imobiliários, alguns indicadores demonstrados nesta planilha podem não espelhar de forma adequada os fundos imobiliários;

****A Reciprev possui fundos de investimentos em participação com diversos prazos de retornos do capital investido, com os respectivos benchmarks. Alguns possuem curva "J" maiores ou menores do que outros. Pelas características dos fundos de investimentos em participação, alguns indicadores demonstrados nesta planilha podem não espelhar de forma adequada os fundos de participações;

*****A Reciprev possui fundos de investimentos em direitos creditórios com diversos prazos de retorno do capital investido, com os respectivos benchmarks. Pelas características dos fundos de investimentos em direitos creditórios alguns indicadores demonstrados nesta planilha podem não espelhar de forma adequada os fundos de direitos creditórios;

*****O Ativo livre de risco considerado foi o CDI.

> Retorno médio mensal: Quanto o ativo proporcionou de retorno médio mensal, considerando o período avaliado do ativo, tendo como base o período da observação (**);

> Retorno médio anual: Quanto o ativo proporcionou de retorno médio anual, considerando o período avaliado do ativo, tendo como base o período da observação (**);

> Maior Retorno: É o maior retorno do ativo, considerando o período avaliado, tendo como base o período da observação (**);

> Menor Retorno: É o menor retorno do ativo, considerando o período avaliado, tendo como base o período da observação (**);

> Quantidade de mês positivo: É a quantidade de meses em que o ativo obteve retorno acima de zero, considerando o período avaliado do ativo, tendo como base o período da observação (**);

> Quantidade de mês negativo: É a quantidade de meses em que o ativo obteve retorno abaixo de zero, considerando o período avaliado do ativo, tendo como base o período da observação (**);

> Quantidade de mês acima do Benchmark: É a quantidade de meses em que o ativo obteve retorno acima do Benchmark, considerando o período avaliado do ativo, tendo como base o período da observação (**);

> Quantidade de mês abaixo do Benchmark: É a quantidade de meses em que o ativo obteve retorno abaixo do Benchmark, considerando o período avaliado do ativo, tendo como base o período da observação (**);

> Risco mensal em todo período: Trata-se da volatilidade mensal do ativo. A volatilidade é calculada através do desvio padrão da série histórica dos retornos do ativo, tendo como base os períodos informados na observação (**);

> Risco anual em todo período: Trata-se da volatilidade anual do ativo. A volatilidade é calculada através do desvio padrão da série histórica dos retornos do ativo, tendo como base os períodos informados na observação (**), e trazidos para o período anual;

> Retorno em relação ao Benchmark: Trata-se do comparativo do retorno do ativo em todo o período avaliado em relação ao retorno esperado do ativo(Benchmark);

> Sharpe: Dado pela fórmula: (Retorno médio anual do ativo - Retorno médio anual do CDI) / (Risco anual do Ativo). Portanto, quanto maior, melhor;

> Information Ration: Dado pela fórmula: (Retorno médio anual do ativo - Retorno médio anual do Benchmark) / Treck Erro). Portanto, quanto maior, melhor;

> Treck Error: Trata-se do desvio padrão das diferenças entre os retornos do ativo e o retorno do benchmark do referido ativo. Portanto, quanto mais próximo de zero, melhor;

> VAR (95%): Menor retorno possível dentro do intervalo de confiança de 95%. Portanto, quanto mais próximo de zero, melhor;

> Sharpe Modificado: Dado pela fórmula: (Retorno médio anual do ativo - Retorno médio anual do CDI) / (Risco anual do Ativo - Risco anual do CDI). Comparado com o Índice Sharpe, leva em consideração o risco do "ativo livre de risco". Portanto, quanto maior, melhor;

> Índice Beta: Indicador que mede a sensibilidade do ativo em relação a uma carteira, no caso foi considerado o benchmark de cada ativo. Ativos financeiros de Beta elevado são considerados mais agressivos, enquanto os de Beta mais baixo são mais conservadores;

> Erro Quadrático Médio (EQM): Mede o quanto o retorno de um fundo se afasta do retorno de seu benchmark. Quanto mais próximo de zero maior a aderência dos retornos ao benchmark;

RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIFIN - ANO DE 2016

DATA	SALDO		RENDIMENTO
31/01/2016	R\$	48.112,98 R\$	15.695,14
29/02/2016	R\$	101.401,28 R\$	43.486,28
31/03/2016	R\$	59.251,01 R\$	48.765,12
30/04/2016	R\$	110.949,72 R\$	52.754,18
31/05/2016	R\$	93.447,68 R\$	60.235,05
30/06/2016	R\$	45.448,66 R\$	62.449,17
31/07/2016			
31/08/2016			
30/09/2016			
31/10/2016			
30/11/2016			
31/12/2016			
TOTAL		R\$	283.384,94

	SALDO TOTAL DAS CARTEIRAS: RECIPREV E RECIFIN		RENDIMENTO TOTAL DAS CARTEIRAS RECIPREV E RECIFIN
31/01/2016	R\$	1.117.373.059,83 R\$	16.594.411,25
29/02/2016	R\$	1.146.169.769,90 R\$	18.217.785,21
31/03/2016	R\$	1.188.237.517,90 R\$	31.460.130,32
30/04/2016	R\$	1.227.860.282,82 R\$	27.619.865,69
31/05/2016	R\$	1.244.727.573,26 R\$	6.077.291,26
30/06/2016	R\$	1.275.669.024,02 R\$	19.507.875,09
31/07/2016	R\$	- R\$	-
31/08/2016	R\$	- R\$	-
30/09/2016	R\$	- R\$	-
31/10/2016	R\$	- R\$	-
30/11/2016	R\$	- R\$	-
31/12/2016	R\$	- R\$	-

EQUIPE DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

PANORAMA MACROECONÔMICO

China: Os dados da produção da indústria e do varejo vieram em linha com as expectativas do mercado. De outro lado, as expectativas dos investimentos ficaram abaixo das expectativas do mercado.

Zona do Euro: O resultado da consulta à população, com 51,9% dos britânicos foram favoráveis à saída do Reino Unido da União Europeia. O resultado está levantando dúvidas a respeito das implicações políticas e econômicas na Europa. O resultado provocou forte reação nas bolsas de valores do mundo, com reduções significativas. Inclusive, encontra-se em andamento solicitações para a realização de novo plebiscito.

Estados Unidos: Prorrogado as expectativas de aumento da taxa de juros, apesar da redução do aumento do número de postos de trabalho, com a criação de 38 mil empregos, ante uma expectativa de cerca de 160 mil vagas, e da preocupação com o "Brexit" no Reino Unido.

Brasil: O PIB apresentou pequena melhora. O consumo das famílias e também os investimentos continuam em forte queda. O Copom manteve a taxa de juros básicas em 14,25% ao ano. As expectativas é de que podemos fechar o ano com inflação na casa dos 7,3%, e a possibilidade de redução da taxa de juros por volta de outubro para novembro de 2016.

DESEMPENHO DA CARTEIRA

Meta Atuarial da Carteira de Investimentos Reciprev – Ano 2016: **IPCA + 6% ao ano.**

IPCA de junho de 2016: **0,35%**. Corresponde à meta atuarial de **0,86%**, para junho de 2016.

Meta Atuarial Acumulada no ano de 2016: **7,43%**.

Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em junho de 2016: **1,56%**, Sendo: Renda Fixa **1,56%** e Renda Variável **1,56%**.

Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2016: **10,71%**.

Percentual de atingimento da meta atuarial acumulada no ano de 2016: **144,21%**.

A Carteira de Investimentos Reciprev possui a maior parte de seus recursos aplicados em fundos que têm como benchmark o CDI (Certificado de Depósito Interbancário), o IMA (Índice de Mercado da Anbima); IDAKA (Índice de Duração Constante ANBIMA), e IRF-M (Índice de Renda Fixa do Mercado), compostos por títulos prefixados e pós-fixados, bem como atrelados a índice de preço com ou sem cupom semestral. A inflação de junho de 2016, medida pela IPCA, ficou dentro das expectativas do mercado, em especial, considerando as projeções do IPCA para o ano de 2016 entre 6,9 a 7,3%. Em cenário de inflação elevada, as dificuldades de se atingir os benchmarks são maiores, tendo em vista os diversos fatores envolvidos, tais como: marcação à mercado dos ativos, projeções da taxa básica de juros (SELIC META), etc.

Este é o relatório mensal da Carteira de Investimentos do Fundo Previdência Reciprev em conformidade com a Portaria MPS Nº 519, de 24 de agosto de 2011, Art. 3º, V, que submetemos ao Comitê de Investimentos da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde para deliberação e controle.

Os fundos de investimentos que compõem a Carteira de Investimentos Reciprev e que possuem lâminas constam do Portal da Transparência na pasta "Lâminas", do respectivo mês do referido relatório.

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Divisão de Investimentos

Paulo José Barbosa
Equipe Investimentos

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE (RECIPREV)

Concordamos com as informações do presente relatório.

Manoel Carneiro Soares Cardoso
Diretor Presidente

Francisco Canindé Antunes Furtado Junior
Diretor Executivo

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Divisão de Investimentos

Marcos Assis Mendes de Lima
Representante Titular da Secretaria de Finanças da Prefeitura do Recife

Waldemir Almeida Moreira
Representante Suplente da Secretaria de Finanças da Prefeitura do Recife

Roberto Wagner Martins
Representante Titular da Secretaria de Administração e Gestão de Pessoas da Prefeitura do Recife

Gilson Luís Azevedo do Nascimento
Representante Suplente da Secretaria de Administração e Gestão de Pessoas da Prefeitura do Recife

Originais assinados e arquivados na Reciprev

RECIFE (PE)

08 DE JULHO DE 2016