

Relatório Mensal de Investimentos

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



Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

Relatórios da Carteira de Investimentos RECIPREV

Data da Posição: **31/08/2017**

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores)		
Renda Fixa		
BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	R\$	719.641.522,10
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	466.057.474,36
TESOURO NACIONAL	R\$	173.261.203,11
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	54.275.591,76
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. - DTVM	R\$	51.388.369,69
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	36.787.744,93
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$	16.684.344,05
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$	11.913.549,96
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	7.760.321,88
NOVA SRM ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS E FINANÇAS S.A.	R\$	6.710.121,21
TERCON INVESTIMENTOS LTDA	R\$	5.928.208,86
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$	2.833.233,26
TOTAL RF	R\$	1.553.241.685,18
Renda Variável		
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$	30.382.889,62
ATICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	18.555.126,45
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$	11.348.005,32
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	8.299.788,58
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	7.580.185,79
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$	7.286.793,10
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	7.216.596,20
MHFT INVESTIMENTOS S.A.	R\$	6.555.285,44
BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOB.	R\$	5.976.077,98
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$	5.466.309,87
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	4.076.000,00
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$	1.112.421,01
TOTAL RV	R\$	113.855.479,36
PATRIMÔNIO	R\$	1.667.097.164,55

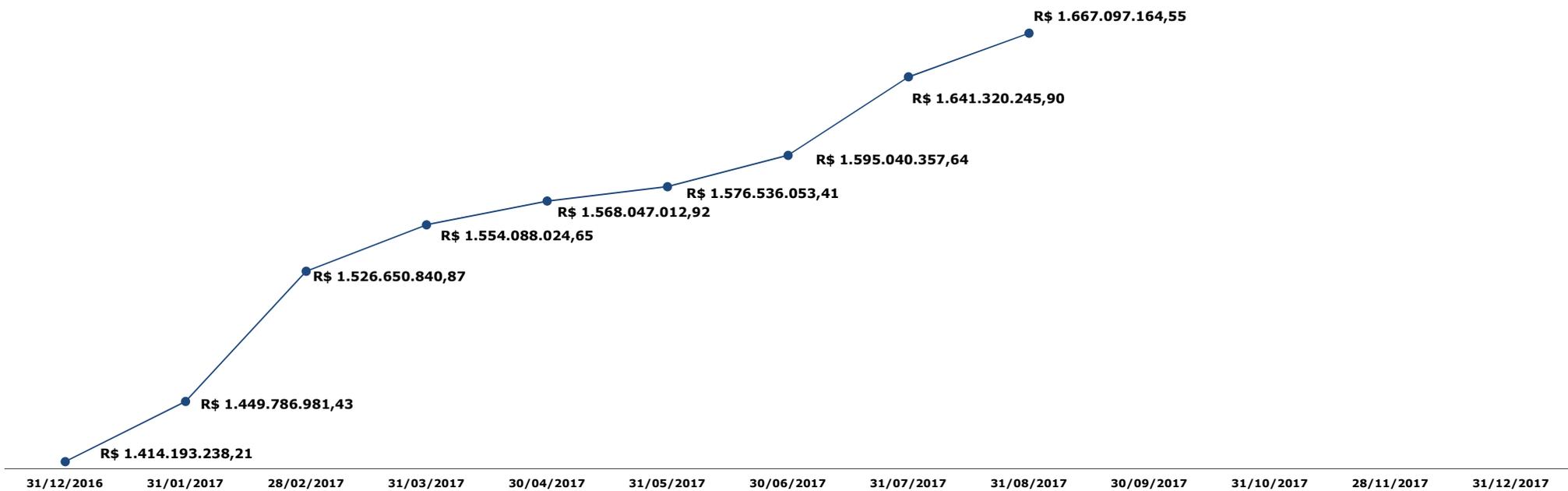
Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores)		
Renda Fixa		
BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	R\$	719.641.522,10
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	466.057.474,36
TESOURO NACIONAL	R\$	173.261.203,11
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$	54.275.591,76
BANCO BRADESCO S.A.	R\$	51.388.369,69
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	36.787.744,93
SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	R\$	23.231.885,21
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A	R\$	16.684.344,05
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	R\$	11.913.549,96
TOTAL RF	R\$	1.553.241.685,18
Renda Variável		
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$	31.513.372,88
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A	R\$	30.382.889,62
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	R\$	13.976.340,58
BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	R\$	12.554.808,86
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	7.580.185,79
SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	R\$	7.216.596,20
ICLA TRUST DTVM S.A.	R\$	6.555.285,44
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	4.076.000,00
TOTAL RV	R\$	113.855.479,36
PATRIMÔNIO	R\$	1.667.097.164,55

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
AZ LEGAN VALORE FIRF CP	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	0,71%	11,23%	R\$ 11.913.549,96	19.782.311/0001-88	0,90%	8,09%	Curto Prazo	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	Risco Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	0,04%	0,05%	R\$ 611.800,84	13.077.415/0001-05	0,70%	7,20%	Curto Prazo	FI de Renda Fixa	Risco Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	18,08%	6,02%	R\$ 301.341.460,49	13.322.205/0001-35	0,98%	9,30%	Curto Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Muito Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	15,43%	4,63%	R\$ 257.215.652,64	07.442.078/0001-05	1,32%	10,93%	Curto Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	0,00%	0,00%	R\$ -	13.327.340/0001-73	1,34%	12,24%	Curto Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	1,28%	7,44%	R\$ 21.344.255,24	15.486.093/0001-83	1,67%	11,63%	Longo Prazo	FI de Renda Fixa	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	4,64%	7,55%	R\$ 77.393.183,69	19.303.795/0001-35	0,97%	6,13%	Longo Prazo	FI de Renda Fixa	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	1,55%	8,13%	R\$ 25.820.447,76	19.523.306/0001-50	1,57%	11,46%	Longo Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	0,78%	3,68%	R\$ 12.995.583,56	20.734.937/0001-06	0,68%	7,92%	Médio Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	1,37%	2,03%	R\$ 22.919.137,89	19.523.305/0001-06	0,99%	9,53%	Médio Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Baixo
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. - DTVM	BANCO BRADESCO S.A.	3,08%	3,09%	R\$ 51.388.369,69	08.702.798/0001-25	1,39%	11,37%	Curto Prazo	FI Renda Fixa/Referenciados RF	Risco Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	5,77%	7,48%	R\$ 96.125.100,00	18.598.256/0001-08	-1,86%	5,88%	Médio Prazo	FI de Renda Fixa	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,27%	5,61%	R\$ 21.251.040,00	18.598.288/0001-03	-0,91%	12,06%	Longo Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,53%	2,61%	R\$ 25.555.700,00	20.139.595/0001-78	-0,93%	12,06%	Longo Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Médio

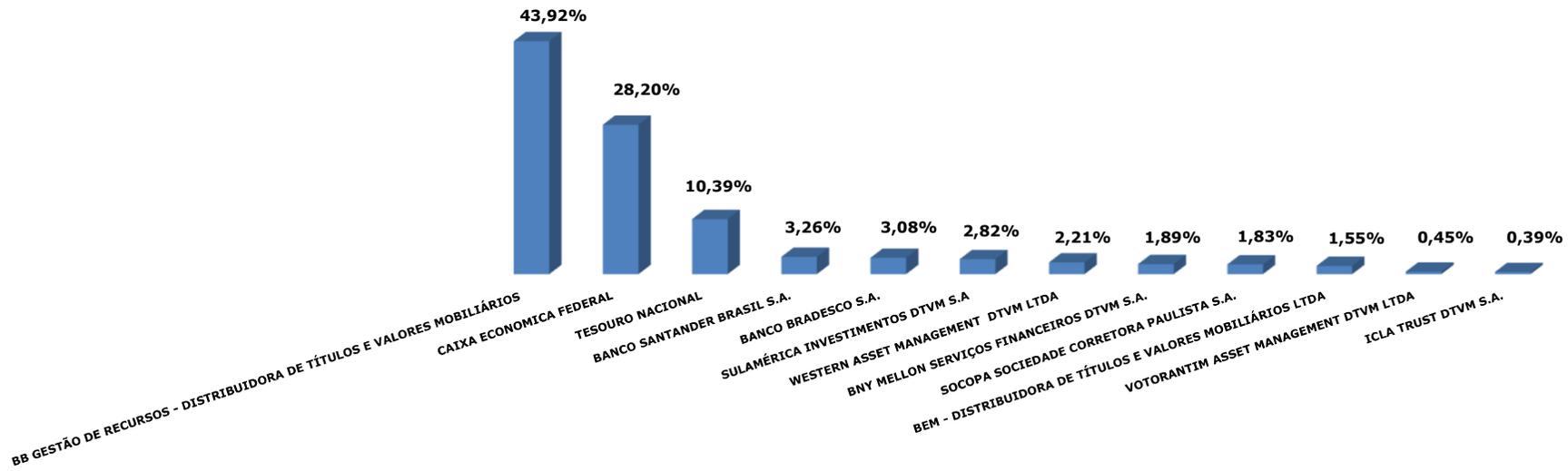
Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,35%	10,87%	R\$ 5.772.552,00	19.769.046/0001-06	-1,09%	10,91%	Longo Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,54%	3,69%	R\$ 9.054.948,00	20.139.534/0001-00	-1,13%	10,89%	Longo Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	8,74%	2,32%	R\$ 145.783.834,24	11.060.913/0001-10	1,24%	9,66%	Curto Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	9,57%	1,10%	R\$ 159.565.328,89	10.740.670/0001-06	0,89%	8,15%	Curto Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANAMENTO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,18%	1,25%	R\$ 2.948.971,23	19.542.287/0001-00	1,00%	9,00%	Longo Prazo	FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL VALE II	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	0,08%	9,05%	R\$ 1.319.339,05	23.426.324/0001-91	1,04%	2,10%	Médio Prazo	FI em Direitos Creditórios - Aberto - Cota Sênior	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL VALE (SÊNIORES SÉRIES 4)	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	0,09%	14,76%	R\$ 1.518.482,14	11.278.761/0001-26	0,87%	6,20%	Médio Prazo	FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior	Risco Alto
SUL INVEST FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL (SÊNIORES SÉRIES 6)	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	0,17%	3,70%	R\$ 2.833.233,26	09.257.784/0001-02	0,96%	6,62%	Médio Prazo	FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	0,47%	13,38%	R\$ 7.760.321,88	13.633.964/0001-19	1,00%	9,27%	Curto Prazo	FI em Direitos Creditórios - Aberto - Cota Sênior	Risco Alto
RDF - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	0,19%	9,44%	R\$ 3.090.387,67	19.425.700/0001-56	1,20%	3,60%	Médio Prazo	FI em Direitos Creditórios - Aberto - Cota Sênior	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS SRM - SENIOR 3	NOVA SRM ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS E FINANÇAS S.A.	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	0,40%	6,64%	R\$ 6.710.121,21	09.260.031/0001-56	0,96%	8,89%	Médio Prazo	FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior	Risco Alto
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	3,26%	4,11%	R\$ 54.275.591,76	13.455.117/0001-01	1,24%	9,64%	Curto Prazo	FI 100% Títulos TN	Risco Médio
SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RF CRÉDITO PRIVADO	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	1,00%	1,33%	R\$ 16.684.344,05	04.899.128/0001-90	0,80%	7,65%	Curto Prazo	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	Risco Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	10,39%	0,00%	R\$ 173.261.203,11		1,37%	12,38%	Curto Prazo	Títulos Tesouro Nacional	Risco Médio
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	2,21%	2,19%	R\$ 36.787.744,93	03.499.367/0001-90	0,79%	8,32%	Curto Prazo	FI de Renda Fixa	Risco Médio
Renda Fixa			93,17%		R\$ 1.553.241.685,18			1,19%			
AZ LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	0,40%	8,17%	R\$ 6.689.547,47	14.550.994/0001-24	6,95%	16,39%	Curto Prazo	FI em Ações	Risco Alto
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	0,28%	1,57%	R\$ 4.658.457,85	11.392.165/0001-72	8,47%	31,83%	Curto Prazo	FI em Ações	Risco Muito Alto
BB AÇÕES PIPE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	0,36%	5,40%	R\$ 5.976.077,98	17.116.227/0001-08	6,93%	22,42%	Médio Prazo	FI em Ações	Risco Alto

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPIREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	0,00%	0,00%	R\$ -	10.418.335/0001-88	7,24%	14,65%	Curto Prazo	FI em Ações	Risco Muito Alto
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	0,33%	4,83%	R\$ 5.466.309,87	20.716.161/0001-93	0,69%	10,47%	Longo Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,24%	2,54%	R\$ 4.076.000,00	17.098.794/0001-70	-6,63%	5,99%	Curto Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
REIT RIVIERA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	0,43%	22,79%	R\$ 7.216.596,20	16.841.067/0001-99	0,34%	5,52%	Curto Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
ÁTICO FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	ATICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	0,48%	4,56%	R\$ 7.981.599,53	12.312.767/0001-35	-0,14%	-1,05%	Médio Prazo	FI em Participações - Fechado	Risco Muito Alto
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	ATICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	0,63%	3,14%	R\$ 10.573.526,91	11.490.580/0001-69	-0,14%	-1,03%	Curto Prazo	FI em Participações - Fechado	Risco Muito Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	MHFT INVESTIMENTOS S.A.	ICLA TRUST DTVM S.A.	0,39%	4,03%	R\$ 6.555.285,44	17.213.821/0001-09	-0,12%	-0,88%	Longo Prazo	FI em Participações - Fechado	Risco Muito Alto
TERRAS BRASIL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS	0,07%	9,94%	R\$ 1.112.421,01	19.412.474/0001-79	-0,53%	-3,42%	Médio Prazo	FI em Participações - Fechado	Risco Muito Alto
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	0,44%	9,60%	R\$ 7.286.793,10	09.289.072/0001-75	5,25%	15,41%	Curto Prazo	FI em Ações	Risco Alto
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	1,62%	6,16%	R\$ 26.932.581,17	13.823.084/0001-05	0,82%	8,32%	Curto Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Médio
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FIM CRÉDITO PRIVADO	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	0,21%	9,52%	R\$ 3.450.308,45	19.225.709/0001-13	0,63%	9,03%	Médio Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Alto
VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO	VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	0,45%	4,34%	R\$ 7.580.185,79	14.491.564/0001-89	1,15%	10,26%	Médio Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Médio
WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	0,00%	0,00%	R\$ -	16.703.203/0001-84	8,28%	6,67%	Curto Prazo	FI Ações referenciados	Risco Muito Alto
XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	0,50%	1,67%	R\$ 8.299.788,58	11.616.403/0001-86	0,96%	3,58%	Curto Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Muito Alto
Renda Variável			6,83%		R\$ 113.855.479,36			1,63%			
Total Geral			100,00%		R\$ 1.667.097.164,55		Rentabilidade Reciprev	1,22%			

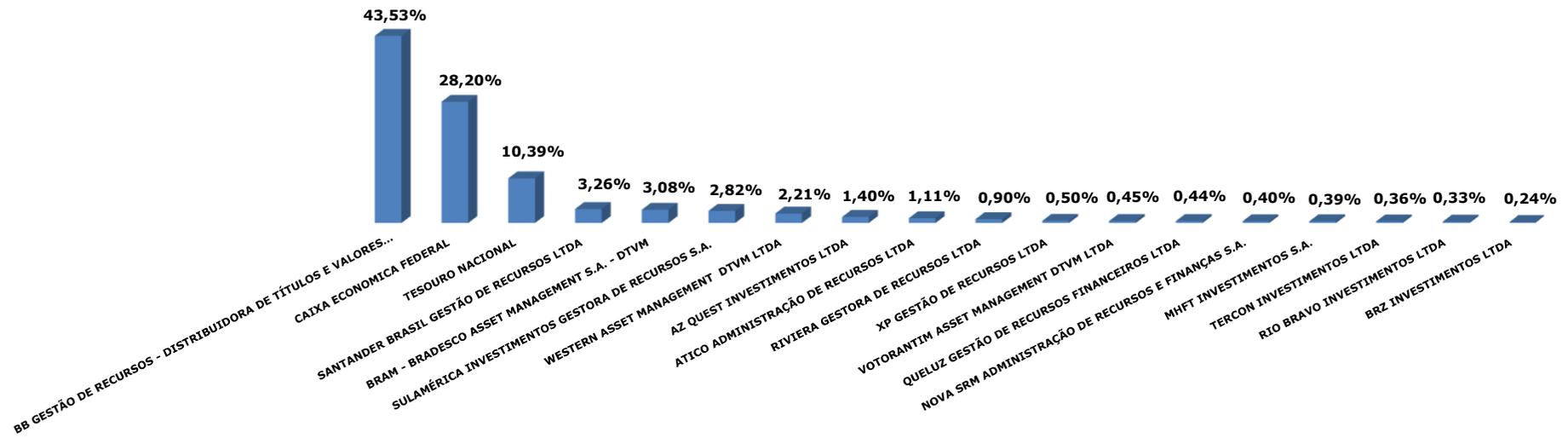
Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2017



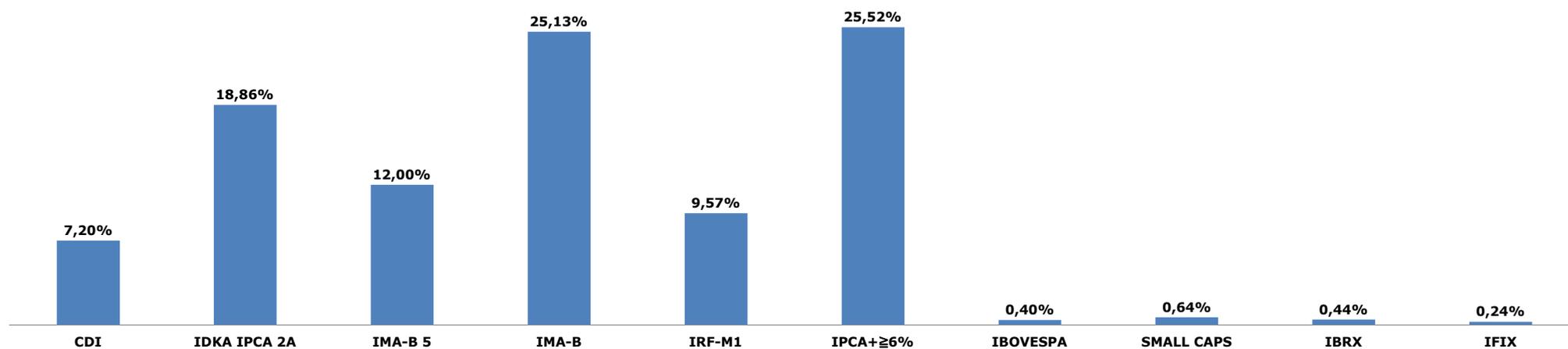
Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV - 2017



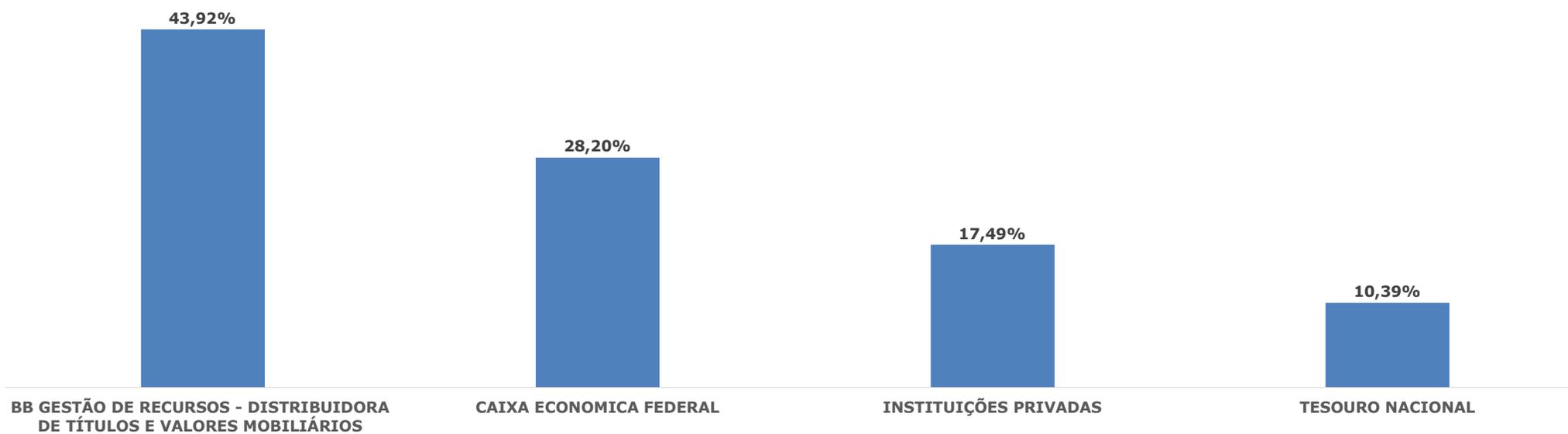
Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV - 2017



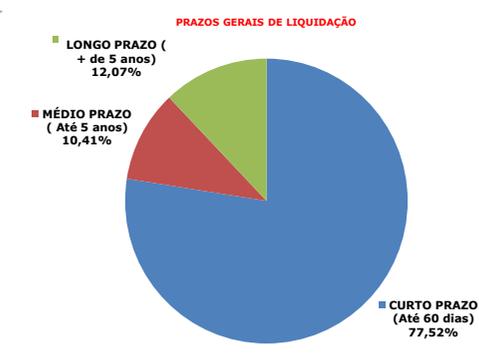
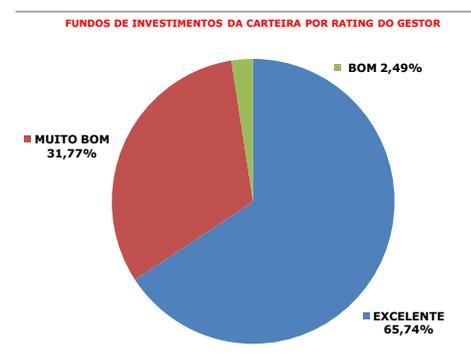
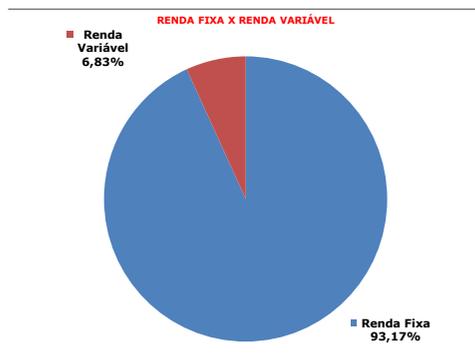
Percentual de Composição da Carteira RECIPREV por Benchmark - 2017



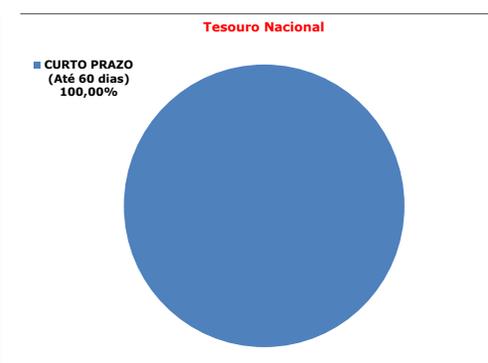
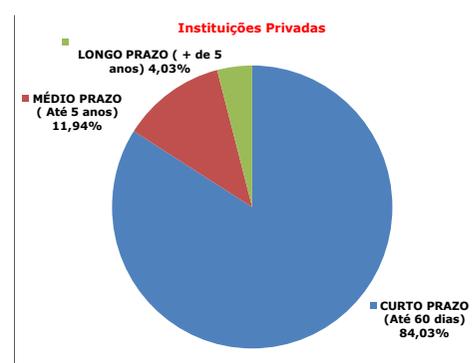
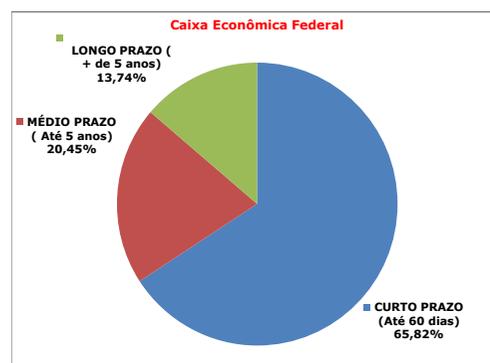
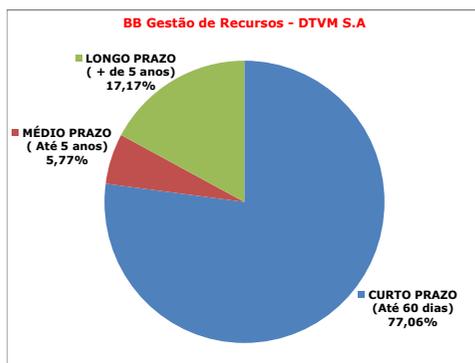
Resumo do Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV - 2017



Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2017

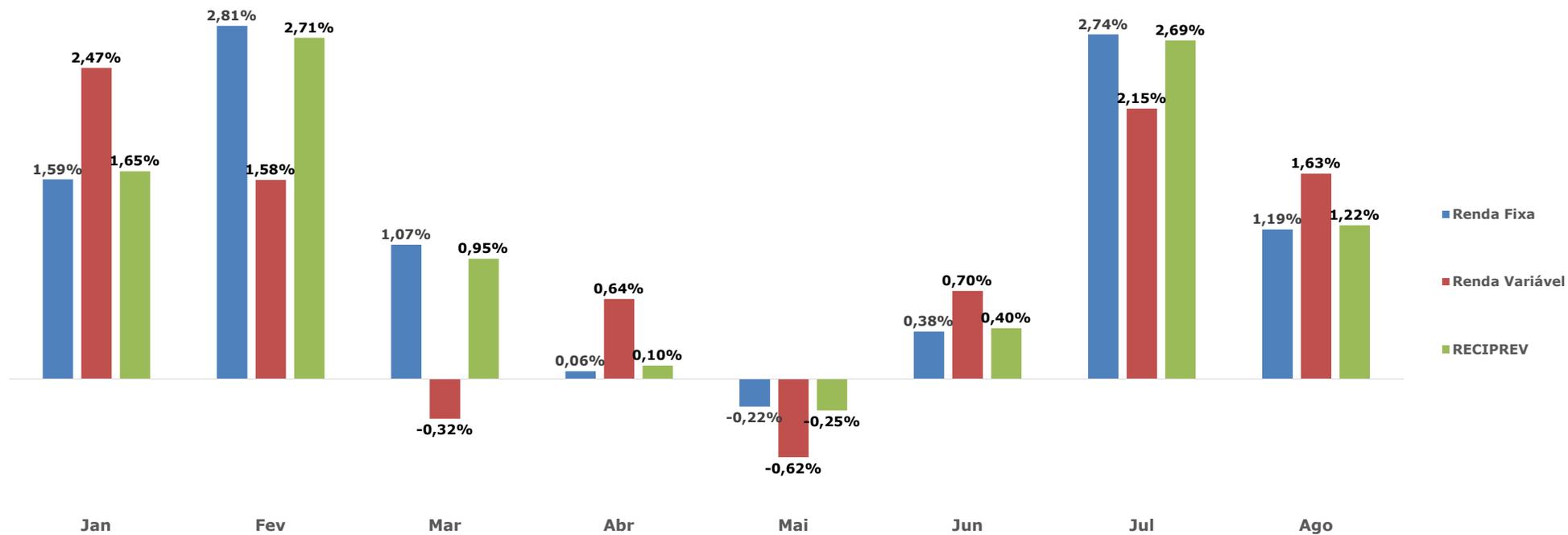


Prazos de Liquidação da Carteira de Investimentos - 2017

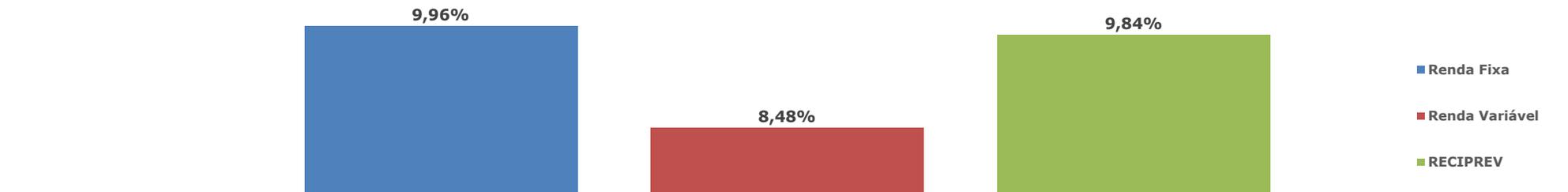


SEGMENTO	Tipo de Ativo	Limite da Reolução CMN (%)	Posição Atual da Carteira (R\$)	Posição Atual da Carteira (%)	Estratégia de Alocação - Política de Investimento de 2017			Meta de rentabilidade para o Exercício por tipo de Ativo	Resumo da Estratégia				Estratégia de alocação para os próximos 5 anos	
					Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)		% de Recursos do Ativo	Índice	Meta de Rentabilidade	Resumo da Estratégia	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
Renda Variável	FI Ações referenciados	30,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,31%	30,00%	13,50%	100,00%	IBRX	13,50%	Aumento	5,00%	30,00%
	Sub-total		R\$ 0,00	0,00%		0,31%								
	FI de Índices Referenciados em Ações	20,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%		5,00%	20,00%
	Sub-total		R\$ 0,00	0,00%		0,00%								
	FI em Ações	15,00%	R\$ 24.610.876,40	1,48%	2,00%	2,49%	15,00%	13,50%	28,00% 55,00% 17,00%	IBOVESPA Outros IBRX	13,50% 13,50% 13,50%	Aumento Aumento Aumento	7,00%	15,00%
	Sub-total		R\$ 24.610.876,40	1,48%		2,49%								
	FI Multimercado - Aberto	5,00%	R\$ 46.262.863,99	2,78%	2,50%	2,62%	5,00%	12,02%	75,00% 25,00%	CDI IPCA+≥6%	12,38% 11,12%	Aumento Aumento	4,00%	5,00%
	Sub-total		R\$ 46.262.863,99	2,78%		2,62%								
	FI em Participações - Fechado	5,00%	R\$ 26.222.832,91	1,57%	1,00%	1,13%	5,00%	1,12%	100,00%	IPCA+≥6%	1,12%	Redução	1,00%	5,00%
	Sub-total		R\$ 26.222.832,91	1,57%		1,13%								
	FI Imobiliários	5,00%	R\$ 16.758.906,06	1,01%	1,50%	1,65%	5,00%	10,07%	84,00% 16,00%	IPCA+≥6% Outros	10,07% 9,36%	Aumento Manutenção	3,00%	5,00%
	Sub-total		R\$ 16.758.906,06	1,01%		1,65%								
Sub-total		R\$ 113.855.479,36	6,83%		8,20%									
Total por Renda Fixa e Variável			R\$ 1.667.097.164,55	100,00%		100,00%								

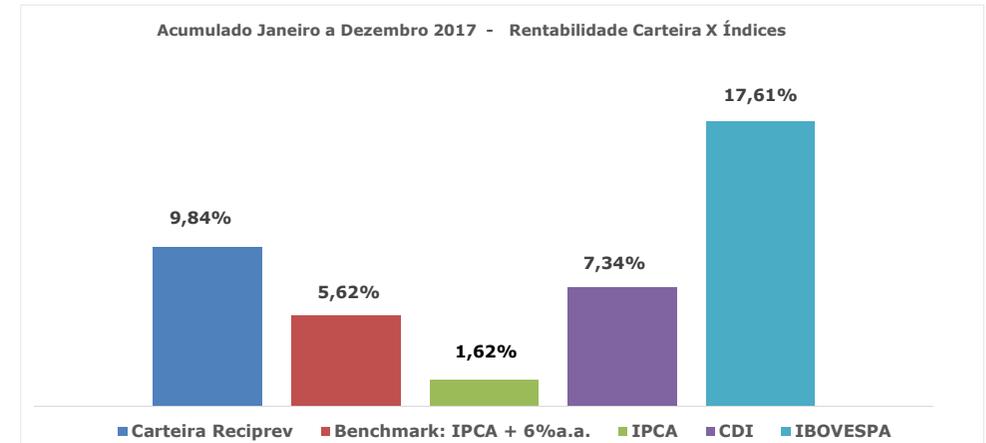
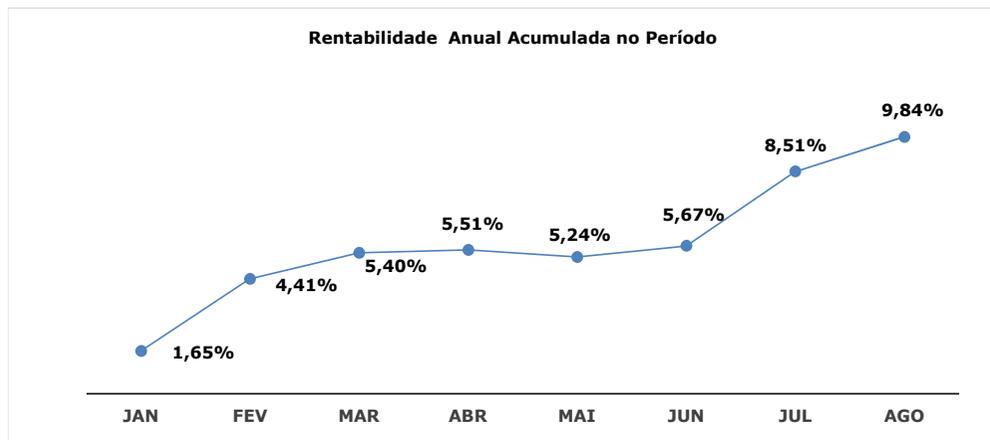
Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2017



Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2017



Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2017



RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

ANO 2017

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

DATA	SALDO R\$	RENDIMENTO R\$	% RENDIMENTO CARTEIRA
31/01/2017	R\$ 1.449.786.981,43	R\$ 23.345.617,62	1,65%
28/02/2017	R\$ 1.526.650.840,87	R\$ 39.317.320,46	2,71%
31/03/2017	R\$ 1.554.088.024,65	R\$ 14.558.248,57	0,95%
30/04/2017	R\$ 1.568.047.012,92	R\$ 1.606.274,78	0,10%
31/05/2017	R\$ 1.576.536.053,41	-R\$ 3.975.998,31	-0,25%
30/06/2017	R\$ 1.595.040.357,64	R\$ 6.325.212,98	0,40%
31/07/2017	R\$ 1.641.320.245,90	R\$ 42.948.085,73	2,69%
31/08/2017	R\$ 1.667.097.164,57	R\$ 20.050.546,15	1,22%
30/09/2017	R\$ -	R\$ -	0,00%
31/10/2017	R\$ -	R\$ -	0,00%
30/11/2017	R\$ -	R\$ -	0,00%
31/12/2017	R\$ -	R\$ -	0,00%
TOTAL		R\$ 144.175.307,98	9,84%

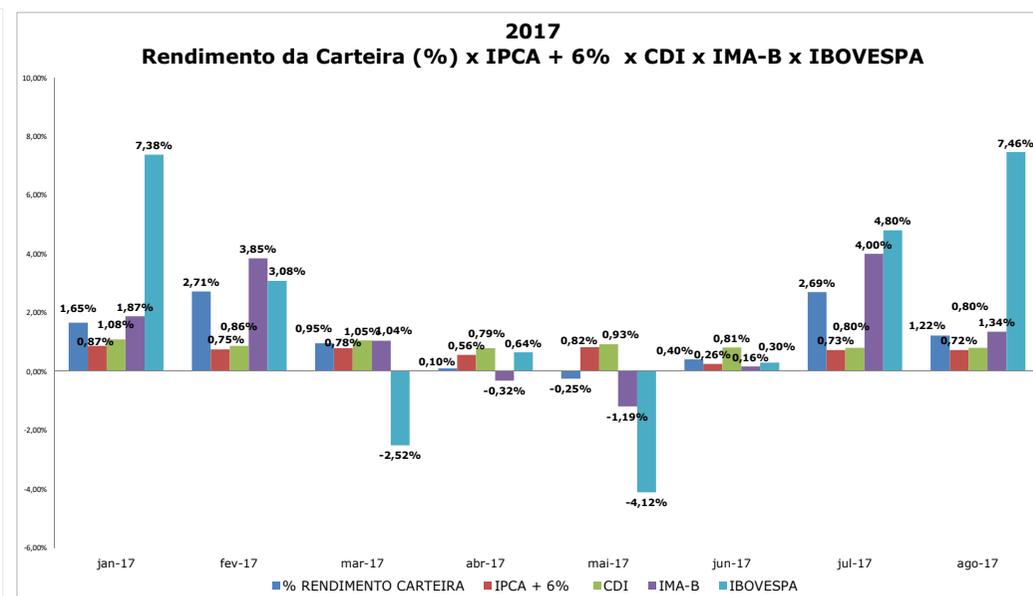
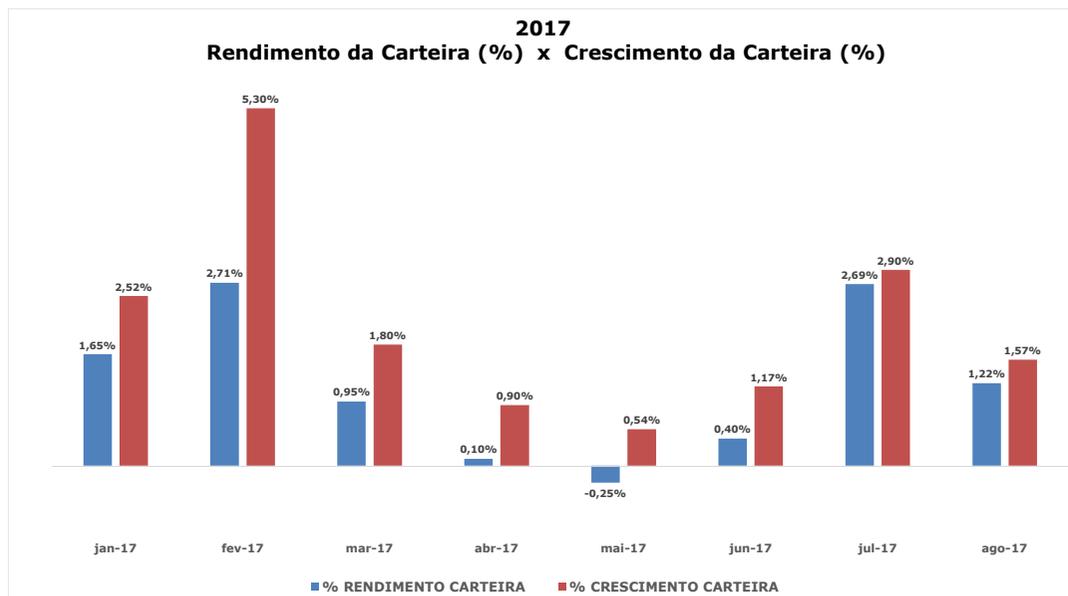
FUNDO FINANCEIRO RECIFIN

SALDO R\$	RENDIMENTO R\$
R\$ 33.606,47	R\$ 18.940,04
R\$ 31.663,28	R\$ 22.957,46
R\$ 41.907,86	R\$ 46.205,76
R\$ 56.915,93	R\$ 35.435,48
R\$ 133.192,88	R\$ 40.587,61
R\$ 66.272,13	R\$ 36.375,46
R\$ 46.323,69	R\$ 30.073,51
R\$ 120.742,72	R\$ 52.528,32
R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 283.103,64

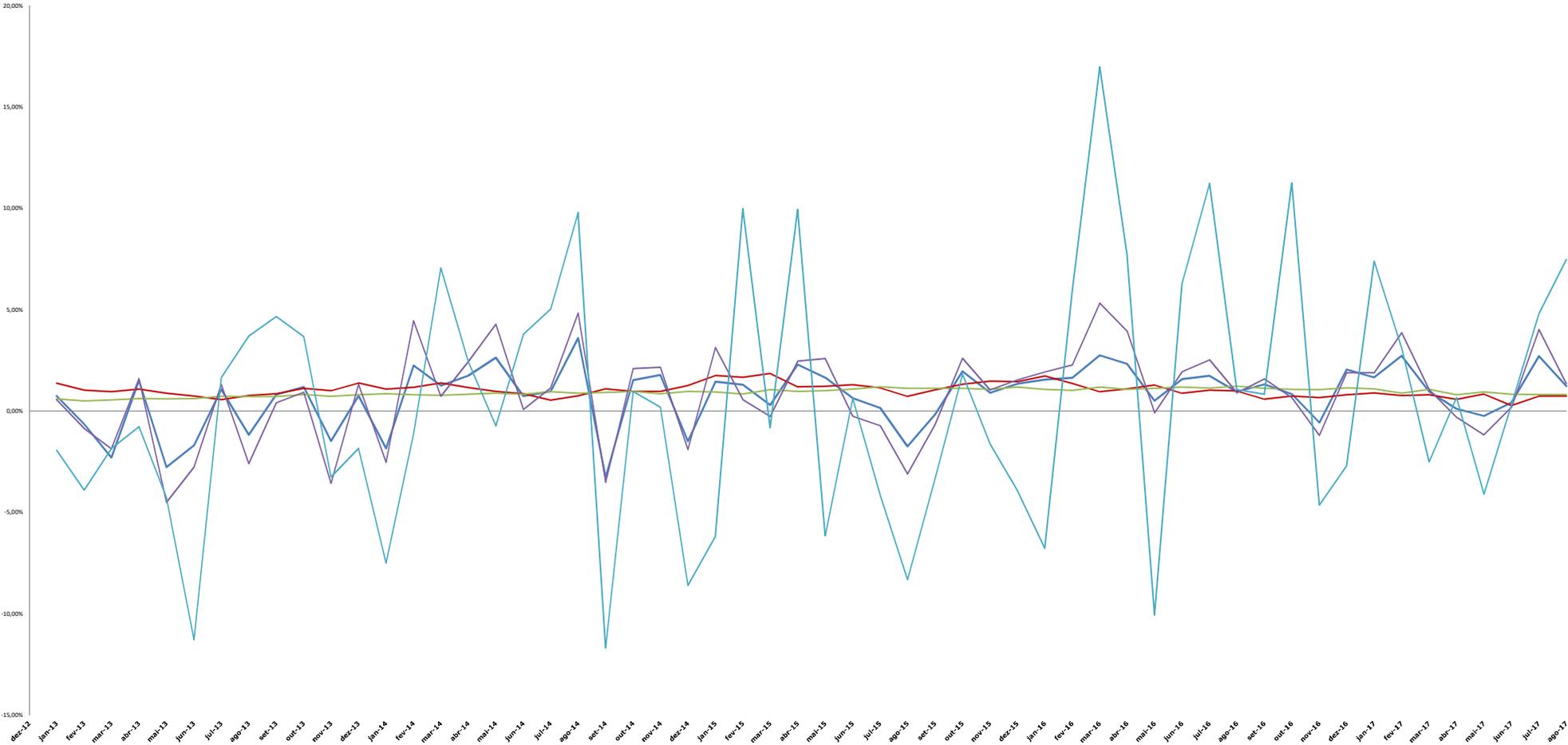
TOTAL FUNDOS: RECIPREVE E RECIFIN

SALDO R\$	RENDIMENTO R\$
R\$ 1.449.820.587,90	R\$ 23.364.557,66
R\$ 1.526.682.504,15	R\$ 39.340.277,92
R\$ 1.554.129.932,51	R\$ 14.604.454,33
R\$ 1.568.103.928,85	R\$ 1.641.710,26
R\$ 1.576.669.246,29	-R\$ 3.935.410,70
R\$ 1.595.106.629,77	R\$ 6.361.588,44
R\$ 1.641.366.569,59	R\$ 42.978.159,24
R\$ 1.667.217.907,29	R\$ 20.103.074,47
R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 144.458.411,62

GRÁFICO COMPARATIVO DA CARTEIRA RECIPREV



2013 - 2017
Rendimento da Carteira(%) x IPCA + 6% x CDI x IMA-B x IBOVESPA



—% RENDIMENTO CARTEIRA —IPCA + 6% —CDI —IMA-B —IBOVESPA

FLUXO MENSAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPIREV

ANO 2017

MÊS	AGOSTO				
RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES		COMPETÊNCIA	VALOR	ACUMULADO ANUAL	
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		Contribuição de 07 de 2017 e Parcelamento 20/60 e transferência de recursos da 10.156-7 para 7.909-X, no valor total de R\$ 571.292,16	R\$ 9.555.134,78	R\$	74.176.174,38
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		Contribuição de 07 de 2017	R\$ 6.018.298,22	R\$	58.877.972,88
IASC (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		-	R\$ -	R\$	238.594,48
IASC (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		-	R\$ -	R\$	213.692,95
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		Contribuição 07 de 2017	R\$ 48.312,17	R\$	332.208,21
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		Contribuição 07 de 2017	R\$ 38.625,71	R\$	266.839,24
TOTAL			R\$ 15.660.370,88	R\$	134.105.482,14
RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS			VALOR	ACUMULADO ANUAL	
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)			R\$ 35.000,00	R\$	377.500,00
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)			R\$ 28.600,00	R\$	247.030,85
REIT RIVIERA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)			R\$ -	R\$	385.144,21
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ 57.201,28	R\$	333.841,30
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ -	R\$	561.070,16
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ 2.239.545,93	R\$	4.453.874,41
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ 684.403,54	R\$	1.362.943,47
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ 646.253,43	R\$	1.285.723,26
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ 367.939,67	R\$	732.016,53
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - (CUPOM/JUROS)			R\$ -	R\$	4.552.944,84
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			R\$ 2.739.813,84	R\$	5.465.946,89
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			R\$ 559.007,42	R\$	1.117.979,26
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			R\$ 677.920,20	R\$	1.358.656,88
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			R\$ 149.873,85	R\$	298.624,55
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			R\$ 238.795,77	R\$	484.102,52
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIRETOS EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSECTORIAL VALE (SÊNIORES SÉRIES 4) - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ 737.825,23	R\$	1.631.359,97
SUL INVEST FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISECTORIAL (SÊNIORES SÉRIES 6) - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ 382.204,32	R\$	902.643,09
SUL INVEST FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISECTORIAL (SÊNIORES SÉRIES 7) - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ -	R\$	2.575.683,18
TOTAL			R\$ 9.544.384,48	R\$	28.127.085,37
FOLHA DE PAGAMENTO			VALOR	ACUMULADO ANUAL	
CONSIGNAÇÃO DA FOLHA DE APO/PPR			-R\$ 9.707.998,21	-R\$	23.569.094,96
TOTAL			-R\$ 9.707.998,21	-R\$	23.569.094,96
PAGAMENTOS DIVERSOS			VALOR	ACUMULADO ANUAL	
TARIFA DE CUSTÓDIA DO FUNDO FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS			-R\$ 14,25	-R\$	112,95
TARIFA DE CUSTÓDIA TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)			R\$ -	-R\$	3.900,00
CUSTO SELIC TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)			-R\$ 348,65	-R\$	2.955,98
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPIREV			-R\$ 226.000,00	-R\$	1.808.000,00
TOTAL			-R\$ 226.362,90	-R\$	1.814.968,93
RESUMO GERAL			VALOR	ACUMULADO ANUAL	
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES			R\$ 15.660.370,88	R\$	134.105.482,14
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS			R\$ 9.544.384,48	R\$	28.127.085,37
TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS			-R\$ 9.707.998,21	-R\$	23.569.094,96
TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS			-R\$ 226.362,90	-R\$	1.814.968,93
TOTAL			R\$ 15.270.394,25	R\$	136.848.503,62

ESTATÍSTICA DA CARTERIA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPEV

FUNDO	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	Tracking Error
ÁTICO FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	IPCA+9,00%	-0,02%	-0,28%	9,25%	-3,38%	5	59	1	63	1,25%	4,33%	-55,22%	-2,61	-3,66	4,43%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	IPCA+ 10,50%	0,76%	9,48%	39,38%	-0,33%	6	74	3	77	5,49%	19,02%	-37,45%	-0,08	-0,42	18,99%
AZ LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,25%	3,00%	11,71%	-11,45%	39	29	31	37	4,89%	16,93%	-5,28%	-0,47	-0,10	9,43%
AZ LEGAN VALORE FIRF CP	CDI	1,02%	12,96%	1,43%	0,74%	40	0	28	12	0,16%	0,55%	0,90%	0,56	0,96	0,32%
BB AÇÕES PIPE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Índice Small Cap	0,88%	11,15%	8,48%	-8,58%	32	19	31	20	4,08%	14,12%	46,72%	-0,06	0,90	10,62%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,81%	10,16%	1,17%	0,43%	76	0	1	75	0,19%	0,65%	-4,83%	-1,33	-13,11	0,07%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA IPCA 2A	1,01%	12,80%	3,50%	-0,91%	68	8	29	47	0,81%	2,80%	-3,90%	0,63	-1,25	0,57%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	1,00%	12,72%	5,33%	-4,50%	59	21	17	63	2,05%	7,10%	-2,15%	0,24	-1,60	0,23%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	1,10%	14,10%	2,53%	-0,52%	29	1	13	17	0,69%	2,38%	-4,55%	0,40	-0,44	4,92%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA IPCA 2A	1,08%	13,72%	2,21%	0,32%	28	0	10	18	0,44%	1,52%	-4,26%	0,35	-1,05	2,04%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + 6,00%	1,06%	13,55%	2,05%	0,45%	43	0	24	19	0,34%	1,19%	1,49%	0,91	0,72	0,65%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + 6,00%	1,26%	16,19%	5,14%	-2,54%	35	9	25	19	1,65%	5,71%	10,43%	0,66	0,54	5,75%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	1,20%	15,42%	3,69%	-2,41%	35	7	20	22	1,47%	5,10%	-2,83%	0,57	-0,35	2,72%
BRÁDESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	IMA-B	1,03%	13,08%	5,14%	-4,37%	59	21	44	36	2,07%	7,16%	-0,04%	0,29	-0,02	0,33%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	IPCA + 6,9506%	0,99%	12,57%	4,31%	-1,67%	32	4	18	18	1,14%	3,95%	-1,84%	-0,07	-0,17	4,07%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IPCA + 6%	0,84%	10,60%	2,11%	-2,09%	40	3	21	22	0,84%	2,89%	-7,63%	-0,64	-0,99	2,51%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,13%	14,37%	5,89%	-2,76%	33	11	21	23	1,90%	6,58%	-5,44%	0,30	-0,52	3,36%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,04%	13,22%	4,05%	-2,76%	23	7	14	16	1,61%	5,59%	-6,37%	0,01	1,87	3,97%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,16%	14,81%	7,83%	-4,91%	28	14	21	21	2,72%	9,42%	-4,61%	0,24	-0,45	3,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,09%	13,90%	7,77%	-4,02%	20	10	15	15	2,45%	8,50%	-4,97%	0,09	-0,30	7,78%

FUNDO	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	Tracking Error
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	IFIX	0,87%	10,92%	27,60%	-16,19%	30	14	22	22	7,07%	24,50%	-3,57%	-0,06	-0,05	23,08%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBRX	0,64%	7,95%	8,31%	-7,48%	50	30	42	38	3,45%	11,94%	25,85%	-0,26	0,35	10,39%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B 5	1,01%	12,81%	3,61%	-1,05%	72	8	14	66	0,82%	2,83%	-1,80%	0,63	-1,75	0,18%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRFM-1	0,89%	11,23%	1,62%	0,28%	80	0	9	71	0,25%	0,87%	-1,22%	0,24	-4,59	0,04%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO	IPCA + 11,00%	1,29%	16,65%	2,27%	0,05%	40	0	17	23	0,39%	1,34%	-0,81%	2,98	-0,28	1,03%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	125% do DI	1,22%	15,66%	1,53%	0,44%	43	0	30	13	0,20%	0,71%	-0,40%	4,52	-0,45	0,29%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIRETOS EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL VALE (SÊNIORES SÉRIES 4)	IPCA+7,00 %	1,11%	14,15%	2,07%	0,27%	44	0	23	21	0,34%	1,19%	0,05%	1,46	0,03	0,62%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	IPCA+8,00%	0,12%	1,41%	14,74%	-0,55%	1	53	1	53	2,03%	7,02%	-43,01%	-1,46	-1,95	6,91%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS SRM - SÊNIOR 3	120% do DI	1,16%	14,79%	1,46%	0,22%	45	0	31	14	0,21%	0,73%	-0,64%	3,32	-8,34	0,02%
RDF - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	150% do DI	1,52%	19,85%	1,83%	1,15%	35	0	25	10	0,19%	0,68%	-0,09%	10,31	-0,32	0,11%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL VALE II	125% do DI	1,04%	13,25%	1,04%	1,04%	2	0	2	0	0,00%	0,00%	0,09%	1545,75	52,75	0,01%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	IPCA+6,00%	0,89%	11,27%	11,67%	-8,30%	49	31	40	40	4,01%	13,90%	-8,41%	0,02	-0,11	13,89%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Índice Small Cap	1,09%	13,83%	10,64%	-10,30%	52	28	54	26	4,51%	15,61%	119,21%	0,18	1,31	9,66%
REIT RIVIERA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	IPCA+7,50%	0,90%	11,40%	4,69%	-2,14%	32	13	16	29	1,57%	5,45%	-10,54%	-0,17	-0,64	5,26%
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B 5	0,97%	12,31%	2,96%	-1,20%	64	7	10	61	0,81%	2,80%	-1,10%	0,49	-2,11	0,10%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	CDI	0,93%	11,75%	1,42%	0,28%	65	0	51	14	0,25%	0,88%	3,93%	0,90	1,46	0,54%
SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RF CRÉDITO PRIVADO	CDI	0,90%	11,33%	1,30%	0,50%	80	0	71	9	0,20%	0,68%	1,88%	0,46	1,08	0,29%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FIM CRÉDITO PRIVADO	IPCA+6,00%	0,93%	11,74%	2,25%	-3,36%	38	3	21	20	0,91%	3,14%	-3,54%	-0,27	-0,36	3,31%
SUL INVEST FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL (SÊNIORES SÉRIES 6)	IPCA + 7,50%	1,15%	14,66%	2,19%	0,29%	44	0	21	23	0,37%	1,28%	0,00%	1,76	0,00	0,45%
TERRAS BRASIL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	IPCA+6,00%	-2,67%	-27,76%	0,21%	-62,23%	1	38	0	39	9,93%	34,40%	-76,57%	-1,18	-1,18	34,41%
VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	1,12%	14,31%	2,91%	-1,06%	44	3	27	20	0,74%	2,55%	3,91%	0,81	0,44	2,56%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	CDI	0,92%	11,57%	2,19%	-0,27%	78	2	46	34	0,42%	1,45%	3,36%	0,38	0,43	1,29%
XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	CDI	1,04%	13,21%	3,62%	-2,41%	71	9	46	34	1,03%	3,55%	13,91%	0,62	0,64	3,42%
CARTEIRA RECIPEV	IPCA+6% ano	0,93%	11,69%	4,55%	-2,78%	63	17	39	41	1,40%	4,85%	-6,11%	0,14	-0,22	4,85%

CONCEITOS

* **Base de dados:** Economática; 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);

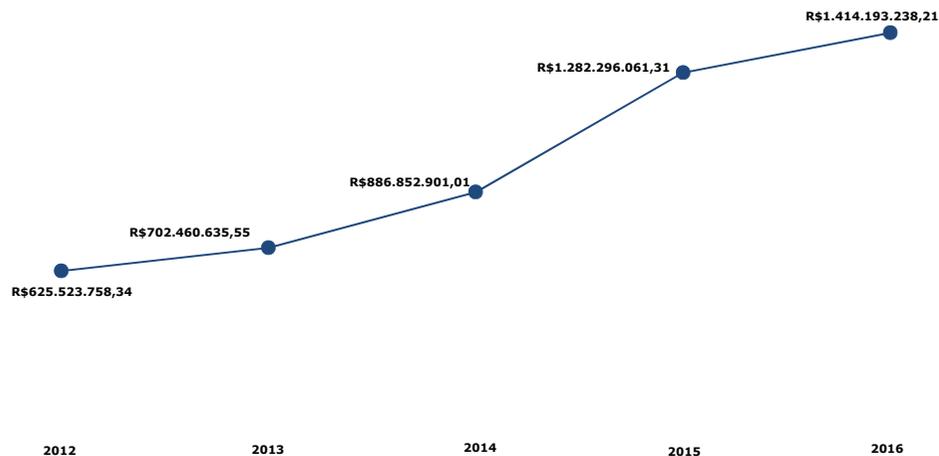
➤ **Sharpe:** Dado pela fórmula: (Retorno médio anual do ativo - Retorno médio anual do CDI) / (Risco anual do Ativo). Portanto, quanto maior, melhor;

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

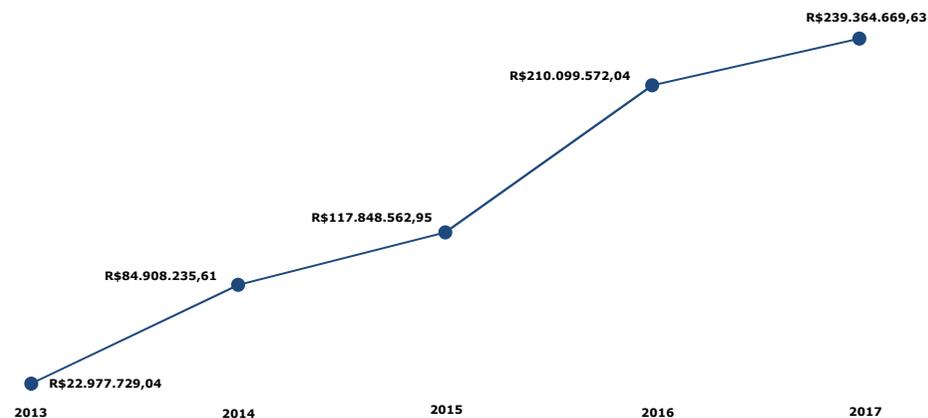
➤ **Treck Error:** Trata-se do desvio padrão das diferenças entre os retornos do ativo e o retorno do benchmark do referido ativo. Portanto, quanto mais próximo de zero, melhor;

EVOLUÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS E SUPERAVIT ATUARIAIS DA CARTERIA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

Fundo Previdenciário Reciprev - Total de Ativos



Fundo Previdenciário Reciprev - Superavit Atuarial



EQUIPE DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

PANORAMA MACROECONÔMICO

O PIB do segundo trimestre ficou em 0,2% TT, acima da expectativa da mediana das projeções do mercado. De acordo com as expectativas de mercado do relatório FOCUS do dia 1º de setembro, a expectativa para o PIB 2017 subiu para 0,50%, e permaneceu em 2% para 2018. A expectativa para o IPCA de 2017 foi redizida para 3,38% e 4,18% para 2018. Já a SELIC meta foi reduzida para 7,25% para 2017 e permanece em 7,5% para 2018.

DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

IPCA do mês de	AGOSTO	0,19%	Sendo	Meta Atuarial para o Ano de 2017		IPCA + 6,00% ao ano	
Meta Atuarial para o mês de	AGOSTO	0,72%		Meta Atuarial acumulada no ano de 2017		5,62%	
Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em	AGOSTO	1,22%		Renda Fixa	1,19%	Renda Variável	1,63%
Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2017		9,84%		Percentual de atingimento da meta atuarial acumulada no ano de 2017		175,02%	

A Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário 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); IDKA (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. c

Este é o relatório mensal da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário 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 Batbosa
Equipe Investimentos

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA AUTARQUI 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

Waldemir Almeida Moreira

Representante Titular da Secretaria de Finanças da Prefeitura do Recife

Roberto Wagner Martins Mateus

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

Originais assinados e arquivados na Reciprev

Recife (PE) 06 de setembro de 2017