

# 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 RECIPREV

Data da Posição: 30/09/2016

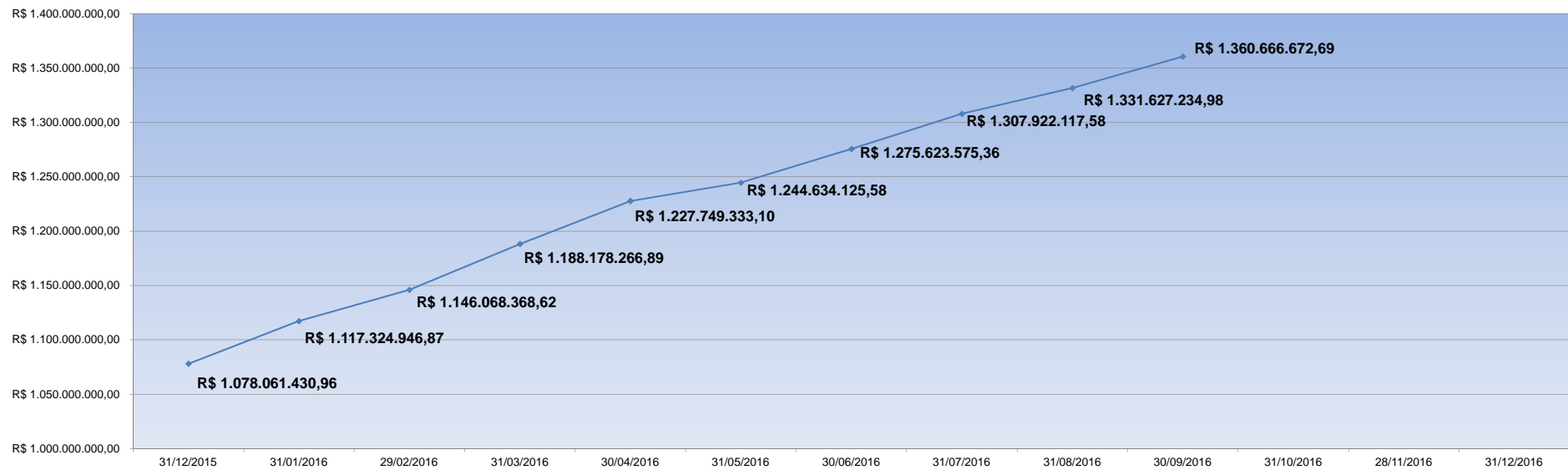
Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores)		
Renda Fixa		
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	617.991.969,70
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	345.050.170,31
TESOURO NACIONAL	R\$	159.237.937,99
BRAM – BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	R\$	40.471.918,37
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	26.506.845,54
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	R\$	14.975.266,02
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	R\$	14.593.823,90
AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	7.351.544,66
GRADUAL CTVM S.A.	R\$	6.067.161,51
NOVA S R M ADM DE RECURSOS S.A.	R\$	5.930.617,61
TERCON INVESTIMENTOS LTDA	R\$	5.313.852,29
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	4.351.293,86
<b>TOTAL RF</b>	<b>R\$</b>	<b>1.247.842.401,77</b>
Renda Variável		
ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	18.821.471,79
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	R\$	17.712.975,19
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	14.221.491,50
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	13.838.305,80
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	7.678.284,88
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	7.180.052,92
VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	R\$	6.688.924,19
MHFT INVESTIMENTOS S.A.	R\$	6.636.105,54
AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	5.555.283,87
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$	5.337.597,26
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	4.536.181,35
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$	3.451.608,19
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$	1.165.988,44
<b>TOTAL RV</b>	<b>R\$</b>	<b>112.824.270,92</b>
<b>PATRIMÔNIO</b>	<b>R\$</b>	<b>1.360.666.672,69</b>

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores)		
Renda Fixa		
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	617.991.969,70
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	345.050.170,31
TESOURO NACIONAL	R\$	159.237.937,99
BANCO BRADESCO S.A.	R\$	40.471.918,37
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	26.506.845,54
GRADUAL CTVM S.A.	R\$	17.311.631,41
SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	R\$	14.975.266,02
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$	14.593.823,90
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A	R\$	7.351.544,66
SOCOPA S.A.	R\$	4.351.293,86
<b>TOTAL RF</b>	<b>R\$</b>	<b>1.247.842.401,77</b>
Renda Variável		
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	R\$	29.951.364,86
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	20.341.891,50
SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	R\$	17.712.975,19
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	14.221.491,50
BEM - DTVM LTDA	R\$	10.091.465,23
SOCOPA S.A.	R\$	7.180.052,92
VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	R\$	6.688.924,19
ICLA TRUST	R\$	6.636.105,54
<b>TOTAL RV</b>	<b>R\$</b>	<b>112.824.270,92</b>
<b>PATRIMÔNIO</b>	<b>R\$</b>	<b>1.360.666.672,69</b>

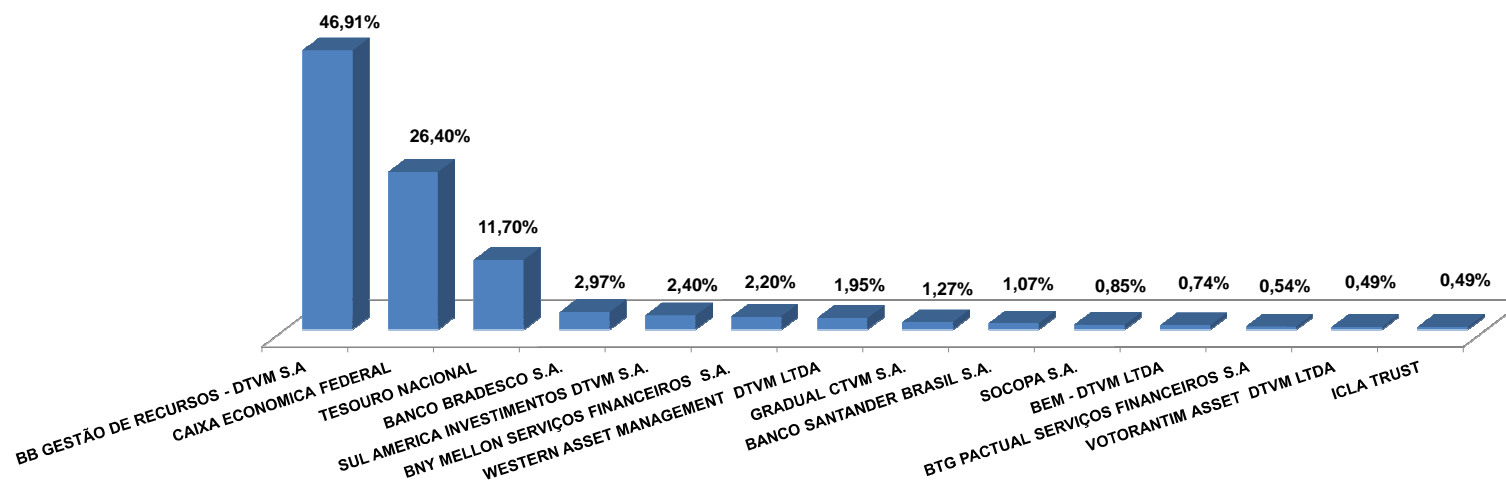
Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Rentabilidade RECIPREV (anual)	Tipo de fundo na Resolução 3.922/10	Artigo da Resolução 3.922/10
AZ LEGAN VALORE FI RF - CP	AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A	0,54%	9,86%	R\$ 7.351.544,66	19.782.311/0001-88	1,22%	10,54%	10,45%	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	0,03%	0,04%	R\$ 398.475,61	13.077.415/0001-05	1,04%	9,76%	10,10%	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	5,88%	1,20%	R\$ 80.030.740,54	13.322.205/0001-35	1,35%	12,40%	11,45%	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	7,48%	4,55%	R\$ 101.726.136,29	03.543.447/0001-03	1,39%	12,80%	12,09%	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	10,16%	2,51%	R\$ 138.282.185,44	07.442.078/0001-05	1,56%	21,80%	20,57%	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	1,97%	1,99%	R\$ 26.828.517,37	13.327.340/0001-73	1,64%	27,87%	26,38%	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	6,07%	1,03%	R\$ 82.647.778,94	11.328.882/0001-35	1,16%	10,97%	10,91%	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	2,54%	0,65%	R\$ 34.579.636,12	13.077.418/0001-49	1,11%	10,26%	10,23%	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	1,46%	7,44%	R\$ 19.824.217,27	15.486.093/0001-83	1,29%	19,61%	19,68%	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	5,56%	7,55%	R\$ 75.607.980,00	19.303.795/0001-35	0,85%	11,08%	11,09%	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	1,76%	8,13%	R\$ 23.936.663,55	19.523.306/0001-50	1,34%	18,72%	18,77%	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	0,92%	3,68%	R\$ 12.462.496,27	20.734.937/0001-06	1,33%	10,79%	11,63%	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	1,59%	2,03%	R\$ 21.667.142,30	19.523.305/0001-06	1,40%	12,66%	13,92%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I,"b"
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B	BRAM – BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	BANCO BRADESCO S.A.	2,97%	3,40%	R\$ 40.471.918,37	08.702.798/0001-25	1,67%	21,70%	21,18%	RF - FI Renda Fixa/Referenciados (IMA,	ARTIGO 7º,III,"a"
FI CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	6,92%	7,48%	R\$ 94.119.675,00	18.598.256/0001-08	0,80%	4,73%	10,77%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º,IV,"a"
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,44%	5,61%	R\$ 19.634.865,00	18.598.288/0001-03	1,12%	14,36%	21,10%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I,"b"
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,74%	3,06%	R\$ 23.630.080,00	20.139.595/0001-78	1,13%	13,78%	21,01%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I,"b"
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,39%	10,87%	R\$ 5.347.964,00	19.769.046/0001-06	0,66%	19,98%	27,12%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I,"b"
FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,62%	4,11%	R\$ 8.404.501,00	20.139.534/0001-00	0,66%	19,32%	26,98%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I,"b"
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,15%	0,35%	R\$ 15.710.760,92	14.386.926/0001-71	1,33%	12,42%	8,18%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I,"b"
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	4,60%	1,03%	R\$ 62.523.959,13	11.060.913/0001-10	1,40%	12,68%	11,54%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I,"b"
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	5,26%	1,37%	R\$ 71.602.812,56	10.740.658/0001-93	1,58%	21,72%	30,99%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I,"b"
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	2,71%	0,37%	R\$ 36.828.933,10	10.740.670/0001-06	1,17%	11,05%	10,99%	RF - FI 100% títulos TN	ARTIGO 7º, I,"b"
FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,31%	0,09%	R\$ 4.221.492,63	03.737.206/0001-97	1,10%	10,42%	10,41%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º,IV,"a"
FIDC CASAN SANEAMENTO SENIOR 1	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,22%	1,20%	R\$ 3.025.126,96	19.542.287/0001-00	1,29%	14,84%	14,84%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 4	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	GRADUAL CTVM S.A.	0,22%	6,28%	R\$ 2.974.338,95	11.278.761/0001-26	0,82%	11,30%	11,30%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	GRADUAL CTVM S.A.	0,17%	4,94%	R\$ 2.339.513,34	11.278.761/0001-26	0,54%	12,19%	12,19%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIDC SUL INVEST - MULTISSETORIAL SENIOR 6	GRADUAL CTVM S.A.	GRADUAL CTVM S.A.	0,22%	1,92%	R\$ 2.944.037,56	09.257.784/0001-02	0,82%	-3,34%	11,38%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIDC SUL INVEST - MULTISSETORIAL SENIOR 7	GRADUAL CTVM S.A.	GRADUAL CTVM S.A.	0,23%	2,04%	R\$ 3.123.123,95	09.257.784/0001-02	0,90%	12,19%	12,19%	RF - FIDC FECHADO	ARTIGO 7º,VII,"a"
FIQ FIDC - BRAZIL PLUS	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	SOCOPA S.A.	0,32%	11,55%	R\$ 4.351.293,86	14.239.052/0001-20	1,33%	12,63%	12,62%	RF - FIDC ABERTO	ARTIGO 7º,VI
FIQ FIDC - SRM SENIOR 3	NOVA S R M ADM DE RECURSOS S.A.	GRADUAL CTVM S.A.	0,44%	7,33%	R\$ 5.930.617,61	09.260.031/0001-56	1,33%	12,63%	12,63%	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.	1,07%	0,87%	R\$ 14.593.823,90	13.455.117/0001-01	1,39%	12,76%	12,32%	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.	1,10%	1,51%	R\$ 14.975.266,02	04.899.128/0001-90	1,21%	9,83%	9,82%	RF - FI RENDA FIXA "CRÉDITO PRIVADO"	ARTIGO 7º,VII,"b"
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	11,70%	0,00%	R\$ 159.237.937,99		2,05%	34,91%	34,91%	RF - TITULOS TESOURO NACIONAL - SELIC	Art. 7º, I, "a"
WESTERN ASSET DI REFERENCIADO FI	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	1,06%	1,39%	R\$ 14.447.191,87	00.819.875/0001-10	1,08%	10,30%	10,25%	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	0,89%	9,40%	R\$ 12.059.653,67	17.517.577/0001-78	1,73%	15,99%	7,97%	RF - FI DE RENDA FIXA	ARTIGO 7º, I,"b"
Renda Fixa			91,71%		R\$ 1.247.842.401,77			1,39%			

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPIEV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Rentabilidade RECIPIEV (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	0,41%	9,64%	R\$ 5.555.283,87	14.550.994/0001-24	0,87%	25,30%	24,85%	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%	2,57%	R\$ 3.451.608,19	11.392.165/0001-72	-1,43%	17,29%	17,29%	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	0,37%	5,40%	R\$ 5.000.130,38	17.116.227/0001-08	-0,47%	26,30%	26,30%	RV - FUNDO DE AÇÕES	ARTIGO 8º,III
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	0,29%	7,54%	R\$ 3.942.577,13	18.270.783/0001-99	0,31%	23,59%	-3,30%	RV - FUNDO DE AÇÕES	ARTIGO 8º,III
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	0,36%	4,38%	R\$ 4.895.598,29	10.418.335/0001-88	-0,09%	27,29%	-4,22%	RV - FUNDO DE AÇÕES	ARTIGO 8º,III
FI CAIXA BRASIL IPCA VII M CP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,75%	10,27%	R\$ 10.265.491,50	14.120.236/0001-76	0,81%	11,05%	11,05%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	0,39%	4,83%	R\$ 5.337.597,26	20.716.161/0001-93	1,30%	12,04%	12,04%	RV - FI IMOBILIÁRIO	ARTIGO 8º,VI
FII - CAIXA RIO BRAVO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,29%	2,54%	R\$ 3.956.000,00	17.098.794/0001-70	1,73%	35,06%	35,06%	RV - FI IMOBILIÁRIO	ARTIGO 8º,VI
FII - REIT RIVIERA	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	SOCOPA S.A.	0,53%	22,79%	R\$ 7.180.052,92	16.841.067/0001-99	-1,35%	11,79%	11,79%	RV - FI IMOBILIÁRIO	ARTIGO 8º,VI
FIP - ÁTICO FLORESTAL	ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	0,60%	4,58%	R\$ 8.097.324,30	12.312.767/0001-35	-0,13%	-1,18%	-1,18%	RV - FI EM PARTICIPAÇÕES	ARTIGO 8º,V
FIP - ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA	ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	0,79%	3,14%	R\$ 10.724.147,48	11.490.580/0001-69	-0,13%	-1,18%	-1,18%	RV - FI EM PARTICIPAÇÕES	ARTIGO 8º,V
FIP - CAIS MAUA DO BRASIL	MHFT INVESTIMENTOS S.A.	ICLA TRUST	0,49%	4,04%	R\$ 6.636.105,54	17.213.821/0001-09	-0,11%	-1,01%	-1,01%	RV - FI EM PARTICIPAÇÕES	ARTIGO 8º,V
FIP - TERRAS BRASIL	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	0,09%	9,94%	R\$ 1.165.988,44	19.412.474/0001-79	-0,40%	-62,81%	-62,81%	RV - FI EM PARTICIPAÇÕES	ARTIGO 8º,V
QUELUZ VALOR FIA	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BEM - DTVM LTDA	0,33%	12,23%	R\$ 4.536.181,35	09.289.072/0001-75	0,40%	21,65%	21,65%	RV - FUNDO DE AÇÕES	ARTIGO 8º,III
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FIM CP	SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA	SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	1,08%	3,66%	R\$ 14.646.304,25	13.823.084/0001-05	1,37%	9,87%	9,85%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FIM CP	SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA	SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	0,23%	8,80%	R\$ 3.066.670,94	19.225.709/0001-13	1,55%	3,42%	3,42%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
VOTORANTIM ATUARIAL M CP FI	VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	0,49%	4,31%	R\$ 6.688.924,19	14.491.564/0001-89	1,31%	13,05%	13,11%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
XP LONG SHORT FIC FIM	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	0,56%	1,23%	R\$ 7.678.284,88	11.616.403/0001-86	0,69%	20,47%	18,27%	RV - MULTIMERCADO ABERTO	ARTIGO 8º,IV
Renda Variável			8,29%		R\$ 112.824.270,92			0,42%			
Total Geral			100,00%		R\$ 1.360.666.672,69			Rentabilidade Reciprev	1,31%		

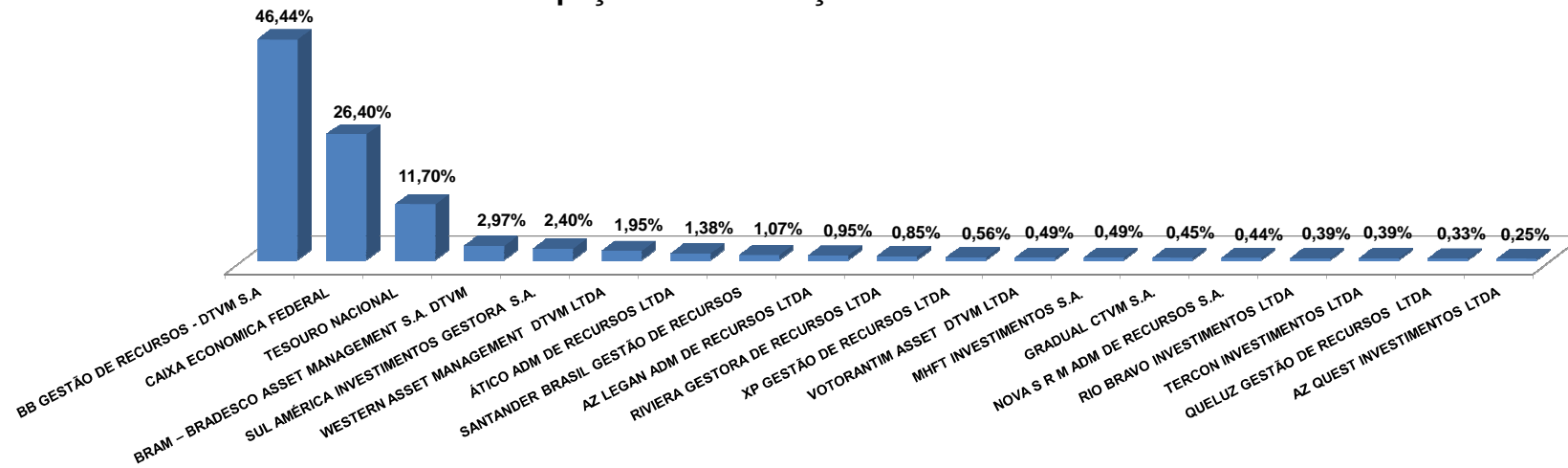
## Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV



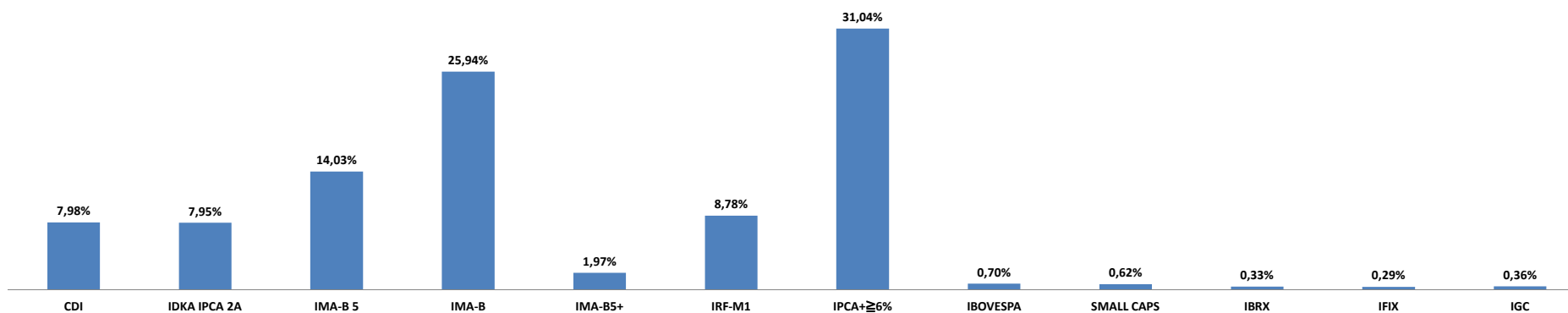
### Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



### Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV

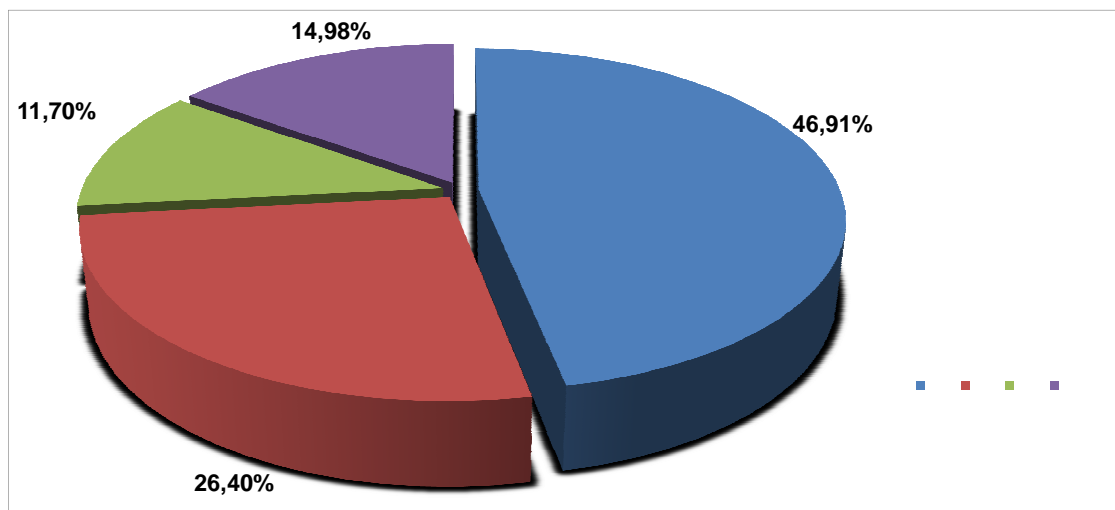


### Percentual de Composição da Carteira RECIPREV por Benchmark





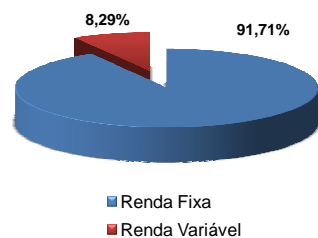
### Resumo do Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



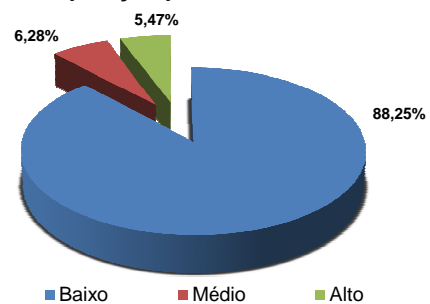
Administrador	
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	46,91%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	26,40%
TESOURO NACIONAL	11,70%
INSTITUIÇÕES PRIVADAS	14,98%
TOTAL	100,00%

## Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV

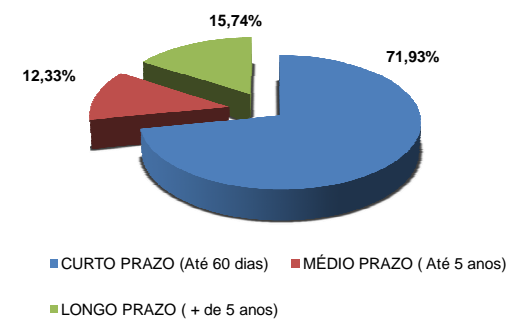
### Renda Fixa X Renda Variável



### Composição por Nível de Risco



### Prazos Gerais de Liquidação

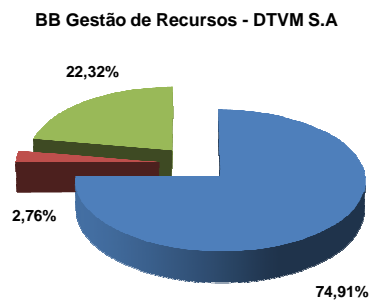


OBS:

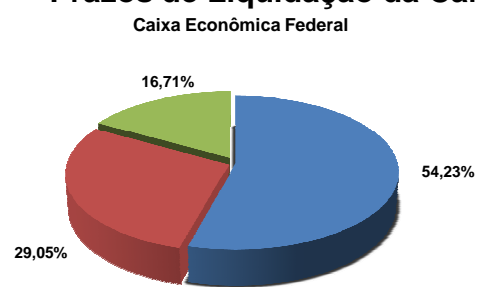
**Prazo de Liquidação:** O prazo de liquidação de um produto pode ou não ser igual ao prazo de resgate do mesmo. O prazo de resgate consta do regulamento do produto, já o prazo de liquidação leva em conta a venda do mesmo no mercado secundário, a preço de mercado. Por exemplo, um produto com prazo de 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						
<b>CARTEIRA GERAL</b>						
		RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	922.870.059,02	R\$	55.841.890,88	R\$	978.711.949,90 71,93%
MÉDIO PRAZO ( Até 5 anos)	R\$	123.893.802,68	R\$	43.842.688,79	R\$	167.736.491,47 12,33%
LONGO PRAZO ( + de 5 anos)	R\$	201.078.540,07	R\$	13.139.691,24	R\$	214.218.231,32 15,74%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>1.247.842.401,77</b>	<b>R\$</b>	<b>112.824.270,92</b>	<b>R\$</b>	<b>1.360.666.672,69 100,00%</b>
<b>BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.</b>						
		RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	464.493.470,32	R\$	8.838.175,42	R\$	473.331.645,74 74,91%
MÉDIO PRAZO ( Até 5 anos)	R\$	12.462.496,27	R\$	5.000.130,38	R\$	17.462.626,65 2,76%
LONGO PRAZO ( + de 5 anos)	R\$	141.036.003,11	R\$	-	R\$	141.036.003,11 22,32%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>617.991.969,70</b>	<b>R\$</b>	<b>13.838.305,80</b>	<b>R\$</b>	<b>631.830.275,50 100,00%</b>
<b>CAIXA ECONÔMICA FEDERAL</b>						
		RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	190.887.958,35	R\$	3.956.000,00	R\$	194.843.958,35 54,23%
MÉDIO PRAZO ( Até 5 anos)	R\$	94.119.675,00	R\$	10.265.491,50	R\$	104.385.166,50 29,05%
LONGO PRAZO ( + de 5 anos)	R\$	60.042.536,96	R\$	-	R\$	60.042.536,96 16,71%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>345.050.170,31</b>	<b>R\$</b>	<b>14.221.491,50</b>	<b>R\$</b>	<b>359.271.661,81 100,00%</b>
<b>TESOURO NACIONAL</b>						
		RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	159.237.937,99	R\$	-	R\$	159.237.937,99 100,00%
MÉDIO PRAZO ( Até 5 anos)	R\$	-	R\$	-	R\$	- 0,00%
LONGO PRAZO ( + de 5 anos)	R\$	-	R\$	-	R\$	- 0,00%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>159.237.937,99</b>	<b>R\$</b>	<b>-</b>	<b>R\$</b>	<b>159.237.937,99 100,00%</b>
<b>INTITUIÇÕES PRIVADAS</b>						
		RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		TOTAL
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$	108.250.692,36	R\$	43.047.715,47	R\$	151.298.407,83 71,93%
MÉDIO PRAZO ( Até 5 anos)	R\$	17.311.631,41	R\$	28.577.066,91	R\$	45.888.698,32 21,82%
LONGO PRAZO ( + de 5 anos)	R\$	-	R\$	13.139.691,24	R\$	13.139.691,24 6,25%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>125.562.323,77</b>	<b>R\$</b>	<b>84.764.473,62</b>	<b>R\$</b>	<b>210.326.797,39 100,00%</b>

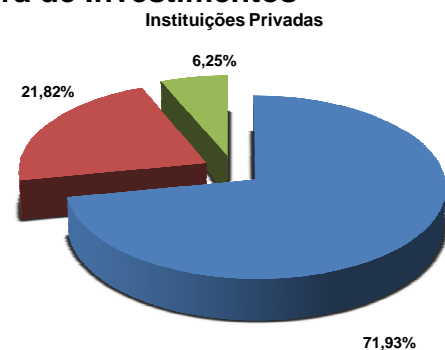
## Prazos de Liquidação da Carteira de Investimentos



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



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



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

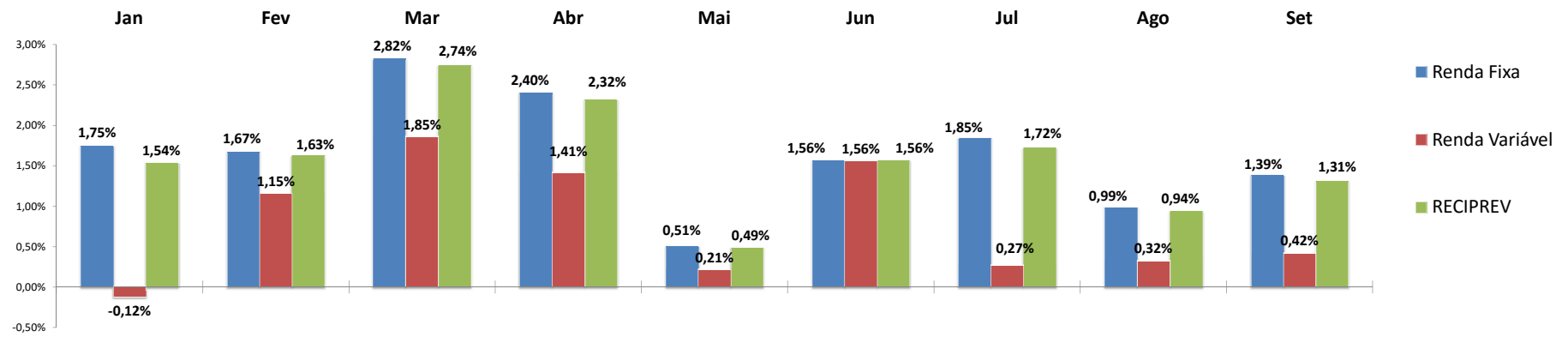


- CURTO PRAZO (Até 60 dias)

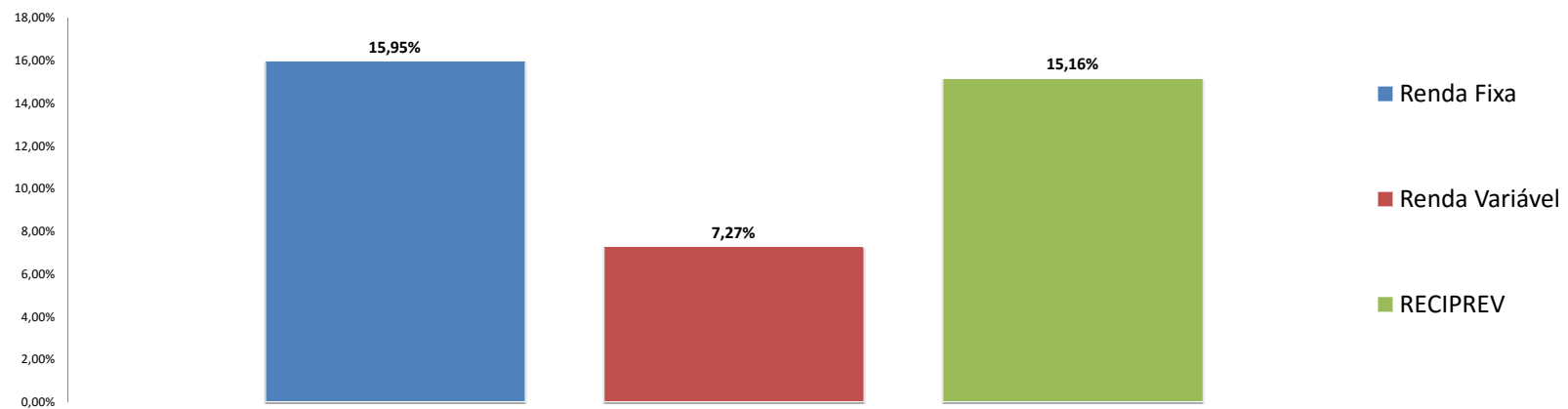
### Política de Investimentos

	LIMITES DAS RESOLUÇÕES	CARTEIRA – RECIPEV	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO	POLÍTICA
<b>RENDA FIXA – ART 7º</b>				
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a"	100,00%	11,70%	14,00%	100,00%
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	100,00%	48,23%	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%	10,45%	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%	17,87%	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%	0,32%	4,00%	15,00%
FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) – Fechado - Art. 7º, VII, "a"	5,00%	1,49%	2,50%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, "b"	5,00%	1,64%	2,50%	5,00%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>100,00%</b>	<b>91,71%</b>	<b>75,00%</b>	
<b>RENDA VARIÁVEL – ART 8º</b>				
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%	2,01%	8,00%	15,00%
FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV	5,00%	3,11%	5,00%	5,00%
FI em Participações - fechado - Art. 8º, V	5,00%	1,96%	5,00%	5,00%
FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI	5,00%	1,21%	5,00%	5,00%
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>30,00%</b>	<b>8,29%</b>	<b>25,00%</b>	
<b>TOTAL</b>		<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	

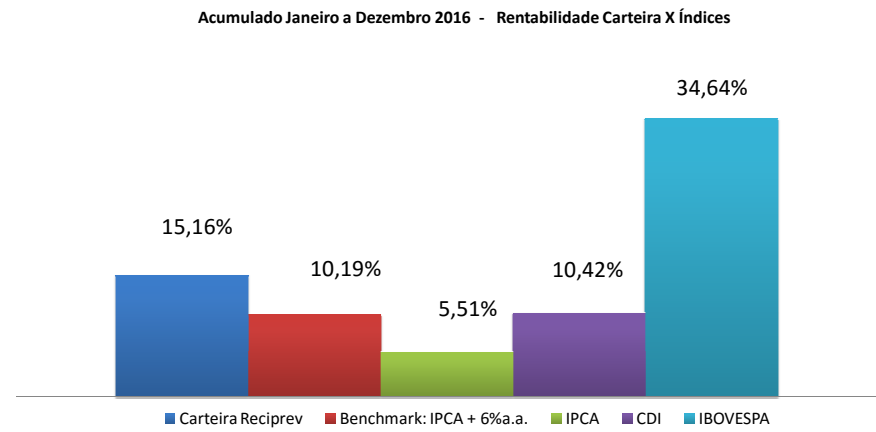
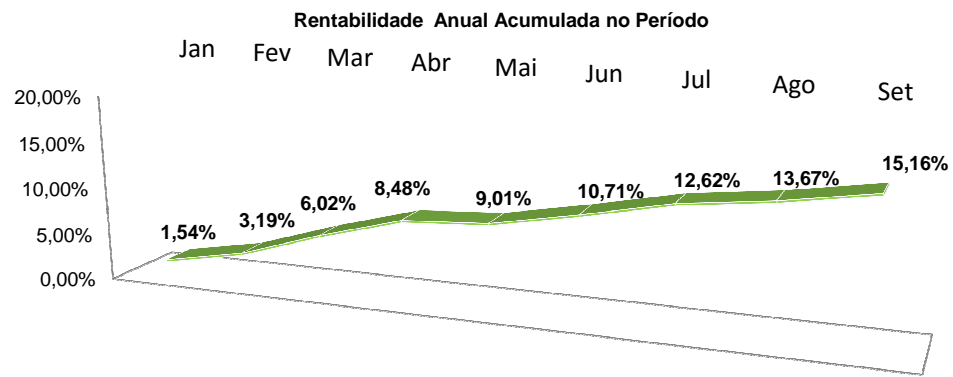
## Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV



## Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV



## Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV

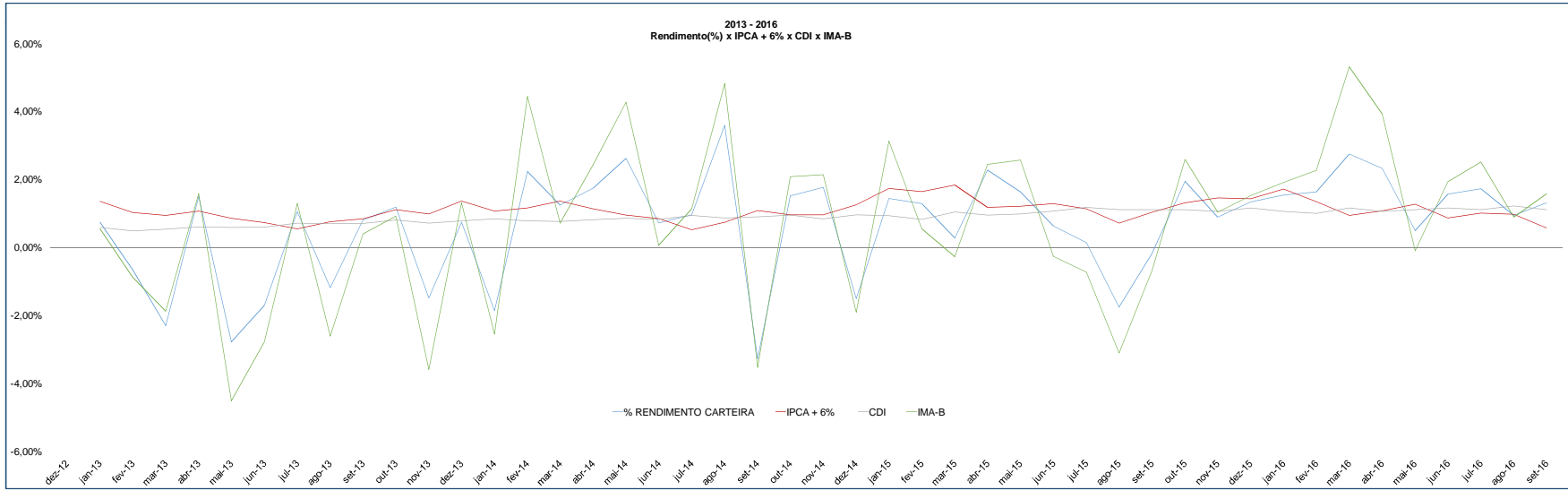
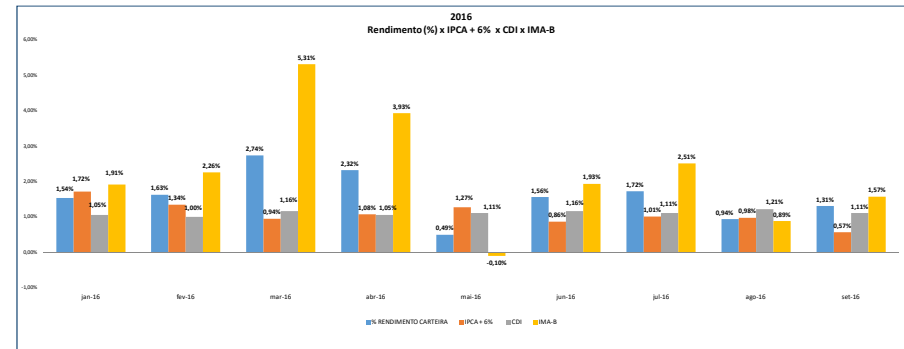
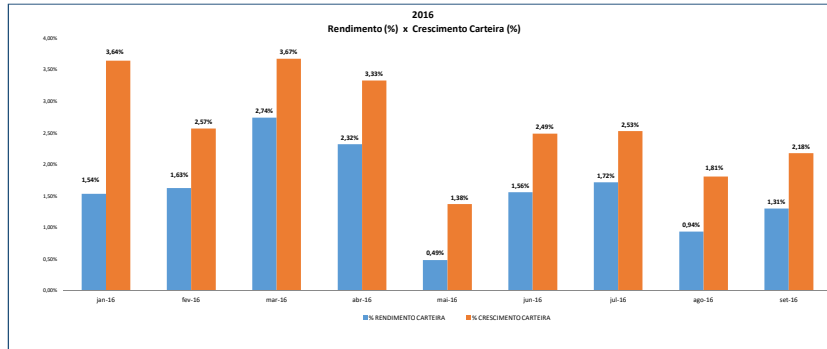




RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV - ANO DE 2016

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\$	1.307.922.117,58	R\$ 21.954.632,78	1,72%
31/08/2016	R\$	1.331.627.234,98	R\$ 12.268.590,66	0,94%
30/09/2016	R\$	1.360.666.672,69	R\$ 17.386.394,66	1,31%
31/10/2016	R\$	-	-	0,00%
30/11/2016	R\$	-	-	0,00%
31/12/2016	R\$	-	-	0,00%
<b>TOTAL</b>		<b>R\$</b>	<b>170.803.591,98</b>	<b>15,16%</b>

GRÁFICO COMPARATIVO DA CARTEIRA RECIPREV



FLUXO MENSAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

ANO	2016		
Mês	Setembro		
<b>RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES</b>		<b>COMPETÊNCIA</b>	<b>VALOR</b>
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	Parcelamento 9/60 e Contribuição 08 de 2016	R\$	6.583.908,27
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	08 de 2016	R\$	5.396.359,73
IASC (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	08 de 2016	R\$	83.603,71
IASC (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	08 de 2016	R\$	71.047,22
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	09 de 2016	R\$	49.648,37
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	09 de 2016	R\$	39.930,51
CONTRIBUIÇÕES APO/PPR	-	R\$	-
<b>TOTAL</b>		<b>R\$</b>	<b>12.224.497,81</b>
<b>RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS</b>		<b>CNPJ</b>	<b>VALOR</b>
FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	20.716.161/0001-93	R\$	50.000,00
FII - CAIXA RIO BRAVO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	17.096.794/0001-70	R\$	32.000,00
FII - REIT RIVIERA - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	16.841.067/0001-99	R\$	-
FIDC CASAN SANEAMENTO SENIOR 1 -(AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.542.287/0001-00	R\$	39.593,65
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\$	94.679,66
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	11.278.761/0001-26	R\$	2.316.824,17
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\$	-
<b>TOTAL</b>		<b>R\$</b>	<b>2.533.097,48</b>
<b>FOLHA DE PAGAMENTO</b>		<b>VALOR</b>	
CONSIGNAÇÃO DA FOLHA DE APO/PPR		-R\$	571.454,80
<b>TOTAL</b>		<b>-R\$</b>	<b>571.454,80</b>
<b>PAGAMENTOS DIVERSOS</b>		<b>VALOR</b>	
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\$	650,00
CUSTO SELIC TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)		-R\$	389,95
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPREV		R\$	-
<b>TOTAL</b>		<b>-R\$</b>	<b>1.053,15</b>
<b>RESUMO GERAL</b>		<b>VALOR</b>	
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES		R\$	12.224.497,81
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMOTRIZAÇÕES ESPECÍFICAS		R\$	2.533.097,48
TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS		-R\$	571.454,80
TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS		-R\$	1.053,15
<b>TOTAL</b>		<b>R\$</b>	<b>14.185.087,34</b>

SERVIDORES INGRESSARAM A PARTIR DE 17/12/1998	
<b>APOSENTADOS E PENSIONISTAS</b>	
TOTAL APOSENTADOS	183
TOTAL PENSIONISTAS	104
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>287</b>
<b>NÚMERO DE CONTRIBUINTES</b>	
PREFEITURA	14.422
IASC	298
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE	70
INATIVOS	19
<b>TOTAL DE CONTRIBUINTES</b>	<b>14.809</b>
<b>PERCENTUAL DAS CONTRIBUIÇÕES</b>	
PATRONAL	15,94%
SEGURADOS	12,82%
<b>PERCENTUAL TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES</b>	<b>28,76%</b>

## RESUMO ANUAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPEV

ANO	2016		
<b>RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES ACUMULADAS DO ANO</b>			<b>VALOR</b>
	PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	R\$	63.407.344,30
	PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	R\$	52.037.866,51
	IASC (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	R\$	680.245,11
	IASC (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	R\$	629.591,33
	CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	R\$	344.413,95
	CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	R\$	277.000,88
	CONTRIBUIÇÕES APO/PPR	R\$	62.352,39
	<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>117.438.814,47</b>
<b>RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS ACUMULADAS DO ANO</b>			<b>VALOR</b>
	FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	20.716.161/0001-93	R\$ 420.500,00
	FII - CAIXA RIO BRAVO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	17.098.794/0001-70	R\$ 312.574,72
	FII - REIT RIVIERA - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	16.841.067/0001-99	R\$ 361.091,69
	FIDC CASAN SANEAMENTO SENIOR 1 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.542.287/0001-00	R\$ 429.758,64
	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\$ 4.347.353,87
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA VI FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.523.306/0001-50	R\$ 1.331.006,62
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VII FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	19.523.305/0001-06	R\$ 22.846.941,32
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	20.734.937/0001-06	R\$ 77.662.841,32
	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\$ 82.321.445,42
	FI CAIXA BRASIL 2018 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	18.598.256/0001-08	R\$ 5.210.851,21
	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	18.598.288/0001-03	R\$ 1.070.404,94
	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.595/0001-78	R\$ 1.389.177,79
	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	19.769.046/0001-06	R\$ 287.306,33
	FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	20.139.534/0001-00	R\$ 487.671,54
	FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 4 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	11.278.761/0001-26	R\$ 345.627,13
	FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	11.278.761/0001-26	R\$ 2.738.868,47
	FIDC SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL SENIOR 6 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	09.257.784/0001-02	R\$ 444.616,19
	FIDC SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL SENIOR 7 - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	09.257.784/0001-02	R\$ 282.555,65
	<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>207.215.766,01</b>
<b>FOLHA DE PAGAMENTO ACUMULADA DO ANO</b>			<b>VALOR</b>
	CONSIGNAÇÃO DA FOLHA DE APO/PPR	-R\$	4.510.182,47
	<b>TOTAL</b>	<b>-R\$</b>	<b>4.510.182,47</b>
<b>PAGAMENTOS DIVERSOS ACUMULADO DO ANO</b>			<b>VALOR</b>
	TARIFA DE CUSTÓDIA DO FUNDO FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS	-R\$	112,80
	TARIFA DE CUSTÓDIA TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	-R\$	1.950,00
	CUSTO SELIC TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	-R\$	3.303,88
	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPEV	-R\$	1.164.264,78
	<b>TOTAL</b>	<b>-R\$</b>	<b>1.169.631,46</b>
<b>RESUMO GERAL DO ANO</b>			<b>VALOR</b>
	TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES	R\$	117.438.814,47
	TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS	R\$	207.215.766,01
	TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS	-R\$	4.510.182,47
	TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS	-R\$	1.169.631,46
	<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>318.974.766,55</b>

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 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

ESTATÍSTICA DA CARTERIA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

FUNDO	CNPJ	Gestor	Tipo	Enquadramento Res. 3322	Benchmark	Retorno Médio Mensal	Retorno Médio Anual	Maior Retorno	Menor Retorno	Qtd. mês Positivo	Qtd. mês Negativo	Qtd. mês acima do Benchmark	Qtd. mês abaixo do Benchmark	Risco Mensal Período	Risco Anual do Período	Retorno Relativo ao Benchmark	Sharpe	Information Ratio	Tracking Error	VAR (95%)	Sharpe Modificado	Índice Beta (12 meses)	Erro Quadrático Médio (EQM)
FIP - ÁTICO FLORESTAL	12.312.767/0001-35	ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	RV	ART. 8º, V	IPCA+9% ano	0,00%	-0,02%	9,25%	-3,38%	5	48	1	52	1,37%	4,76%	-50,05%	-2,28	-3,49	4,88%	2,27%	-2,69	0,00	1,91%
FIP - ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA	11.490.580/0001-69	ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	RV	ART. 8º, V	IPCA+10,5% ano	0,90%	11,34%	39,38%	-0,33%	6	63	3	66	5,90%	20,44%	-29,58%	0,02	-0,34	20,45%	10,75%	0,02	-0,05	5,87%
AZ LEGAN BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	RV	ART. 8º, III	IBOVESPA	-0,03%	-0,39%	11,71%	-11,45%	32	25	25	32	4,97%	17,23%	-4,53%	-0,65	-0,10	10,16%	8,27%	-0,67	0,62	2,91%
AZ LEGAN VALORE FI RF - CP	19.782.311/0001-88	AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	RF	Art. 7º, VII, b	CDI	1,03%	13,08%	1,43%	0,74%	29	0	19	10	0,16%	0,57%	0,27%	0,22	0,46	0,27%	1,30%	0,78	1,75	0,08%
BB AÇÕES PIPE FIC FI	17.116.227/0001-08	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RV	ART. 8º, III	SMALL CAPS	0,68%	8,46%	8,48%	-6,92%	23	17	28	12	4,07%	14,08%	67,51%	-0,25	1,53	10,18%	7,45%	-0,26	0,48	3,14%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	10.418.335/0001-88	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RV	ART. 8º, III	IGC	0,12%	1,44%	11,85%	-9,83%	36	33	18	51	4,78%	16,56%	-7,56%	-0,57	-1,60	0,87%	8,10%	-0,59	0,92	0,27%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC FI	18.270.783/0001-99	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RV	ART. 8º, III	IBOVESPA	0,37%	4,56%	10,91%	-8,60%	22	15	19	18	5,25%	18,18%	-1,67%	-0,42	-0,08	7,52%	9,14%	-0,43	0,67	2,15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, IV, a	CDI	0,80%	10,04%	1,17%	0,43%	65	0	1	64	0,19%	0,67%	-4,05%	-1,26	-12,72	0,07%	1,12%	197,78	1,10	0,07%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, I, b	IDKA IPCA 2A	1,01%	12,78%	3,50%	-0,91%	57	8	26	39	0,84%	2,92%	-3,16%	0,65	-1,15	0,58%	2,40%	0,84	0,69	0,17%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	07.442.078/0001-05	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B	0,97%	12,33%	5,33%	-4,50%	51	18	16	53	2,09%	7,25%	-2,28%	0,20	-2,32	0,19%	4,44%	0,22	0,92	0,07%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	03.543.447/0001-03	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	Art. 7º, III, a	IMA-B 5	0,93%	11,70%	3,23%	-3,93%	32	4	6	30	1,29%	4,47%	-5,82%	-0,14	-0,90	2,52%	3,05%	-0,16	0,90	0,73%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	13.327.340/0001-73	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B5+	1,05%	13,42%	8,38%	-6,15%	45	20	19	46	3,15%	10,92%	-0,97%	0,23	-0,15	1,33%	6,29%	0,25	0,92	0,38%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 TP FIC FI	11.328.882/0001-35	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, I, b	IRF-M1	0,86%	10,86%	1,62%	0,24%	69	0	3	66	0,26%	0,90%	-1,69%	-0,03	-5,98	0,06%	1,29%	-0,11	0,89	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFL FIC FI	13.077.418/0001-49	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, IV, a	CDI	0,87%	10,97%	1,25%	0,48%	65	0	45	20	0,20%	0,68%	0,41%	0,12	0,82	0,10%	1,19%	23,31	1,04	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP VII FI	19.523.305/0001-06	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B	1,15%	14,68%	2,38%	-0,52%	18	1	8	11	0,70%	2,42%	-3,05%	0,32	-0,42	5,34%	2,30%	0,35	0,05	1,51%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI	20.734.937/0001-06	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, I, b	IDKA IPCA 2A	1,19%	15,30%	2,21%	0,32%	17	0	8	9	0,46%	1,58%	-2,27%	0,78	-0,76	2,48%	1,94%	0,91	0,30	0,71%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III FI	19.303.795/0001-35	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, IV, a	IPCA+6% ano	1,17%	15,03%	2,05%	0,61%	32	0	15	17	0,32%	1,11%	-49,65%	2,13	-0,55	61,40%	1,70%	3,61	0,00	17,72%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	15.486.093/0001-83	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, IV, a	IPCA+6% ano	1,28%	16,53%	5,14%	-2,54%	26	7	18	15	1,77%	6,11%	-47,76%	0,64	-0,51	60,50%	4,20%	0,69	0,59	17,44%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA VI FI	19.523.306/0001-50	BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B	1,21%	15,51%	3,58%	-2,41%	26	5	14	17	1,57%	5,43%	-2,93%	0,51	-0,48	2,78%	3,80%	0,55	0,48	0,80%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B	08.702.798/0001-25	BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	RF	ARTIGO 7º, III, a	IMA-B	1,00%	12,71%	5,14%	-4,37%	51	18	36	33	2,11%	7,29%	-0,35%	0,25	-0,20	0,34%	4,49%	0,27	0,90	0,10%
FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS	20.716.161/0001-93	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	RV	ART. 8º, VI	IPCA+6% ano	0,95%	12,00%	4,31%	-1,67%	22	3	11	14	1,18%	4,09%	-53,03%	-0,31	-0,71	68,97%	2,89%	-0,35	0,00	19,97%
FI CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	18.598.258/0001-08	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, IV, a	IPCA+6% ano	1,07%	13,60%	2,11%	-1,70%	31	1	13	19	0,60%	2,09%	-51,31%	0,44	-0,57	61,92%	2,06%	0,57	0,00	17,72%
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	18.598.288/0001-03	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B	1,26%	16,21%	5,89%	-2,76%	25	8	17	16	2,05%	7,11%	-0,66%	0,51	-0,10	2,83%	4,65%	0,54	0,77	0,80%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	20.139.595/0001-78	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B	1,23%	15,79%	4,05%	-2,76%	15	4	10	9	1,76%	6,11%	-1,56%	0,31	3,17	3,59%	4,14%	0,32	0,79	1,01%
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	19.769.046/0001-06	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B	1,32%	17,06%	7,83%	-4,91%	21	10	18	13	2,95%	10,23%	0,48%	0,42	0,06	3,54%	6,22%	0,44	1,41	1,01%
FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF	20.139.534/0001-00	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B	1,33%	17,16%	7,77%	-4,02%	13	6	10	9	2,73%	9,45%	0,29%	0,34	0,02	9,09%	5,85%	0,35	1,42	2,56%
FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, IV, a	CDI	0,87%	10,98%	1,21%	0,49%	69	0	47	22	0,19%	0,66%	0,48%	0,14	1,31	0,07%	1,18%	46,97	0,93	0,02%
FI CAIXA BRASIL IPCA VII M CP	14.120.236/0001-76	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RV	ART. 8º, IV	IPCA+6% ano	1,07%	13,65%	3,27%	-4,68%	56	2	25	33	1,02%	3,53%	-49,94%	0,82	-0,38	45,69%	2,75%	1,03	0,00	13,19%
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	14.386.926/0001-71	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, I, b	IDKA IPCA 2A	0,95%	11,99%	2,90%	-0,91%	43	6	20	29	0,83%	2,89%	-1,55%	0,34	-0,64	0,67%	2,32%	0,46	0,64	0,19%
FII - CAIXA RIO BRAVO	17.098.794/0001-70	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RV	ART. 8º, VI	IFIX	0,81%	10,21%	27,60%	-16,19%	23	10	17	16	7,71%	26,70%	-1,13%	-0,09	-0,02	25,58%	13,77%	-0,09	0,80	7,27%
QUELUZ VALOR FIA	09.289.072/0001-75	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS LTDA	RV	ART. 8º, III	IBRX	0,56%	6,91%	8,31%	-7,08%	43	26	37	32	3,35%	11,61%	35,13%	-0,34	0,50	10,80%	6,13%	-0,36	0,37	3,11%
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B 5	1,00%	12,72%	3,61%	-1,05%	61	8	13	56	0,83%	2,88%	-1,66%	0,64	-1,73	0,19%	2,37%	0,83	0,89	0,06%
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	10.740.658/0001-93	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, I, b	IMA-B	0,98%	12,42%	5,92%	-4,47%	50	19	25	44	2,15%	7,44%	-1,83%	0,21	-0,82	0,44%	4,54%	0,23	0,92	0,13%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, I, b	IRF-M1	0,87%	10,98%	1,62%	0,28%	69	0	8	61	0,26%	0,90%	-1,07%	0,11	-4,45	0,05%	1,30%	0,39	0,88	0,02%

FUNDO	CNPJ	Gestor	Tipo	Enquadramento Res. 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	Tracking Error	VAR (95%)	Sharpe Modificado	Índice Beta (12 meses)	Erro Quadrático Médio (EQM)
FIDC CASAN SANEAMENTO SENIOR 1	19.542.287/0001-00	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	RF	ART. 7º, VII, a	IPCA+10,5% ano	1,38%	17,84%	2,27%	0,05%	29	0	13	16	0,42%	1,45%	1,92%	3,37	0,77	1,20%	2,07%	4,67	0,16	0,34%
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 4	11.278.761/0001-26	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	RF	ART. 7º, VII, a	IPCA+7% ano	1,23%	15,74%	2,07%	0,64%	33	0	16	17	0,30%	1,04%	-0,11%	3,02	-0,07	0,66%	1,72%	5,40	0,60	0,19%
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	11.278.761/0001-26	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	RF	ART. 7º, VII, a	IPCA+8,5% ano	1,38%	17,86%	2,16%	0,54%	24	0	10	14	0,33%	1,15%	-0,66%	3,91	-0,53	0,73%	1,92%	5,70	0,70	0,21%
FIP - CAIS MAUA DO BRASIL	17.213.821/0001-09	MHFT INVESTIMENTOS S.A.	RV	ART. 8º, V	IPCA+8% ano	0,17%	2,12%	14,74%	-0,55%	1	42	1	42	2,27%	7,87%	-36,91%	-1,20	-1,81	7,75%	3,94%	-1,31	3,08	2,45%
FIQ FIDC - SRM SENIOR 3	09.260.031/0001-56	NOVA S R M ADM DE RECURSOS S.A.	RF	ART. 7º, VII, a	120% CDI	1,16%	14,91%	1,46%	0,22%	34	0	20	14	0,23%	0,79%	-0,67%	3,03	-10,20	0,03%	1,54%	7,44	0,92	0,01%
FIQ FIDC - BRAZIL PLUS	14.239.052/0001-20	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	RF	ARTIGO 7º, VI	120% CDI	1,28%	16,46%	1,46%	1,01%	24	0	18	6	0,11%	0,37%	0,41%	-0,03	-0,40	43,60%	7,72%	-0,03	2,16	12,60%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	-	TESOURO NACIONAL	RF	ART. 7º, I, a	IPCA+6% ano	0,83%	10,44%	11,67%	-8,30%	42	27	33	36	4,14%	14,34%	-57,30%	-0,04	1,43	9,96%	7,61%	-0,04	0,40	3,06%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	11.392.165/0001-72	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	RV	ART. 8º, III	SMALL CAPS	0,82%	10,30%	10,21%	-10,30%	45	24	51	18	4,08%	14,13%	121,64%	-0,05	-0,78	5,36%	3,61%	-0,05	2,04	1,55%
FII - REIT RIVIERA	16.841.067/0001-99	RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	RV	ART. 8º, VI	IPCA+7,5% ano	0,97%	12,26%	4,69%	-2,14%	25	9	12	22	1,60%	5,53%	-9,83%	0,48	-1,93	0,11%	2,32%	0,64	0,92	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	0,96%	12,13%	2,96%	-1,20%	53	7	10	50	0,82%	2,85%	-0,92%	0,68	1,09	0,56%	1,33%	3,47	0,43	0,17%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FIM CP	13.823.084/0001-05	INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	RV	ART. 8º, IV	CDI	0,90%	11,38%	1,42%	0,28%	54	0	42	12	0,26%	0,90%	2,50%	0,38	0,91	0,28%	1,21%	9,93	0,71	0,08%
SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RF CP	04.899.128/0001-90	INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	RF	ART. 7º, VII, b	CDI	0,88%	11,14%	1,30%	0,50%	69	0	63	6	0,20%	0,68%	1,33%	-0,52	-0,64	62,79%	2,58%	-0,58	0,01	18,18%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FIM CP	19.225.709/0001-13	INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	RV	ART. 8º, IV	IPCA+6% ano	0,88%	11,02%	2,25%	-3,36%	27	3	11	19	1,03%	3,57%	-53,81%	3,10	-0,20	0,51%	1,82%	5,10	0,77	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	1,26%	16,23%	2,19%	0,68%	33	0	16	17	0,34%	1,17%	-0,24%	3,19	-0,68	0,58%	1,90%	4,74	0,69	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	1,31%	16,93%	2,27%	0,74%	29	0	12	17	0,36%	1,24%	-0,80%	-1,18	-1,18	75,77%	16,95%	-1,20	0,05	22,62%
FIP - TERRAS BRASIL	19.412.474/0001-79	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	RV	ART. 8º, V	IPCA+6% ano	-3,54%	-35,12%	0,21%	-62,23%	1	27	0	28	11,73%	40,65%	-86,77%	0,68	-0,53	57,57%	2,43%	0,82	0,00	16,63%
VOTORANTIM ATUARIAL M CP FI	14.491.564/0001-89	VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	RV	ART. 8º, IV	IPCA+6% ano	1,11%	14,21%	2,91%	-1,06%	33	3	17	19	0,80%	2,76%	-50,65%	0,33	2,01	0,10%	1,18%	-7,32	1,17	0,03%
WESTERN ASSET DI REFERENCIADO FI	00.819.875/0001-10	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	RF	ART. 7º, IV, a	CDI	0,88%	11,09%	1,22%	0,49%	69	0	59	10	0,18%	0,63%	1,07%	0,35	-0,17	1,68%	3,09%	0,40	1,25	0,48%
XP LONG SHORT FIC FIM	11.616.403/0001-86	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	RV	ART. 8º, IV	CDI	1,09%	13,92%	3,62%	-2,41%	62	7	41	28	0,97%	3,35%	16,79%	0,91	0,95	3,19%	2,69%	1,13	0,88	0,94%
<b>CARTEIRA RECIPREV</b>	<b>07.749.668/0001-85</b>	<b>RECIPREV</b>	-	-	<b>IPCA+6% ano</b>	<b>0,90%</b>	<b>11,39%</b>	<b>4,55%</b>	<b>-2,78%</b>	<b>54</b>	<b>15</b>	<b>30</b>	<b>39</b>	<b>1,44%</b>	<b>5,00%</b>	<b>-55,13%</b>	<b>0,10</b>	<b>-0,40</b>	<b>41,80%</b>	<b>3,29%</b>	<b>0,12</b>	<b>0,39</b>	<b>12,08%</b>

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:  $(\text{Retorno médio anual do ativo} - \text{Retorno médio anual do CDI}) / (\text{Risco anual do Ativo})$ . Portanto, quanto maior, melhor;
    - > Information Ration: Dado pela fórmula:  $(\text{Retorno médio anual do ativo} - \text{Retorno médio anual do Benchmark}) / \text{Treck Erro}$ . 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:  $(\text{Retorno médio anual do ativo} - \text{Retorno médio anual do CDI}) / (\text{Risco anual do Ativo} - \text{Risco anual do CDI})$ . 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	R\$	85.112,11	R\$	67.661,61
31/08/2016	R\$	39.064,90	R\$	86.665,82
30/09/2016	R\$	47.797,10	R\$	80.945,90
31/10/2016				
30/11/2016				
31/12/2016				
<b>TOTAL</b>			<b>R\$</b>	<b>518.658,27</b>
		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\$	1.308.007.229,69	R\$	22.022.294,39
31/08/2016	R\$	1.331.666.299,88	R\$	12.355.256,48
30/09/2016	R\$	1.360.714.469,79	R\$	17.467.340,56
31/10/2016	R\$	-	R\$	-
30/11/2016	R\$	-	R\$	-
31/12/2016	R\$	-	R\$	-

EQUIPE DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

PANORAMA MACROECONÔMICO

**China:** Apesar das boas expectativas, o cenário ainda continua a apresentar crescimento abaixo do esperado pelo mercado.

**Zona do Euro:** O Banco Central Europeu vêm mantendo os estímulos na economia, ao mesmo tempo em que monitora os impactos em razão do Brexit.

**Estados Unidos:** O Banco Central dos Estados Unidos (FED), manteve a taxa de juros, porém, as expectativas podem ser de alta das taxas de juros, tendo em vista a recuperação do mercado de trabalho. Previsão de ocorrer o aumento nas taxas de juros, partir de dezembro de 2016.

**Brasil:** As expectativas são de redução na taxa de juros, porém, sem definição do período efetivo, podendo acontecer ainda este ano, ou partir do início de 2017. AS expetativas são de redução da inflação em 2016, devendo ficar por volta de 7,0 a 7,1%.

DESEMPENHO DA CARTEIRA

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

IPCA de setembro de 2016: **0,08%**. Corresponde à meta atuarial de **0,57%**, para setembro de 2016.

Meta Atuarial Acumulada no ano de 2016: **10,19%**.

Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em setembro de 2016: **1,31%**, Sendo: Renda Fixa **1,39%** e Renda Variável **0,42%**.

Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2016: **15,16%**.

Percentual de atingimento da meta atuarial acumulada no ano de 2016: **148,72%**.

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 Mecado 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 setembro de 2016, medida pela IPCA, ficou abaixo das expectativas do mercado, em especial, considerando as projeções do IPCA para o ano de 2016 entre 7,0 a 7,1%. 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

Anderson Carlos Gomes de Oliveira  
Chefe de Divisão de Investimentos

Paulo José Barbosa  
Equipe Investimentos

Áureo Ricardo Silva Guimarães  
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

Anderson Carlos Gomes de Oliveira  
Chefe de Divisão de Investimentos

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

*Originals assinados e arquivados na Reciprev*  
RECIFE (PE), 10 de outubro de 2016