

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:

31/12/2020

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores)

	Renda Fixa	%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 798.253.826,05	32,11%
BRAM - DTV (GRUPO BRADESCO)	R\$ 217.116.510,37	8,73%
TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	R\$ 163.388.750,23	6,57%
BB DTV (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 143.221.551,51	5,76%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 89.678.704,95	3,61%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTV (GRUPO BNP)	R\$ 62.329.656,11	2,51%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 14.148.947,81	0,57%
TOTAL RF	R\$ 1.488.137.947,04	59,86%
	Renda Variável	%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 196.716.403,14	7,91%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 109.394.234,86	4,40%
BRAM - DTV (GRUPO BRADESCO)	R\$ 72.236.411,29	2,91%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 64.585.748,50	2,60%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 62.698.693,91	2,52%
BB DTV (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 59.669.336,61	2,40%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$ 58.325.099,05	2,35%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 50.127.787,26	2,02%
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 27.346.258,68	1,10%
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA (GRUPO XP)	R\$ 22.922.442,70	0,92%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 18.335.314,87	0,74%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTV (GRUPO BNP)	R\$ 14.452.182,75	0,58%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 7.612.026,64	0,31%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 4.477.788,61	0,18%
LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.385.688,09	0,14%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 3.102.132,68	0,12%
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 725.659,69	0,03%
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$ 251.238,12	0,01%
TOTAL RV	R\$ 776.364.447,44	31,23%
	Exterior	%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 138.018.788,13	5,55%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTV (GRUPO BNP)	R\$ 46.667.555,75	1,88%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT (GRUPO XP)	R\$ 36.644.298,92	1,47%
TOTAL EXTERIOR	R\$ 221.330.642,80	8,90%
SALDO CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	0,00%
PATRIMÔNIO	R\$ 2.485.833.038,28	100,00%

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores)

	Renda Fixa	%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 798.253.826,05	32,11%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$ 217.116.510,37	8,73%
TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	R\$ 163.388.750,23	6,57%
BB DTV (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 143.221.551,51	5,76%
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$ 89.678.704,95	3,61%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	R\$ 62.329.656,11	2,51%
BEM - DTV (GRUPO BRADESCO)	R\$ 14.148.947,81	0,57%
TOTAL RF	R\$ 1.488.137.947,03	59,86%
	Renda Variável	%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 271.446.037,02	10,92%
BEM - DTV (GRUPO BRADESCO)	R\$ 259.238.785,57	10,43%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 64.585.748,50	2,60%
BB DTV (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 63.497.128,98	2,55%
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$ 62.698.693,91	2,52%
INTRAG DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA (GRUPO ITAÚ)	R\$ 22.922.442,70	0,92%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	R\$ 14.452.182,75	0,58%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 7.612.026,64	0,31%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTV (GRUPO BNP)	R\$ 6.525.713,30	0,26%
LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.385.688,09	0,14%
TOTAL RV	R\$ 776.364.447,44	31,23%
	Exterior	%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 138.018.788,13	5,55%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	R\$ 83.311.854,68	3,35%
TOTAL EXTERIOR	R\$ 221.330.642,80	8,90%
SALDO CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	0,00%
PATRIMÔNIO	R\$ 2.485.833.038,28	100,00%

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (Índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% 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
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	1,00%	CDI	Não possui	1,12%	1,14%	R\$ 27.948.343,62	13.077.415/0001-05	0,10%	1,64%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,15%	IPCA + 6,00%	Não possui	1,02%	7,22%	R\$ 25.362.711,01	15.486.093/0001-83	1,97%	8,65%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IPCA + 6,00%	Não possui	2,14%	9,05%	R\$ 53.254.809,18	19.303.795/0001-35	1,61%	6,92%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IMA-B	Não possui	1,26%	10,61%	R\$ 31.333.354,38	19.523.306/0001-50	1,66%	8,45%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IMA-B	Não possui	0,21%	2,16%	R\$ 5.322.333,32	19.523.305/0001-06	1,21%	5,61%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Baixo
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	0,20%	IMA-B	Não possui	8,72%	10,33%	R\$ 216.862.002,14	08.702.798/0001-25	4,94%	6,30%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	3,00%	CDI	Não possui	0,01%	0,03%	R\$ 254.508,23	13.397.466/0001-14	0,03%	0,55%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Muito Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	1,06%	5,61%	R\$ 26.413.410,00	18.598.288/0001-03	2,53%	8,76%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	1,28%	2,17%	R\$ 31.792.440,00	20.139.595/0001-78	2,53%	8,77%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,31%	10,87%	R\$ 7.752.556,00	19.769.046/0001-06	5,52%	9,35%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,49%	3,17%	R\$ 12.158.545,00	20.139.534/0001-00	5,52%	9,36%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IRF-M 1+	Não possui	3,64%	3,21%	R\$ 90.443.792,56	10.577.519/0001-90	3,04%	8,22%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IDKA IPCA 2A	Não possui	12,93%	3,02%	R\$ 321.475.185,42	14.386.926/0001-71	1,65%	8,03%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,40%	IPCA	Não possui	12,40%	2,09%	R\$ 308.217.897,08	23.215.097/0001-55	1,32%	6,66%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Muito Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÉNIORES)	SINGULARE CTVM S.A.	SINGULARE CTVM S.A.	0,20%	125% do DI	Não possui	0,00%	14,22%	R\$ 0,00	13.633.964/0001-19	1,74%	1,74%	Médio Prazo	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	Risco Muito Alto

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% 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
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAU)	ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAU)	0,40%	IPCA	Não possui	0,00%	0,00%	-R\$	0,00	21.838.150/0001-49	0,20%	2,86%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral Risco Muito Alto
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,55%	IMA-B	0,2	0,57%	10,76%	R\$	14.148.947,81	14.115.118/0001-70	5,01%	6,40%	Curto Prazo	FI Renda Fixa "Referenciado" 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.	0,20%	IMA-B 5	Não possui	3,61%	7,45%	R\$	89.678.704,95	13.455.117/0001-01	1,81%	7,83%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos Risco Médio
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RF LONGO PRAZO	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,40%	IMA-B	20,00%	0,00%	0,00%	-R\$	0,00	09.326.708/0001-01	4,58%	4,97%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos Risco Médio
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)- CÓDIGO: 10359219 (7604)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	0,00%	IPCA+7.002299%	Não possui	1,23%	0,00%	R\$	30.640.623,84		1,76%	11,68%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)- CÓDIGO: 10359220 (7608)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	0,00%	IPCA+7.002655%	Não possui	2,65%	0,00%	R\$	65.874.632,16		1,76%	11,68%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)- CÓDIGO: 6650570 (7647)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	0,00%	IPCA+6.261127%	Não possui	1,35%	0,00%	R\$	33.454.278,28		1,70%	10,91%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)- CÓDIGO: 6650571 (7632)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	0,00%	IPCA+6.269771%	Não possui	1,34%	0,00%	R\$	33.419.215,96		1,70%	10,92%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Risco Muito Baixo
WESTERN ASSET IMABS ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	0,40%	IMA-B 5	Não possui	2,51%	6,62%	R\$	62.329.656,11	17.517.577/0001-78	3,24%	10,18%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos Risco Médio
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LP	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA (GRUPO XP)	INTRAG DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA (GRUPO ITAU)	0,50%	IMA-B 5	Não possui	0,00%	0,00%	R\$	0,00	14.146.491/0001-98	2,62%	8,40%	Curto Prazo	FI Renda Fixa "Referenciado" Risco Médio
Renda Fixa														
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	0,71%	1,44%	R\$	17.545.132,64	11.182.064/0001-77	6,29%	-6,22%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral Risco Alto
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	1,31%	10,32%	R\$	32.582.654,61	14.550.994/0001-24	7,13%	-7,00%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral Risco Alto
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,50%	Índice Small Cap	20,00%	1,10%	2,02%	R\$	27.346.258,68	11.392.165/0001-72	6,93%	-3,16%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	1,00%	IGC	Não possui	2,40%	4,79%	R\$	59.669.336,61	10.418.335/0001-88	8,75%	2,28%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações Risco Alto

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% 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
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	1,50%	IBOVESPA	Não possui	2,91%	3,93%	R\$ 72.236.411,29	06.916.384/0001-73	9,43%	-5,65%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,70%	IBRX-50	Não possui	3,56%	7,66%	R\$ 88.570.414,80	03.737.217/0001-77	9,07%	1,51%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,50%	Índice Small Cap	Não possui	1,98%	3,55%	R\$ 49.241.961,91	15.154.220/0001-47	7,60%	-3,23%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	Risco Muito Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,50%	IBOVESPA	Não possui	2,37%	5,67%	R\$ 58.904.026,42	30.068.224/0001-04	7,65%	1,18%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPSS	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,72%	IDIV	20,00%	3,01%	7,46%	R\$ 74.729.633,88	15.154.441/0001-15	9,37%	3,05%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
BB RECEBIVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,85%	IPCA + 6,9506%	20,00%	0,12%	4,83%	R\$ 3.102.132,68	20.716.161/0001-93	0,51%	-0,42%	Médio Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	SINGULARE CTVM S.A.	SINGULARE CTVM S.A.	1,36%	IPCA+7,50%	20,00%	0,31%	21,92%	R\$ 7.612.026,64	16.841.067/0001-99	-1,19%	19,77%	Médio Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	1,50%	IPCA+9,00%	Não possui	0,25%	4,55%	R\$ 6.274.475,17	12.312.767/0001-35	-0,14%	18,92%	Curto Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	0,30%	IPCA+ 10,50%	Vide regulamento	0,01%	3,14%	R\$ 251.238,12	11.490.580/0001-69	-2,41%	-97,00%	Curto Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	1,20%	IPCA+8,00%	Não possui	0,14%	3,40%	R\$ 3.385.688,09	17.213.821/0001-09	0,00%	-46,70%	Médio Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
TERRAS BRASIL – FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	2,00%	IPCA+6,00%	20,00%	0,03%	9,94%	R\$ 725.659,69	19.412.474/0001-79	-18,16%	-52,08%	Médio Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES PHENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAU)	ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAU)	2,50%	IBOVESPA	20,00%	2,60%	4,42%	R\$ 64.585.748,50	23.731.629/0001-07	7,97%	-21,23%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBRX	20,00%	0,49%	9,51%	R\$ 12.060.839,70	09.289.072/0001-75	4,17%	-8,47%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
MONGERAL AEGON FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	0,18%	8,74%	R\$ 4.477.788,61	33.254.944/0001-44	9,75%	-0,01%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Médio
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	2,50%	IBOVESPA	20,00%	2,52%	10,42%	R\$ 62.698.693,91	02.436.763/0001-05	7,61%	-6,07%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
SUL AMÉRICA EQUITIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	1,50%	IBRX-50	20,00%	2,35%	5,76%	R\$ 58.325.099,05	11.458.144/0001-02	7,70%	-12,57%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	1,39%	4,30%	R\$ 34.664.600,98	07.488.106/0001-25	8,92%	4,17%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	2,50%	Sem benchmark	Não possui	0,58%	8,06%	R\$ 14.452.182,75	09.087.523/0001-91	8,26%	1,65%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA (GRUPO XP)	INTRAG DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA (GRUPO ITAU)	3,00%	Sem benchmark	Não possui	0,92%	9,07%	R\$ 22.922.442,70	16.575.255/0001-12	8,22%	-15,40%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto

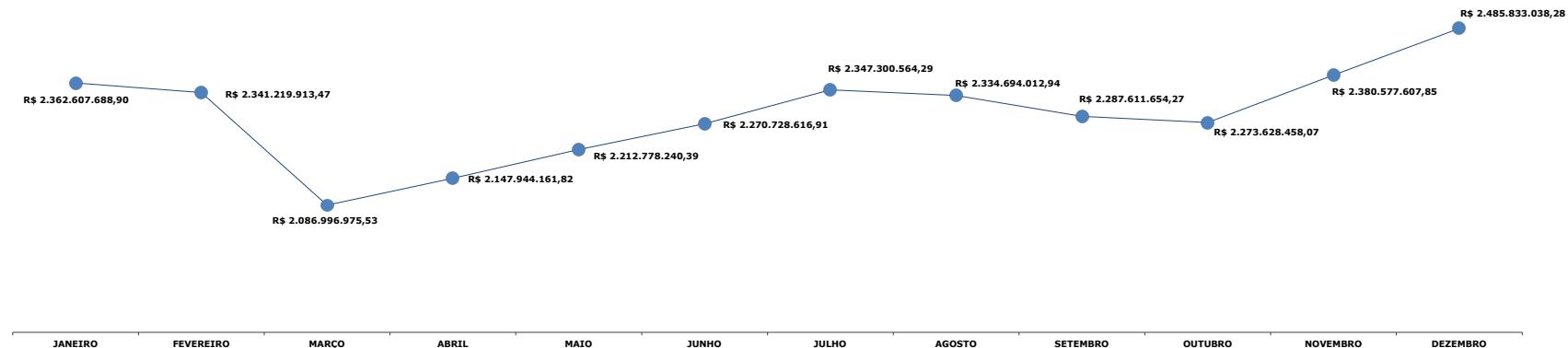
Renda Variável														7,93%
Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,70%	BDRX	Não possui	5,55%	6,94%	R\$ 138.018.788,13	17.502.937/0001-68	0,69%	54,76%	Curto Prazo	Fundo de Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III	Risco Alto
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	XP VISTA ASSET MANAGEMENT (GRUPO XP)	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	0,80%	MSCI World	Não possui	1,47%	2,87%	R\$ 36.644.298,92	33.913.562/0001-85	0,18%	91,31%	Curto Prazo	FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	Risco Muito Alto
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	0,10%	CDI	Não possui	1,88%	4,39%	R\$ 46.667.555,75	22.282.992/0001-20	1,23%	5,49%	Curto Prazo	FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, I	Risco Alto
Exterior								R\$ 221.330.642,80						0,72%
Saldo Conta Corrente						0,00%		R\$ 1,00						
Total Geral						100,00%		R\$ 2.485.833.038,28		Rentabilidade Reciprev	3,84%			

* A taxa de performance sempre será cobrada sobre o valor acima do benchmark.

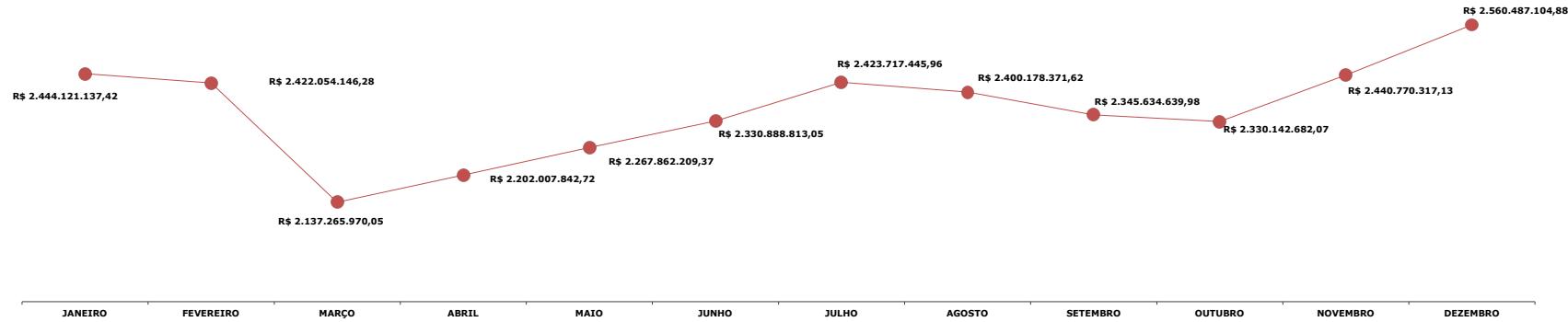
* A partir de 01/01/2019, os títulos públicos do Tesouro Nacional em posse do Fundo Previdenciário RECIPREV: TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS COM VENCIMENTO EM 15/05/2045 (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219; TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220; TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 e TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571, passaram a ser marcados pela "CURVA DE JUROS", de aquisição dos títulos, respectivamente: IPCA+7,002299%; IPCA+7,002655%; IPCA+6,261127% e IPCA+6,269771%, conforme definido na Política de Investimentos de 2019 e em conformidade com as normas da Secretaria de Previdência (Portaria nº 577, de 27 de dezembro de 2017 e Portaria SPREV nº 4, de 05 de fevereiro de 2018). Como os títulos são de longo prazo e com expectativa de se levar ao vencimento final, com a marcação pela curva de juros, evitaremos a volatilidade dos mesmos. O total dos referidos títulos em 31/12/2018, apresentavam "valor de mercado" já que eram "marcados à mercado", o valor de R\$ 187.984.960,92. Com a mudança de metodologia, passando a ser usada marcação pela "curva de juros", o valor dos mesmos no dia 01/01/2019, passou a valer R\$ 150.374.784,14, correspondente ao valor de aquisição atualizados pelas taxas de compra de cada um. Deste modo, apesar da redução do Patrimônio Líquido da carteira, no valor equivalente a diferença do preço à mercado e na curva de juros, reduzimos a volatilidade da carteira e utilizamos o valor real dos ativos até o seu vencimento, nesta data os preços à mercado e pela curva de juros se encontram.

TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) / Marcação a Mercado R\$ 238.042.816,83
 Preço da Carteira à Mercado R\$ 2.560.487.104,88
 Provisão para perdas futuras de investimentos R\$ 4.352.828,08

Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos na Curva RECIPREV 2020



Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos à Mercado RECIPREV 2020



ADMINISTRADORES DE RECURSOS	GRUPO ECONÔMICO DO ADMINISTRADOR DE RECURSOS	GESTORES DE RECURSOS	VALOR	% CARTEIRA
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 202.890.888,11	8,16%
		BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 725.659,69	0,03%
		RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 3.102.132,68	0,12%
		TOTAL	R\$ 206.718.680,48	8,32%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 1.132.989.017,32	45,58%
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 74.729.633,88	3,01%
		TOTAL	R\$ 1.207.718.651,20	48,58%
		GESTOR/CUSTODIA	VALOR	% CARTEIRA
		TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL) - Valor na Curva	R\$ 163.388.750,23	6,57%
		TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL) - Valor à Mercado	R\$ 238.042.816,83	9,30%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 217.116.510,37	8,73%
		TOTAL	R\$ 217.116.510,37	8,73%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 72.236.411,29	2,91%
		CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 50.127.787,26	2,02%
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 12.060.839,70	0,49%
		SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$ 58.325.099,05	2,35%
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 34.664.600,98	1,39%
		MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 18.626.736,42	0,75%
		AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 27.346.258,68	1,10%
		TOTAL	R\$ 273.387.733,38	11,00%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 152.377.398,86	6,13%
		TOTAL	R\$ 152.377.398,86	6,13%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 64.585.748,50	2,60%
		TOTAL	R\$ 64.585.748,50	2,60%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA (GRUPO XP)	R\$ 22.922.442,70	0,92%
		TOTAL	R\$ 22.922.442,70	0,92%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 6.274.475,17	0,25%
		BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$ 251.238,12	0,01%
		TOTAL	R\$ 6.525.713,30	0,26%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$ 123.449.394,62	4,97%
		XP VISTA ASSET MANAGEMENT (GRUPO XP)	R\$ 36.644.298,92	1,47%
		TOTAL	R\$ 160.093.693,54	6,44%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 7.612.026,64	0,31%
		TOTAL	R\$ 7.612.026,64	0,31%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.385.688,09	0,14%
		TOTAL	R\$ 3.385.688,09	0,14%
		TOTAL GERAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV	Na Curva R\$ 2.485.833.037,28 À Mercado R\$ 2.560.487.103,88	100,00%

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2020

PRAZOS DE LIQUIDAÇÃO DA CARTEIRA							
CARTEIRA GERAL		RENDA FIXA		RENDA VARIÁVEL		EXTERIOR	TOTAL
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$ 1.131.359.037,92	R\$ 761.538.940,34	R\$ 221.330.642,80	R\$ 2.114.228.621,07		85,05%	
MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)	R\$ 283.612.998,94	R\$ 14.825.507,10	R\$ -	R\$ 298.438.506,03		12,01%	
LONGO PRAZO (+ de 5 anos)	R\$ 73.165.910,18	R\$ -	R\$ -	R\$ 73.165.910,18		2,94%	
TOTAL	R\$ 1.488.137.947,04	R\$ 776.364.447,44	R\$ 221.330.642,80	R\$ 2.485.833.037,28		100,00%	

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DA CARTEIRA - INDICES		
INDÍCIE	VALOR	%
IPCA+6%	R\$ 571.575.387,89	22,99%
IBOVESPA	R\$ 362.147.239,72	14,57%
IMA-B	R\$ 345.783.588,65	13,91%
IDKA IPCA 2A	R\$ 321.475.185,42	12,93%
IMA-B 5	R\$ 152.008.361,06	6,11%
IBRX-50	R\$ 146.895.513,85	5,91%
BDRX	R\$ 138.018.788,13	5,55%
IDIV	R\$ 97.652.076,58	3,93%
IRF-M 1+	R\$ 90.443.792,56	3,64%
SMALL CAPS	R\$ 76.588.220,60	3,08%
CDI	R\$ 74.870.407,61	3,01%
IGC	R\$ 59.669.336,61	2,40%
S&P500	R\$ 36.644.298,92	1,47%
IBRX	R\$ 12.060.839,70	0,49%
TOTAL	R\$ 2.485.833.037,28	100,00%

RENDA FIXA X RENDA VARIÁVEL X EXTERIOR		
	VALOR	%
RENDA FIXA	R\$ 1.488.137.947,04	59,86%
RENDA VARIÁVEL	R\$ 776.364.447,44	31,23%
EXTERIOR	R\$ 221.330.642,80	8,90%
TOTAL	R\$ 2.485.833.037,28	100,00%

VOLATILIDADE DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS E TÍTULOS		
	VALOR	%
Volatilidade Muito Baixa	R\$ 471.861.155,54	18,98%
Volatilidade Baixa	R\$ 250.132.679,09	10,06%
Volatilidade Média	R\$ 657.236.237,96	26,44%
Volatilidade Alta	R\$ 635.082.913,12	25,55%
Volatilidade Muito Alta	R\$ 471.520.051,58	18,97%
TOTAL	R\$ 2.485.833.037,28	100,00%

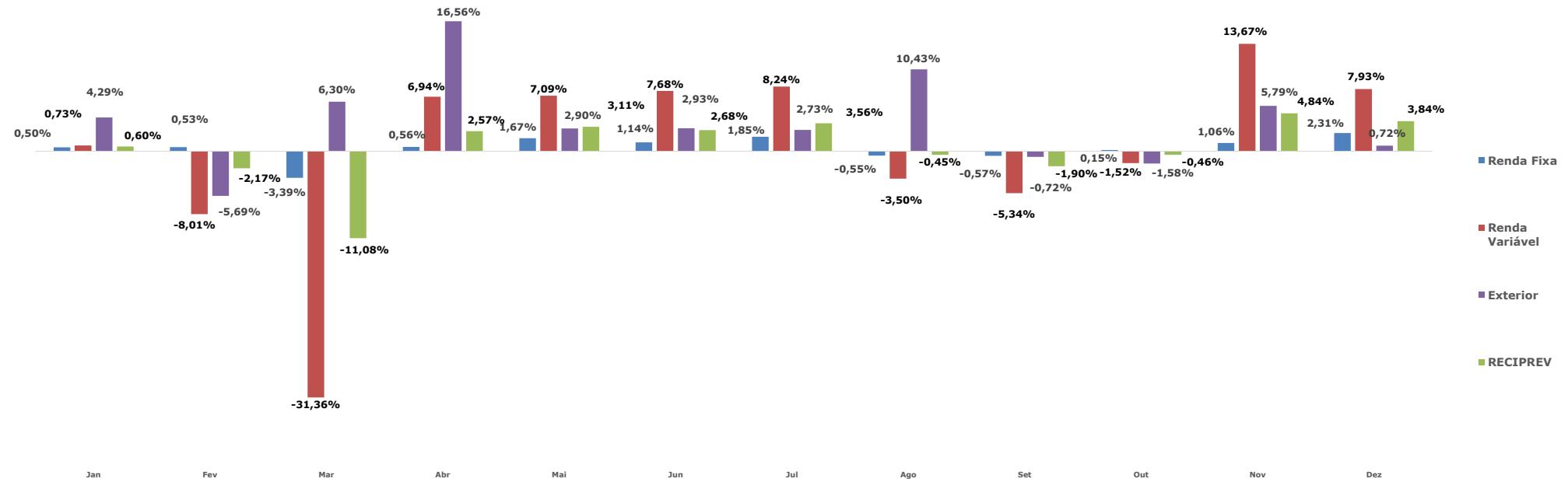
Posição dos Gestores e Administradores da Carteira de Investimentos RECIPREV 2020

VOLUME DE APLICAÇÕES POR GESTOR				
GESTOR	VALOR APLICADO	% CARTEIRA	% MÁXIMO PERMITIDO	Percentual do Volume de Recursos Reciprev em relação ao Volume ANBIMA de Gestão
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 27.346.258,68	1,10%		0,17%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 202.890.888,11	8,16%		0,02%
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 289.352.921,66	11,64%		0,05%
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$ 251.238,12	0,01%		0,00%
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 725.659,69	0,03%		0,03%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 1.132.989.017,32	45,58%		0,28%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 50.127.787,26	2,02%		2,94%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 64.585.748,50	2,60%		0,01%
LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.385.688,09	0,14%		0,15%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 18.626.736,42	0,75%		0,30%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 18.335.314,87	0,74%		1,98%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 3.102.132,68	0,12%		0,03%
SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA	R\$ 152.377.398,86	6,13%		0,05%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 7.612.026,64	0,31%		0,20%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$ 58.325.099,05	2,35%		0,20%
TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	R\$ 163.388.750,23	6,57%		0,00%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 109.394.234,86	4,40%		0,30%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$ 123.449.394,62	4,97%		0,28%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT (GRUPO XP)	R\$ 36.644.298,92	1,47%		0,04%
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA (GRUPO XP)	R\$ 22.922.442,70	0,92%		0,03%
TOTAL	R\$ 2.485.833.037,28	100,00%		

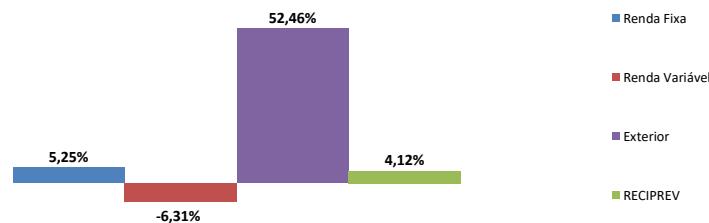
VOLUME DE APLICAÇÕES POR ADMINISTRADOR				
ADMINISTRADOR	VALOR APLICADO	% CARTEIRA	% MÁXIMO PERMITIDO	% MÁXIMO PERMITIDO
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$ 6.525.713,30	0,026%		0,00%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 87.508.191,20	19,73%		0,06%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 7.612.026,64	0,31%		0,02%
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$ 152.377.398,86	6,13%		0,04%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$ 490.504.243,75	19,73%		0,65%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 206.718.680,48	8,32%		0,06%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	R\$ 160.093.693,54	6,44%		1,99%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 1.207.718.651,20	48,58%		0,02%
LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.385.688,09	0,14%		5,45%
TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	R\$ 163.388.750,23	6,57%		0,01%
TOTAL	R\$ 2.485.833.037,28	100,00%		0,00%

SEGMENTO	Tipo de Ativo	Limite da Reolução CMN (%)	Posição Atual da Carteira (R\$)	Posição Atual da Carteira (%)	Estratégia de Alocação - Política de Investimento de 2020			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	Indice	Meta de Rentabilidade	Resumo da Estratégia	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
Renda Fixa	Títulos Públicos de emissão do TN - Art. 7º, I, a	100,00%	R\$ 163.388.750,23	6,57%	0,00%	6,61%	100,00%	5,00%	100,00%	Outros	5,00%	Manutenção	0,00%	0,00%
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	100,00%	R\$ 1.065.535.395,00	42,86%	0,00%	52,19%	100,00%	5,00%	41,00%	IMA-B 5	5,00%	Aumento	0,00%	0,00%
					44,00%	IMA-B	5,00%	Manutenção						
					0,00%	0,00%	0,00%	0,00						
					0,00%	0,00%	0,00%	0,00						
					0,00%	0,00%	0,00%	0,00						
Renda Fixa	ETF - 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, c	100,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Fixa	Operações compromissadas - Art. 7º, II	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Fixa	FI Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, a	60,00%	R\$ 14.148.947,81	0,57%	0,00%	1,00%	75,00%	5,00%	100,00%	0,00%	0,00	Manutenção	0,00%	0,00%
Renda Fixa	ETF - Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, b	60,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	75,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Fixa	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	40,00%	R\$ 245.064.853,99	9,86%	0,00%	7,00%	55,00%	5,00%	3,00%	CDI	5,00%	Manutenção	0,00%	0,00%
					83,00%	IMA-B	5,00%	Aumento						
					14,00%	IMA-B 5	5,00%	Aumento						
					0,00%	0,00%	0,00%	0,00						
					3,00%	CDI	5,00%	Manutenção						
Renda Fixa	ETF - Demais Indicadores de RF - Art. 7º, IV, b	40,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	55,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Fixa	Letras Imobiliárias Garantidas - Art.7º, V, b	20,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Fixa	CDB - Certificado de Depósito Bancário - Art. 7º, VI, a	15,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Fixa	Poupança - Art. 7º, VI, b	15,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Fixa	FI em Direitos Creditários - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,20%	5,00%	5,00%	100,00%	CDI	5,00%	Redução	0,00%	0,00%
Renda Fixa	FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, b	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Fixa	FI Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, VII, c	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Variável	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, a	30,00%	R\$ 197.481.713,32	7,94%	0,00%	5,00%	45,00%	12,00%	31,00%	IBRX	12,00%	Manutenção	0,00%	0,00%
					69,00%	Outros	12,00%	Manutenção						
					0,00%	0,00%	0,00%	0,00						
Renda Variável	ETF - Índice de Ações (c/ no mínimo 50) - Art. 8º, I, b	30,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	45,00%	12,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Variável	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	20,00%	R\$ 557.531.513,72	22,43%	0,00%	18,40%	35,00%	12,00%	52,00%	IBOVESPA	12,00%	Aumento	0,00%	0,00%
									13,00%	IBRX	12,00%	Aumento		
									35,00%	Outros	12,00%	Aumento		
									0,00%	0,00%	0,00%	0,00		
									52,00%	IBOVESPA	12,00%	Aumento		
Renda Variável	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, II, b	20,00%	R\$ 557.531.513,72	22,43%	0,00%	18,40%	35,00%	12,00%	13,00%	IBRX	12,00%	Aumento		
									35,00%	Outros	12,00%	Aumento		
Renda Variável	ETF - Demais Índices de Ações - Art. 8º, II, b	20,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	12,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Variável	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	10,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Renda Variável	FI em Participações - Art. 8º, IV, a	5,00%	R\$ 10.637.061,08	0,43%	0,00%	1,00%	2,00%	0,00%	100,00%	Outros	0,00	Redução	0,00%	0,00%
Renda Variável	FI Imobiliários - Art. 8º, IV, b	5,00%	R\$ 10.714.159,31	0,43%	0,00%	0,60%	1,00%	5,00%	66,00%	Outros	5,00%	Redução	0,00%	0,00%
									34,00%	Outros	5,00%	Redução		
Renda Variável	FI Ações - Mercado de Acesso Art. 8º, IV, "c"	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Exterior	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Exterior	10,00%	R\$ 46.667.555,75	1,88%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Exterior	FIC Aberto - Investimento no Exterior	10,00%	R\$ 36.644.298,92	1,47%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Exterior	Fundo de Ações - BDR Nível I	10,00%	R\$ 138.018.788,13	5,55%	0,00%	8,00%	10,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Saldo Conta Corrente					R\$ 1,00	0,00%		100,00%						
Total por Renda Fixa, Variável e Exterior					R\$ 2.485.833.038,28	100,00%								

Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2020



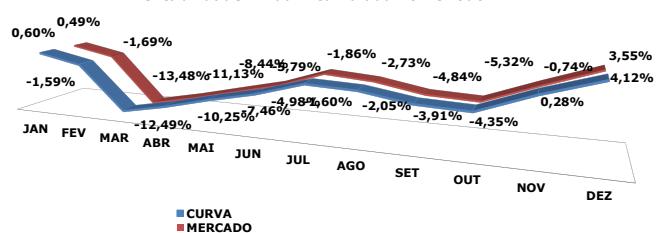
Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2020



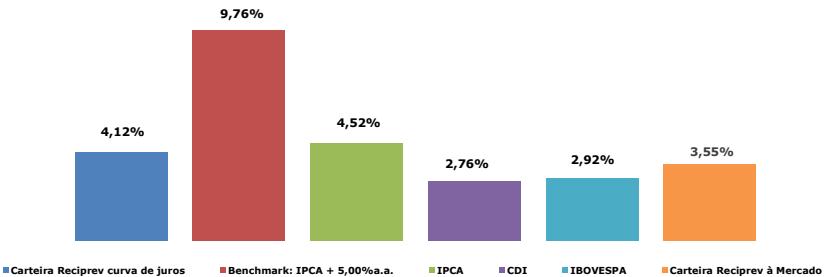
Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2020

% Atingimento acumulado anual da meta na Curva	-5,64%
% Atingimento acumulado anual da meta à Mercado	-6,21%

Rentabilidade Anual Acumulada no Período



Acumulado Janeiro a Dezembro 2020 - Rentabilidade Carteira X Índices



Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

Relatórios da Carteira de Investimentos RECIFIN

Data da Posição:	31/12/2020
------------------	------------

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Rendimento no Mês (R\$)	Saldo (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 1.460,42	R\$ 112.282,39
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$ 1.289,91	R\$ 59.820,03
Saldo Conta Corrente				
Total Carteira RECIFIN				
			R\$ 2.750,33	R\$ 172.235,27

RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

ANO 2020

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV - VALOR PELA CURVA DE JUROS			
DATA	SALDO R\$	RENDIMENTO R\$	% RENDIMENTO CARTEIRA NA CURVA
31/01/2020	R\$ 2.362.607.688,92	R\$ 14.498.031,05	0,60%
28/02/2020	R\$ 2.341.219.913,55	R\$ 52.265.163,76	-2,17%
31/03/2020	R\$ 2.086.996.975,59	R\$ 259.980.179,07	-11,08%
30/04/2020	R\$ 2.147.944.161,89	R\$ 54.162.026,46	2,57%
30/05/2020	R\$ 2.212.778.240,36	R\$ 65.783.658,79	3,11%
30/06/2020	R\$ 2.270.728.616,79	R\$ 60.602.755,25	2,68%
31/07/2020	R\$ 2.347.300.564,18	R\$ 80.857.398,74	3,56%
31/08/2020	R\$ 2.334.694.012,89	R\$ 10.481.763,18	-0,45%
30/09/2020	R\$ 2.287.611.654,27	R\$ 44.640.599,41	-1,91%
31/10/2020	R\$ 2.273.628.458,07	R\$ 10.473.340,74	-0,46%
30/11/2020	R\$ 2.380.577.607,85	R\$ 109.211.308,82	4,84%
31/12/2020	R\$ 2.485.833.038,28	R\$ 91.040.436,99	3,84%
TOTAL	R\$ 98.314.570,92	R\$ 98.314.570,92	4,12%

FUNDO FINANCEIRO RECIFIN			
	SALDO R\$	RENDIMENTO R\$	
	R\$ 464.186,93	R\$ 1.539,95	
	R\$ 16.027.156,78	R\$ 28.003,36	
	R\$ 3.133.265,08	R\$ 45.896,45	
	R\$ 855.829,40	R\$ 17.765,16	
	R\$ 438.297,81	R\$ 7.191,23	
	R\$ 244.403,90	R\$ 6.674,06	
	R\$ 84.209,98	R\$ 1.209,35	
	R\$ 151.740,00	R\$ 2.866,64	
	R\$ 60.932,56	R\$ 603,99	
	R\$ 78.855,05	R\$ 751,41	
	R\$ 76.593,35	R\$ 2.999,91	
	R\$ 172.235,27	R\$ 2.750,33	
TOTAL	R\$ 117.043,86	R\$ 117.043,86	

TOTAL FUNDOS: RECIPREV E RECIFIN	
SALDO R\$	RENDIMENTO R\$
R\$ 2.363.071.875,85	R\$ 14.499.571,00
R\$ 2.357.247.070,33	R\$ 52.237.160,42
R\$ 2.090.130.240,67	R\$ 259.934.281,62
R\$ 2.148.799.991,29	R\$ 54.179.791,62
R\$ 2.213.216.538,17	R\$ 65.790.850,02
R\$ 2.270.973.020,69	R\$ 60.609.429,31
R\$ 2.347.384.774,16	R\$ 80.858.609,09
R\$ 2.334.845.752,89	R\$ 10.478.896,54
R\$ 2.287.672.586,83	R\$ 44.641.203,40
R\$ 2.273.707.313,12	R\$ 10.472.589,33
R\$ 2.380.654.201,20	R\$ 109.214.308,73
R\$ 2.486.005.273,55	R\$ 91.043.187,32
TOTAL	R\$ 98.431.614,78

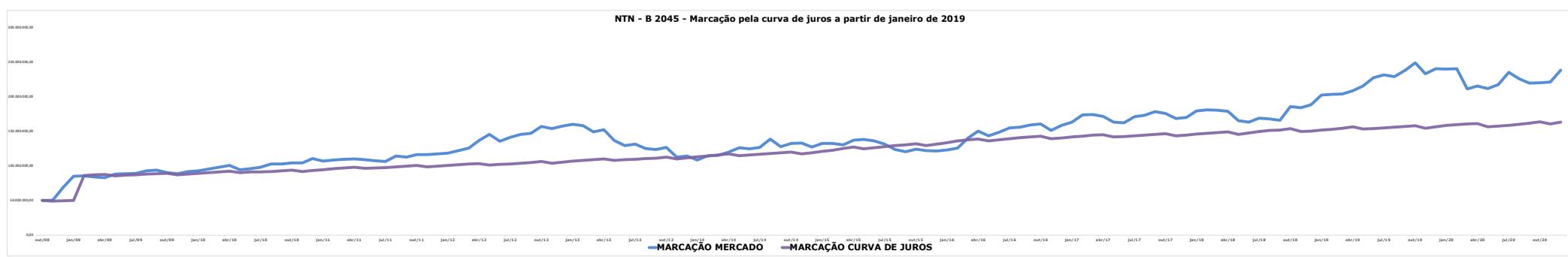
Evolução da carteira considerando entradas líquidas e pagamentos

ANO	RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES E PARCELA MENTO	PAGAMENTOS: FOLHA E CONSIGNAÇÕES	PAGAMENTOS: TAXA DE ADMINISTRAÇÃO E OUTRAS DESPESAS	ENTRADA LÍQUIDA ANUAL	RENDIMENTOS ANUAL	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DA CARTEIRA À MERCADO
2014	R\$ 115.431.675,14	-R\$ 3.221.190,93	-R\$ 18.536,66	R\$ 112.191.947,55	R\$ 72.522.075,78	R\$ 886.852.901,01
2015	R\$ 117.302.754,14	-R\$ 4.189.355,35	-R\$ 16.578.587,13	R\$ 96.534.811,66	R\$ 95.546.968,68	R\$ 1.078.056.212,44
2016	R\$ 143.494.169,55	-R\$ 7.018.990,34	-R\$ 2.720.504,82	R\$ 133.754.674,39	R\$ 202.325.745,52	R\$ 1.414.193.238,21
2017	R\$ 180.636.860,66	-R\$ 68.732.744,46	-R\$ 2.720.462,94	R\$ 109.183.653,26	R\$ 176.804.521,49	R\$ 1.700.048.323,54
2018	R\$ 214.384.992,90	-R\$ 129.774.770,08	-R\$ 40.998.812,81	R\$ 43.611.410,01	R\$ 190.832.868,93	R\$ 1.933.190.049,07
2019	R\$ 215.935.879,37	-R\$ 127.033.834,35	-R\$ 4.116.698,14	R\$ 84.785.346,88	R\$ 347.109.435,32	R\$ 2.442.162.349,29
2020	R\$ 170.946.149,56	-R\$ 137.850.291,09	-R\$ 3.963.467,19	R\$ 29.132.391,28	R\$ 98.314.570,92	R\$ 2.560.487.104,88
TOTAIS	R\$ 1.158.132.481,32	-R\$ 477.821.176,60	-R\$ 71.117.069,69	R\$ 609.194.235,03	R\$ 1.183.456.186,64	R\$ 1.183.456.186,64

GRÁFICO COMPARATIVO DA CARTEIRA RECIPREV

DATA	% RENDIMENTO CARTEIRA NA CURVA	% RENDIMENTO CARTEIRA À MERCADO	IPCA	IPCA + 6% até 31/12/2019. A partir de 01/01/2020 IPCA + 5,00%. A partir de 01/01/2021 IPCA + 5,41%	CDI	IMA-B	IBOVESPA	% CRESCIMENTO CARTEIRA NA CURVA	% CRESCIMENTO CARTEIRA À MERCADO
31/01/2020	0,60%	0,49%	0,21%	0,62%	0,38%	0,26%	-1,63%	0,19%	0,08%
28/02/2020	-2,17%	-2,17%	0,25%	0,66%	0,29%	0,45%	-8,43%	-0,91%	-0,90%
31/03/2020	-11,08%	-12,00%	0,07%	0,48%	0,34%	-6,97%	-29,90%	-10,86%	-11,76%
30/04/2020	2,57%	2,71%	-0,31%	0,10%	0,28%	1,31%	10,25%	2,92%	3,03%
30/05/2020	3,11%	3,03%	-0,38%	0,01%	0,24%	1,52%	8,57%	3,02%	2,99%
30/06/2020	2,68%	2,90%	0,26%	0,67%	0,21%	2,05%	8,76%	2,62%	2,78%
31/07/2020	3,56%	4,17%	0,36%	0,81%	0,19%	4,39%	8,27%	3,37%	3,98%
31/08/2020	-0,45%	-0,88%	0,24%	0,65%	0,16%	-1,80%	-3,44%	-0,54%	-0,97%
30/09/2020	-1,91%	-2,17%	0,64%	1,05%	0,16%	-1,51%	-4,80%	-2,02%	-2,27%
31/10/2020	-0,46%	-0,51%	0,86%	1,27%	0,16%	0,21%	-0,69%	-0,61%	-0,66%
30/11/2020	4,84%	4,84%	0,89%	1,30%	0,15%	2,00%	15,90%	4,70%	4,75%
31/12/2020	3,84%	4,32%	1,35%	1,76%	0,16%	4,85%	9,30%	4,42%	4,90%
TOTAL	4,12%	3,55%	4,52%	9,76%	2,75%	6,40%	2,92%	5,41%	4,85%

NTN - B 2045 - Marcação pela curva de juros a partir de janeiro de 2019



FLUXO MENSAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

ANO 2020

MÊS

DEZEMBRO

RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO				
		COMPETÊNCIA	VALOR	ACUMULADO ANUAL
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		Contrib. patronal da EDUCAÇÃO 04/05,06/07,08/09/10 e 11/2020	R\$ 26.634.265,38 R\$	61.430.388,92
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL INATIVOS/PENSIONISTAS)		-	R\$ - R\$	3.833.727,41
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		11/2020	R\$ 7.783.809,35 R\$	97.266.966,78
PARCELAMENTO		Parcelamento 60/60	R\$ 395.393,86 R\$	4.477.516,49
COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA		12/2020	R\$ 363.661,87 R\$	2.614.548,89
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		11 e 12/2020 e Décimo Terceiro	R\$ 154.012,88 R\$	717.291,70
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		11 e 12/2020 e Décimo Terceiro	R\$ 142.896,70 R\$	605.709,37
TOTAL		R\$	35.474.040,04 R\$	170.946.149,56
RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS				
			VALOR	ACUMULADO ANUAL
BB RECEBIVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)		R\$	24.000,00 R\$	934.001,20
SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)		R\$	- R\$	1.491.104,64
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÉNIORES) - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		R\$	- R\$	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		R\$	- R\$	1.246.836,14
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		R\$	- R\$	32.157.649,60
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		R\$	- R\$	1.500.598,92
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		R\$	- R\$	10.132.777,41
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219		R\$	- R\$	1.971.946,98
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220		R\$	- R\$	4.239.686,59
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570		R\$	- R\$	1.971.946,98
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571		R\$	- R\$	1.971.946,98
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)		R\$	- R\$	1.196.378,21
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)		R\$	- R\$	1.451.426,88
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)		R\$	- R\$	318.620,11
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)		R\$	- R\$	502.265,97
TOTAL		R\$	24.000,00 R\$	61.087.186,01
FOLHA DE PAGAMENTO E CONSIGNAÇÕES				
			VALOR	ACUMULADO ANUAL
FOLHA DE PAGAMENTO		-R\$	18.464.331,60 -R\$	115.282.227,42
CONSIGNAÇÕES		-R\$	2.439.761,65 -R\$	22.646.340,86
DEVOLUÇÕES DE FOLHA NÃO PROCESSADAS E DE CONSIGNAÇÕES		R\$	3.141,91 R\$	78.277,19
TOTAL		-R\$	20.900.951,34 -R\$	137.850.291,09
PAGAMENTOS DIVERSOS				
			VALOR	ACUMULADO ANUAL
TARIFA DE CORRETAGEM DE FUNDOS IMOLÍRIOS		R\$	- R\$	587,87
TARIFA DE CUSTÓDIA TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)		R\$	- R\$	-
CUSTO SELIC TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)		-R\$	501,25 -R\$	6.546,12
SISTEMA QUANTUM		-R\$	1.900,00 -R\$	22.800,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPREV		-R\$	357.593,93 -R\$	3.933.533,20
TOTAL		-R\$	359.995,18 -R\$	3.963.467,19
RESUMO GERAL				
			VALOR	ACUMULADO ANUAL
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO		R\$	35.474.040,04 R\$	170.946.149,56
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS		R\$	24.000,00 R\$	61.087.186,01
TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS E CONSIGNAÇÕES		-R\$	20.900.951,34 -R\$	137.850.291,09
TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS		-R\$	359.995,18 -R\$	3.963.467,19
TOTAL		R\$	14.237.093,52 R\$	90.219.577,29
CONTRATOS DE PRESTAÇÃO DE SERVIÇOS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS				
			VALOR	ACUMULADO ANUAL
CONTRATOS DE PRESTAÇÃO DE SERVIÇOS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS				
Contrato de Sistema de Banco de Dados - Paramita Tecnologia Consultoria Financeira Ltda (QUANTUM)		-R\$	1.900,00 -R\$	22.800,00
Contrato de Custódia Títulos Juros ao Banco do Brasil S.A. O custo é somente o da SELIC.		-R\$	501,25 -R\$	6.546,12
Contrato com a Corretora Santander. Destinado a venda do fundo: FII BB Recebíveis Imobiliário. Custo 0,10% de corretagem e os custos normais da operação.		R\$	- R\$	-
Contrato com a Corretora. Destinado a venda do fundo Socopa FII. Custo zero de corretagem. Somente os custos normais da operação.		R\$	- R\$	587,87
Contrato com a Corretora XPI. Destinado aos serviços de compra e venda de Títulos Públicos. Custo sobre as operações, quando houver, 0,001%		R\$	- R\$	-
Contrato com a Corretora Renascença. Destinado aos serviços de compra e venda de Títulos Públicos. Custo sobre as operações, quando houver, 0,001%		R\$	- R\$	-
Contrato de estudo de Asset Liability Management (ALM), Cash Flow Matching e Fronteira Eficiente.		-R\$	2.401,25 -R\$	29.933,99
TOTAL				

ESTATÍSTICA DA CARTERIA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

FUNDO	Benchmark	Retorno Médio Mensal	Retorno Médio Anual	Retorno Total	Maior Retorno	Menor Retorno	Qtd. mês Positivo	Qtd. mês Negativo	Qtd. mês acima do Benchmark	Qtd. mês abaixo do Benchmark	Risco Mensal Período	Risco Mensal 12 MESES	Risco Anual do Período	Em 68% dos dados o retorno ficou entre	Em 95% dos dados o retorno ficou entre	
A2 QUEST SMALL MID CAP FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Índice Small Cap	1,29%	16,60%	364,59%	14,87%	-37,75%	80	40	75	45	6,14%	14,04%	0,21	-4,86% a 7,43%	-11,00% a 13,58%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,65%	8,05%	111,35%	1,17%	0,00%	115	1	1	115	0,28%	0,09%	0,01	0,36% e 0,93%	0,08% e 1,22%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	0,86%	10,84%	82,31%	2,53%	-1,34%	66	4	28	42	0,67%	0,71%	0,02	0,19% e 1,54%	-0,49% e 2,21%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + 6,00%	1,01%	12,85%	130,76%	5,90%	-1,71%	79	4	40	43	0,81%	0,92%	0,03	0,20% e 1,83%	-0,61% e 2,04%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + 6,00%	1,08%	13,78%	146,82%	5,14%	-3,13%	65	19	45	39	1,52%	1,15%	0,05	-0,44% e 2,60%	-1,96% e 4,12%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	1,04%	13,23%	133,71%	4,77%	-2,78%	69	13	39	43	1,38%	1,10%	0,05	-0,34% e 2,42%	-1,72% e 3,80%	
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	IOC	0,66%	8,18%	119,47%	15,33%	-30,82%	67	53	32	88	5,88%	12,38%	0,20	-5,22% e 6,54%	-11,10% a 12,42%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	IMA-B	1,02%	12,99%	239,29%	7,43%	-7,20%	87	33	64	56	2,22%	3,19%	0,08	-1,20% e 3,24%	-3,41% e 5,46%	
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	IBOVESPA	0,81%	10,11%	161,88%	16,03%	-27,45%	67	53	62	58	5,67%	11,30%	0,20	-4,86% e 6,47%	-10,53% e 12,14%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	CDI	0,47%	5,76%	63,95%	0,93%	-0,01%	104	2	0	106	0,26%	0,05%	0,01	0,21% e 0,73%	-0,05% e 0,96%	
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIFESTRATEGIA	IPCA+ 10,50%	-2,58%	-26,92%	-95,66%	39,38%	-83,41%	12	108	3	117	11,70%	31,83%	0,41	-14,28% e 9,12%	-25,98% e 20,82%	
TERAS BRASIL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIFESTRATEGIA	IPCA+6,00%	-1,83%	-19,83%	-76,67%	104,77%	-62,23%	8	71	7	72	16,54%	22,37%	0,57	-18,37% e 14,71%	-34,91% e 31,25%	
CAIXA BRASIL IMA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IDKA IPCA 2A	0,87%	10,95%	139,75%	2,90%	-1,45%	93	8	33	68	0,75%	0,87%	0,03	0,12% e 1,62%	-0,63% e 2,73%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	0,84%	10,59%	50,85%	2,88%	-1,17%	42	7	28	73	0,83%	0,69%	0,03	0,01% e 1,68%	-0,82% e 2,51%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,03%	13,07%	136,32%	6,15%	-3,32%	61	23	34	50	1,79%	1,56%	0,06	-0,76% e 2,82%	-2,55% e 4,61%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,97%	12,33%	97,06%	6,15%	-3,32%	51	19	27	43	1,64%	1,56%	0,06	-0,67% e 2,62%	-2,31% e 4,26%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,13%	14,42%	151,04%	9,10%	-6,82%	58	24	41	41	2,72%	3,24%	0,09	-1,59% e 3,85%	-4,31% e 6,57%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,10%	13,97%	114,45%	9,10%	-6,82%	50	20	37	33	2,61%	3,24%	0,09	-1,52% e 3,71%	-4,13% e 6,32%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA IBX-50	IBRX-50	0,38%	4,62%	57,05%	15,69%	-30,82%	65	55	48	72	6,23%	12,50%	0,22	-5,85% e 6,61%	-12,09% e 12,84%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Índice Small Cap	0,70%	8,70%	96,23%	15,73%	-35,06%	56	41	44	53	6,63%	13,65%	0,23	-5,94% e 7,33%	-12,57% e 13,97%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IRF-M 1+	0,93%	11,69%	158,39%	5,24%	-2,71%	78	25	34	69	1,44%	1,27%	0,05	-0,51% e 2,36%	-1,95% e 3,80%	
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BOR NÍVEL I	BDRX	1,86%	24,74%	424,71%	15,96%	-14,16%	60	30	29	61	5,29%	6,48%	0,18	-3,43% e 7,15%	-8,72% e 12,44%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,18%	15,15%	25,03%	12,64%	-31,94%	13	6	9	11	10,13%	12,64%	0,35	-8,94% e 11,31%	-19,07% e 21,43%	
CONSTITUÍCAO LEGAL BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,58%	7,18%	86,72%	14,01%	-31,14%	64	44	49	59	6,09%	12,20%	0,21	-5,51% e 6,67%	-11,59% e 12,75%	
CONSTITUÍCAO FUNDAMENTO FIA	IBOVESPA	0,96%	12,11%	213,58%	16,19%	-31,56%	75	45	72	48	6,00%	11,87%	0,21	-5,04% e 6,96%	-11,04% e 12,96%	
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IBOVESPA	1,21%	15,51%	89,05%	14,23%	-41,88%	35	18	29	24	8,24%	15,20%	0,29	-7,03% e 9,44%	-15,26% e 17,68%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	IPCA+8,00%	-0,63%	-7,35%	-45,01%	14,74%	-46,11%	1	93	1	93	5,00%	13,28%	0,17	-5,63% e 4,37%	-10,64% e 5,37%	
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-FI RF LP	IMA-B	0,97%	12,30%	186,85%	7,62%	-6,74%	77	32	47	62	2,34%	3,09%	0,08	-1,37% e 3,31%	-3,70% e 5,63%	
MONGERAL AEGON FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	1,31%	16,86%	26,33%	15,91%	-32,27%	12	6	10	8	10,59%	12,83%	0,37	-9,28% e 11,89%	-22,44%	
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBRX	0,77%	9,58%	149,68%	12,45%	-28,95%	78	42	60	60	5,02%	11,59%	0,17	-4,26% e 5,79%	-9,28% e 10,81%	
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIFESTRATEGIA	IPCA+0,00%	-0,25%	-2,92%	-22,68%	33,60%	-54,62%	15	89	4	100	6,81%	6,00%	0,24	-7,06% e 6,56%	-13,37%	
BB RECEBIMENTOS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO, FII	IPCA + 6,9506%	0,50%	11,37%	97,73%	20,19%	-16,98%	61	15	40	36	4,10%	8,54%	0,14	-3,20% e 5,00%	-7,30% e 9,11%	
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELIC AÇÕES	IBOVESPA	0,72%	8,95%	135,73%	12,66%	-33,48%	69	51	67	53	5,94%	12,69%	0,21	-5,22% e 6,65%	-11,16% e 12,59%	
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B 5	0,91%	11,42%	171,89%	3,10%	-1,75%	99	12	14	97	0,84%	1,00%	0,03	0,06% e 1,75%	-0,78% e 2,66%	
SOCORO FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	IPCA+7,50%	1,07%	13,64%	147,39%	12,50%	-4,41%	60	25	38	47	2,67%	4,47%	0,09	-1,60% e 3,74%	-4,26% e 6,41%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBRX-50	0,44%	5,40%	69,26%	14,70%	-38,66%	68	52	58	62	6,80%	14,34%	0,24	-6,36% e 7,24%	-14,05% e 13,37%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIRETORES CREDITÓRIOS MULTISETORIAL INVEST DURAS (COTAS SÊNIOR)	125% do DI	-13,56%	-82,59%	-100,00%	740,83%	-100,00%	71	12	47	36	100,17%	0,50%	3,47	-113,72% e 86,61%	-213,89% e 186,78%	
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - CÓDIGO: 1039219 (764)	IPCA +7,022999%	0,69%	8,63%	128,73%	11,73%	-22,16%	80	40	67	53	4,12%	0,48%	0,14	-3,43% e 4,81%	-7,55% e 8,93%	
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - CÓDIGO: 1039220 (765)	IPCA +7,020255%	0,69%	8,63%	128,72%	11,73%	-22,17%	80	40	67	53	4,12%	0,48%	0,14	-3,43% e 4,81%	-7,55% e 8,93%	
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - CÓDIGO: 6605070 (767)	IPCA+6,261127%	0,76%	9,46%	147,00%	11,73%	-14,83%	80	40	71	49	3,82%	0,47%	0,13	-3,06% e 4,58%	-6,89% e 8,40%	
TESOURO RFB (762)	IPCA+6,269771%	0,76%	9,45%	146,77%	11,73%	-14,92%	80	40	69	51	3,82%	0,47%	0,13	-3,07% e 4,58%	-6,89% e 8,40%	
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,92%	11,63%	200,53%	14,05%	-26,37%	78	42	67	53	4,85%	10,53%	0,17	-3,92% e 5,77%	-8,77% e 10,61%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	IDIV	0,81%	10,10%	122,99%	14,26%	-27,40%	62	38	48	52	5,18%	10,93%	0,18	-4,38% e 5,99%	-9,56% e 11,77%	
WESTERN ASSET IMABS ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	CDI	1,03%	13,12%	146,93%	4,11%	-2,49%	71	17	52	36	1,27%	1,57%	0,04	-0,24% e 2,30%	-1,51% e 3,57%	
WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	MSCI World	0,51%	6,36%	85,21%	16,66%	-32,60%	64	56	60	60	6,26%	13,03%	0,22	-5,75% e 6,77%	-12,01% e 13,03%	
WESTERN ASSET MACRO OPORTUNIDADE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	CDI	0,92%	11,57%	76,05%	5,99%	-10,55%	43	19	39	23	2,62%	4,46%	0,09	-1,70% e 3,53%	-4,32% e 6,15%	
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Sem benchmark	1,13%	14,50%	202,09%	15,80%	-30,08%	65	33	51	47	5,90%	10,93%	0,20	-4,77% e 7,04%	-12,94%	
MS GLOBAL OPORTUNIDADES ADVISORY FIC INVESTIMENTO NO EXTERIOR	MSCI World	4,93%	78,19%	86,98%	17,78%	-2,97%	10	3	9	4	6,33%	6,20%	0,22	-1,40% e 11,27%	-7,73% e 17,00%	
CARTEIRA RECIPREV		IPCA + 6% até 31.12.2019. De 01.01.2020 IPCA+5,00%. De 01.01.2021 IPCA+5,41%	0,90%	11,31%	191,85%	4,84%	-11,08%	93	27	60	60	1,88%	4,39%	0,07	-0,98% e 2,78%	-2,86% e 4,65%

FUNDO	Retorno Relativo ao Benchmark	Retorno Relativo ao CDI	Retorno Relativo ao IBOVESPA	Retorno Relativo ao IMA B	Retorno Relativo ao IPCA + 6% ano até 31/12/2019. A partir de 01/01/2020 IPCA + 5,00%. A partir de 01/01/2021 IPCA + 5,41%	Sharpe	Information Ratio	Tracking Error	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	Correlação CDI	Correlação IBOVESPA	Sharpe Modificado	Beta (12 meses)	Erro Quadrático Médio (EQM)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	136,85%	95,91%	170,52%	36,33%	51,47%	0,35	1,02	9,45%	11,60%	10,94%	-0,093	0,803	0,37	0,90	2,80%
BB PREVIDÊNCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-8,18%	-8,18%	17,43%	-36,46%	-27,54%	-0,97	-13,34	0,07%	1,12%	0,60%	0,998	-0,073	-31,09	0,98	0,08%
BB PREVIDÊNCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	-16,64%	12,81%	-20,99%	-16,64%	-1,82%	0,97	-0,58	6,06%	1,97%	1,57%	0,308	0,444	1,91	0,17	1,76%
BB PREVIDÊNCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	6,81%	27,99%	-7,64%	-13,42%	7,79%	1,39	0,39	2,77%	2,35%	1,90%	0,143	0,375	2,25	0,29	0,80%
BB PREVIDÊNCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	13,05%	35,44%	6,81%	-4,97%	14,07%	0,92	0,37	5,35%	3,59%	3,20%	0,098	0,534	1,15	0,28	1,54%
BB PREVIDÊNCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	-8,42%	30,33%	-7,53%	-8,42%	10,42%	0,90	-0,37	4,00%	3,32%	2,96%	0,106	0,549	1,16	0,28	1,15%
BB PREVIDÊNCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	-12,44%	-7,88%	27,79%	-35,60%	-28,45%	-0,04	-1,24	1,16%	10,51%	10,66%	-0,099	0,976	-0,04	0,92	0,35%
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	-0,44%	42,41%	97,56%	-0,44%	10,62%	0,51	-0,15	0,32%	4,70%	4,21%	0,082	0,588	0,58	0,94	0,09%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	52,49%	9,92%	52,49%	-23,16%	-14,62%	0,05	0,54	8,44%	10,29%	9,48%	-0,045	0,932	0,06	0,84	2,45%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	-21,95%	-21,95%	-9,35%	-42,50%	-38,52%	-3,37	-28,68	0,10%	0,89%	0,47%	0,997	-0,045	37,82	0,60	0,24%
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIFESTRATEGIA	-99,07%	-98,18%	-97,47%	-98,73%	-98,58%	-0,89	-1,08	40,32%	18,25%	5,14%	0,252	-0,214	-0,91	20,40	11,81%
TERAS BRASIL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIFESTRATEGIA	-88,70%	-86,67%	-89,96%	-90,17%	-88,59%	-0,50	-0,55	57,29%	26,84%	24,64%	-0,064	0,194	-0,51	0,80	16,48%
CAIXA BRASIL IMA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	-25,35%	18,26%	13,00%	-6,61%	-6,30%	0,84	-6,95	0,56%	2,11%	1,89%	0,224	0,395	1,36	0,97	0,17%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRÁTÉGICA RENDA FIXA	-1,61%	17,12%	-21,54%	-12,14%	2,82%	2,61	-0,14	3,20%	2,22%	1,91%	0,234	0,480	3,67	0,45	1,03%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	-9,01%	29,68%	2,27%	-9,01%	9,22%	0,66	-0,42	3,65%	3,99%	3,66%	0,037	0,542	0,80	0,41	1,05%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	-9,89%	21,94%	-14,60%	-9,89%	6,12%	0,66	-0,51	3,96%	3,69%	3,42%	0,049	0,606	0,83	0,41	1,14%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	-1,63%	39,99%	-0,67%	-1,63%	18,61%	0,58	-0,10	2,81%	5,64%	5,27%	0,014	0,666	0,66	0,95	0,81%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	-1,94%	32,70%	-7,06%	-1,94%	15,49%	0,60	-0,05	7,30%	5,42%	5,09%	0,018	0,707	0,68	0,95	2,10%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	-22,67%	-34,08%	-8,55%	-53,92%	-48,80%	-0,21	-0,98	2,77%	10,83%	11,18%	-0,110	0,985	-0,22	0,92	0,83%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	0,73%	-0,8%	-5,24%	-17,62%	-20,11%	-0,01	0,02	4,76%	11,85%	11,64%	-0,084	0,887	-0,01	0,91	1,37%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,06%	25,79%	18,29%	-1,67%	-0,47%	0,59	-0,85	0,32%	3,30%	3,03%	0,145	0,521	0,74	0,92	0,09%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-15,20%	175,57%	109,22%	106,98%	129,40%	0,86	-1,30	2,14%	10,70%	12,59%	-0,136	-0,230	0,91	0,92	0,64%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIFESTRATEGIA	1,93%	17,81%	1,93%	6,13%	7,72%	0,33	0,18	7,66%	18,40%	17,59%	-0,087	0,975	0,33	0,93	2,16%
CONSTÂNCIA LEGA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-10,96%	-12,54%	-10,96%	-36,93%	-31,32%	-0,08	-0,18	7,73%	10,79%	10,19%	-0,078	0,944	-0,08	0,91	2,22%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	82,59%	31,62%	82,39%	-7,99%	2,23%	0,15	0,70	9,33%	11,01%	10,08%	-0,081	0,913	0,15	0,87	2,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-8,97%	40,48%	-8,97%	8,09%	25,16%	0,30	-0,26	9,68%	15,16%	13,69%	0,028	0,944	0,31	1,12	2,77%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	-80,11%	-71,78%	-73,47%	-76,55%	-76,80%	-0,94	-1,24	17,04%	7,77%	4,29%	0,192	-0,155	-1,00	10,52	5,13%
MONGERAL AEGON INFILAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	27,10%	82,82%	27,15%	37,43%	61,09%	0,89	4,03	0,73	4,84%	4,41%	0,060	0,619	1,04	0,91	0,21%
MONGERAL AEGON FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	7,16%	19,59%	7,16%	11,24%	9,32%	0,36	0,84	6,28%	19,33%	18,28%	-0,110	0,986	0,36	0,96	1,82%
QUELIZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	10,24%	4,80%	45,38%	-26,74%	-18,60%	0,03	0,12	9,17%	9,16%	8,22%	-0,068	0,881	0,03	0,86	2,64%
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIFESTRATEGIA	-76,96%	-62,63%	-59,84%	-71,14%	-70,47%	-0,49	-0,76	23,64%	11,26%	12,80%	-0,051	-0,069	-0,52	-4,75	6,88%
BB RECEBÉNIOS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	-2,16%	15,96%	1,82%	-11,61%	-1,27%	0,18	-0,03	14,20%	7,73%	7,12%	0,003	0,170	0,20	3,02	4,07%
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	37,26%	-1,6%	37,26%	-30,83%	-23,15%	-0,01	0,46	7,42%	10,67%	10,11%	-0,080	0,947	-0,01	0,94	2,19%
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	-1,74%	24,05%	19,53%	-11,64%	-2,82%	0,88	-2,60	0,08%	2,30%	2,02%	0,185	0,440	1,30	0,91	0,03%
SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,30%	34,70%	9,68%	-5,98%	12,80%	0,51	0,02	9,18%	5,49%	5,92%	-0,037	0,243	0,57	1,82	2,63%
SUL AMÉRICA EQUITIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-16,66%	-28,96%	-1,44%	-50,33%	-44,82%	-0,16	-0,18	10,75%	11,88%	11,23%	-0,102	0,889	-0,16	1,03	3,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTIFESTRATORAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIOR)	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-0,26	-0,27	347,11%	181,01%	164,91%	-0,082	0,099	-0,26	-1,16	100,77%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 1039219 (7604)	-32,19%	-3,99%	33,19%	-32,88%	-25,43%	-0,03	-0,30	14,27%	7,56%	7,68%	0,098	0,295	-0,03	0,03	4,11%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 1039219 (7604)	-32,19%	-4,00%	33,18%	-32,88%	-25,43%	-0,03	-0,30	14,27%	7,56%	7,68%	0,098	0,295	-0,03	0,03	4,11%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 665057 (7647)	-21,52%	3,67%	43,82%	-27,52%	-19,47%	0,03	-0,20	13,24%	7,11%	7,13%	0,099	0,343	0,03	0,03	3,81%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 665057 (10322)	-21,65%	3,58%	43,69%	-27,59%	-19,55%	0,03	-0,20	13,25%	7,12%	7,14%	0,099	0,343	0,03	0,03	3,81%
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	74,99%	26,14%	74,99%	-11,81%	-2,02%	0,15	0,50	12,17%	9,01%	8,88%	-0,072	0,854	0,16	0,78	3,52%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPP	5,22%	10,75%	6,90%	-11,56%	-12,02%	0,07	0,05	14,24%	9,47%	9,38%	-0,099	0,874	0,08	0,95	4,09%
WESTERN ASSET IMABS ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	6,63%	31,53%	3,77%	-3,91%	9,37%	0,94	0,56	1,76%	3,13%	2,91%	0,066	0,505	1,24	1,38	0,51%
WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	7,85%	-22,26%	7,85%	-45,65%	-39,62%	-0,13	0,10	8,23%	11,02%	11,33%	-0,068	0,933	-0,13	0,95	2,37%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,60%	18,60%	-32,15%	-17,57%	4,39%	0,40	0,40	9,00%	5,26%	4,85%	0,121	0,726	0,46	-2,143	2,60%
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	44,73%	51,77%	44,84%	26,15%	21,72%	0,28	0,39	13,15%	11,03%	8,96%	0,006	0,884	0,29	0,95	3,79%
HS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,78%	81,8%	70,03%	72,26%	67,59%	3,43	4,27	8,69%	15,52%	17,15%	0,040	-0,008	3,48	0,91	3,17%
CARTEIRA RECIPREV	-14,77%	22,50%	69,94%	-14,36%	-4,85%	0,34	-0,28	6,46%	4,00%	3,60%	0,057	0,688	0,40	1,21	1,86%

CONCEITOS

* Base de dados: Quantum; Económica; ANBIMA; CETIP; Fundos de Investimentos; Carteira RECIPREV;

**Período de análise: A partir de janeiro de 2011 até o mês deste relatório, ou consideramos para os cálculos o mês de início das atividades de captações dos ativos (Início do Fundo) quando posterior a janeiro de 2011. Não são consideradas 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 espehar 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 as seguintes características: a) de renda; b) recebíveis com retornos programados; c) recebíveis sem retorno programado; Todos os fundos são cotados na BM&Bovespa. Pelas características dos fundos imobiliários, alguns indicadores demonstrados nesta planilha podem não cumprir de forma correta sua função conceitual

****A Reciprev possui fundos de investimentos em participação com diversos prazos de retorno do capital investido e diversos benchmarks. Alguns possuem curva "J" maiores que outros. Pelas características dos fundos de investimentos em participação, alguns indicadores demonstrados nesta planilha podem não cumprir de forma correta sua função conceitual

*****A Reciprev possui fundos de investimentos em direitos creditórios com diversos prazos de retorno do capital investido e diversos benchmarks. Pelas características dos fundos de investimentos em direitos creditórios alguns indicadores demonstrados nesta planilha podem não cumprir de forma correta sua função conceitual

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

>Benchmark: Indicador de retorno do fundo

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

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

>Retorno Total: Quant o ativo proporcionou de retorno total, 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 Mensal 12 meses: Desvio padrão dos retornos dos últimos 12 meses com periodicidade mensal;

>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;

>68% dos dados o retorno ficará entre: Com base nos retornos de 2011 até o mês anterior do ativo, os retornos futuros tendem a ficar entre o intervalo informado com 68% de possibilidades;

>95% dos dados o retorno ficará entre: Com base nos retornos de 2011 até o mês anterior do ativo, os retornos futuros tendem a ficar entre o intervalo informado com 95% de possibilidades;

>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);

>Retorno em relação ao CDI: Trata-se do comparativo do retorno do ativo em todo o período avaliado em relação ao retorno do CDI no mesmo período avaliado;

>Retorno em relação ao IBOVESPA: Trata-se do comparativo do retorno do ativo em todo o período avaliado em relação ao retorno do IBOVESPA no mesmo período avaliado;

>Retorno em relação ao IMA B: Trata-se do comparativo do retorno do ativo em todo o período avaliado em relação ao retorno do IMA-B no mesmo período avaliado;

>Retorno em relação ao IPCA+6% até dez/2019 e IPCA+5,00% a partir de 01/2020: Trata-se do comparativo do retorno do ativo em todo o período avaliado em relação ao retorno de IPCA+6% no mesmo período avaliado e a partir de 01.01.2020 IPCA + 5,00%

>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 Ratio: Dado pela fórmula: $(\text{Retorno médio anual do ativo} - \text{Retorno médio anual do Benchmark}) / \text{Track Error}$. Portanto, quanto maior, melhor;

>Track 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 HISTÓRICO (95%): Valor esperado de perda máxima ou da pior perda em um horizonte de tempo em um intervalo de confiança;

>VAR 12 MESES (95%): A pior perda esperada para um dia , em um intervalo de confiança de 95% , com periodicidade mensal dos últimos 12 meses;

>Correlação CDI: Correlação do ativo com o CDI, ou seja, como o ativo se movimenta em relação ao comportamento do CDI. Se igual ou próximo de zero, não há correlação. Se positiva, próxima de +1, têm mesmo sentido de movimento. Se negativa, próxima de -1, têm sentidos opostos de movimentos;

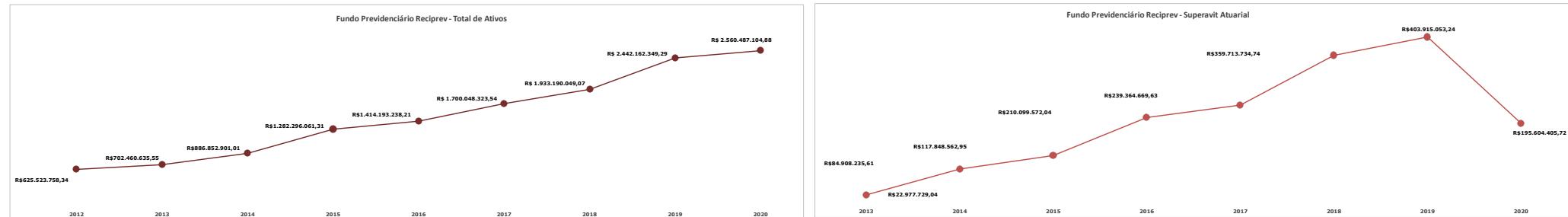
>Correlação Ibovespa: Correlação do ativo com o Ibovespa, ou seja, como o ativo se movimenta em relação ao comportamento do Ibovespa. Se igual ou próximo de zero, não há correlação. Se positiva, próxima de +1, têm mesmo sentido de movimento. Se negativa, próxima de -1, têm sentidos opostos de movimentos;

>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;

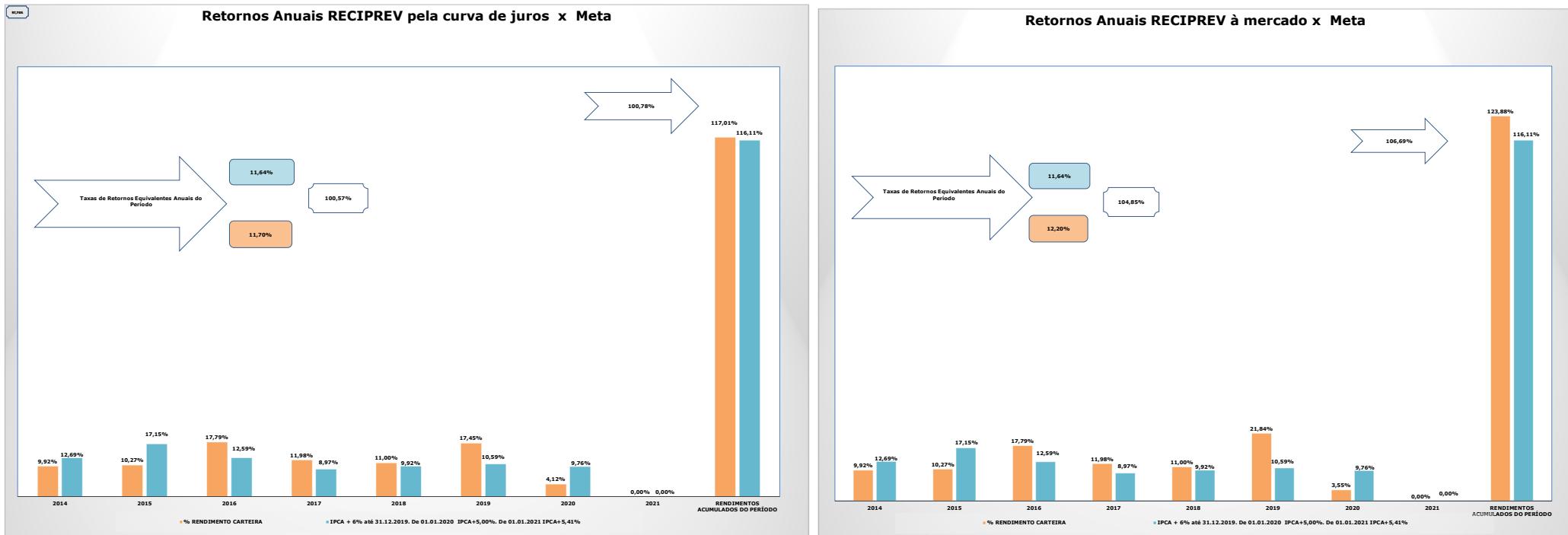
>Índice Beta: Indicador que mede a sensibilidade do ativo em relação a uma carteira, no caso foi considerado o benchmark de cada ativo. Ativos financeiros de Beta elevado são considerados mais agressivos, enquanto os de Beta mais baixo são mais conservadores;

>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;

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



RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV: 2014 À 2020



RESUMOS OPERACIONAIS - QUANTIDADES APROXIMADAS: 2014 À 2020

Ano	Quantidade de Reuniões do Comitê de Investimentos (Atas)	Quantidade de Autorizações de Aplicações e Resgates - APR	Quantidade de Atestados de Compatibilidades de Investimentos de Longo Prazo	Quantidade de Decisões de Investimentos (Aplicações e Resgates)
2013	10	100	6	181
2014	12	175	20	278
2015	13	161	10	261
2016	12	167	3	323
2017	14	187	1	365
2018	13	298	0	461
2019	14	267	0	386
2020	14	208	0	293
TOTAIS	102	1.563	40	2.548

EQUIPE DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

PANORAMA MACROECONÔMICO

No mês de dezembro/2020, tivemos a "segunda onda" da COVID 19, acarretando impactos na economia mundial, incluindo o Brasil. O IPCA de dezembro/2020, ficou muito acima do projetado pelo mercado, com 1,35%. Desta modo, o IPCA para o ano de 2020, fechou em 4,52% , ficando muito acima da meta do ano que era de 4%.

DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

IPCA do mês de	DEZEMBRO	1,35%
Meta Atuarial para o mês de	DEZEMBRO	1,76%
Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em	DEZEMBRO	3,84%
Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2020		0,72%

Sendo		Meta Atuarial para o Ano de 2020		IPCA + 5,00% ao ano	
		Meta Atuarial acumulada no ano de 2020	9,76%		
		Renda Fixa	2,31%	Renda Variável	7,93%
		Percentual de atingimento da meta atuarial acumulada no ano de 2020		Exterior	0,72%
				4,12%	

A Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev possui a maior parte de seus recursos aplicados em fundos que têm como benchmark o IMA (Índice de Mercado da Anbima); compostos por títulos prefixados e pós-fixados, bem como atrelados a índice de preço. Possui, ainda, valores significativos aplicados em Renda Variável.

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 site: reciprev.recife.pe.gov.br.

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Divisão de Investimentos

Gustavo Lins Dourado
Equipe Investimentos

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDORES (RECIPREV)

Concordamos com as informações do presente relatório.

Manoel Carneiro Soares Cardoso
Diretor Presidente

Francisco Canindé Antunes Furtado Junior
Diretor Vice-Presidente

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Divisão de Investimentos

Gustavo Lins Dourado
Equipe Investimentos

Rodrigo Chagas de Sá
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

Originals assinados e arquivados na Reciprev

Recife (PE), 31 de dezembro de 2020

ASSINATURAS