

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: | 31/01/2018 |
|------------------|------------|

| Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores) | | |
|--|------------|-------------------------|
| Renda Fixa | | |
| BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | R\$ | 678.526.824,73 |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | R\$ | 486.380.182,26 |
| TESOURO NACIONAL | R\$ | 179.451.281,87 |
| SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA | R\$ | 35.866.204,49 |
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. - DTVM | R\$ | 33.353.269,71 |
| WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | R\$ | 32.819.370,36 |
| SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | R\$ | 15.687.276,51 |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA | R\$ | 12.286.372,59 |
| NOVA SRM ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS E FINANÇAS S.A. | R\$ | 6.953.476,00 |
| RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA | R\$ | 4.876.413,51 |
| TERCON INVESTIMENTOS LTDA | R\$ | 4.602.351,26 |
| SUL BRASIL GESTORA DE ATIVOS LTDA | R\$ | 2.964.019,80 |
| TOTAL RF | R\$ | 1.493.767.043,09 |
| Renda Variável | | |
| SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | R\$ | 38.469.862,41 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | R\$ | 32.396.438,12 |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | R\$ | 27.999.617,83 |
| XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA | R\$ | 24.356.568,86 |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA | R\$ | 24.174.362,73 |
| SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA | R\$ | 22.223.153,80 |
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. - DTVM | R\$ | 22.220.444,94 |
| ATICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA | R\$ | 16.260.368,79 |
| VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA | R\$ | 10.664.409,21 |
| QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA | R\$ | 7.428.492,81 |
| SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | R\$ | 7.321.419,48 |
| REAG GESTORA DE RECURSOS LTDA | R\$ | 6.514.855,81 |
| WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | R\$ | 5.492.750,33 |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA | R\$ | 4.858.863,75 |
| VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | R\$ | 2.814.160,93 |
| BRZ INVESTIMENTOS LTDA | R\$ | 2.239.264,51 |
| TOTAL RV | R\$ | 255.435.034,32 |
| SALDO CONTA CORRENTE | R\$ | 426.622,02 |
| PATRIMÔNIO | R\$ | 1.749.628.699,42 |

| Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores) | | |
|--|------------|-------------------------|
| Renda Fixa | | |
| BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | R\$ | 678.526.824,73 |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | R\$ | 486.380.182,26 |
| TESOURO NACIONAL | R\$ | 179.451.281,87 |
| BANCO SANTANDER BRASIL S.A. | R\$ | 35.866.204,49 |
| BANCO BRADESCO S.A. | R\$ | 33.353.269,71 |
| WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | R\$ | 32.819.370,36 |
| SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | R\$ | 19.396.260,57 |
| SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A. | R\$ | 15.687.276,51 |
| BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA | R\$ | 12.286.372,59 |
| TOTAL RF | R\$ | 1.493.767.043,09 |
| Renda Variável | | |
| BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | R\$ | 52.616.155,12 |
| BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA | R\$ | 52.488.492,22 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | R\$ | 39.494.566,38 |
| SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A. | R\$ | 38.469.862,41 |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | R\$ | 27.999.617,83 |
| BANCO SANTANDER BRASIL S.A. | R\$ | 22.223.153,80 |
| SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | R\$ | 7.321.419,48 |
| REAG ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA | R\$ | 6.514.855,81 |
| WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | R\$ | 5.492.750,33 |
| VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | R\$ | 2.814.160,93 |
| TOTAL RV | R\$ | 255.435.034,32 |
| SALDO CONTA CORRENTE | R\$ | 426.622,02 |
| PATRIMÔNIO | R\$ | 1.749.628.699,42 |

| Nome do Fundo | Gestor | Administrador | % PL RECIPIEV | % PL Fundo | Valor (R\$) | CNPJ | Rentabilidade do Produto (mensal) | Rentabilidade do Produto (anual) | Prazo de Liquidação | Artigo da Resolução 3.922/10 | Classificação Risco do Fundo |
|--|--|--|---------------|------------|--------------------|--------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|---------------------------------|------------------------------|
| AZ QUEST VALORE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - CRÉDITO PRIVADO | AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA | BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA | 0,70% | 8,07% | R\$ 12.286.372,59 | 19.782.311/0001-88 | 0,63% | 0,63% | Curto Prazo | FI Renda Fixa "Crédito Privado" | Risco Baixo |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 0,04% | 0,06% | R\$ 697.942,28 | 13.077.415/0001-05 | 0,49% | 0,59% | Curto Prazo | FI Renda Fixa - Geral | Risco Baixo |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 19,29% | 5,99% | R\$ 337.573.352,90 | 13.322.205/0001-35 | 0,96% | 0,95% | Curto Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Muito Baixo |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 9,95% | 3,68% | R\$ 174.086.600,85 | 07.442.078/0001-05 | 3,38% | 3,39% | Curto Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Muito Alto |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 1,24% | 7,44% | R\$ 21.609.598,29 | 15.486.093/0001-83 | 2,18% | 2,18% | Longo Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Alto |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 4,60% | 7,55% | R\$ 80.557.924,55 | 19.303.795/0001-35 | 1,09% | 1,09% | Longo Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Muito Alto |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 1,54% | 8,13% | R\$ 26.863.103,98 | 19.523.306/0001-50 | 2,05% | 2,05% | Longo Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Alto |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 0,77% | 3,68% | R\$ 13.403.486,98 | 20.734.937/0001-06 | 1,04% | 1,04% | Médio Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Baixo |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 1,36% | 2,03% | R\$ 23.734.814,91 | 19.523.305/0001-06 | 1,17% | 1,17% | Médio Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Baixo |
| BRANCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B | BRAM - BRANCO ASSET MANAGEMENT S.A. - DTVM | BANCO BRANCO S.A. | 1,90% | 2,30% | R\$ 33.256.627,89 | 08.702.798/0001-25 | 3,39% | 3,39% | Curto Prazo | FI Renda Fixa - Geral | Risco Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | BRAM - BRANCO ASSET MANAGEMENT S.A. - DTVM | BANCO BRANCO S.A. | 0,01% | 0,02% | R\$ 96.641,82 | 13.397.466/0001-14 | 0,31% | 0,01% | Curto Prazo | FI Renda Fixa - Geral | Risco Muito Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 5,71% | 7,48% | R\$ 99.982.875,00 | 18.598.256/0001-08 | 1,06% | 1,06% | Médio Prazo | FI Renda Fixa - Geral | Risco Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 1,27% | 5,61% | R\$ 22.133.880,00 | 18.598.288/0001-03 | 3,05% | 3,05% | Longo Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Médio |

| Nome do Fundo | Gestor | Administrador | % PL RECIPIEV | % PL Fundo | Valor (R\$) | CNPJ | Rentabilidade do Produto (mensal) | Rentabilidade do Produto (anual) | Prazo de Liquidação | Artigo da Resolução 3.922/10 | Classificação Risco do Fundo |
|---|--|--|---------------|------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|---|------------------------------|
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 1,52% | 2,61% | R\$ 26.618.540,00 | 20.139.595/0001-78 | 3,05% | 3,05% | Longo Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,35% | 10,87% | R\$ 6.094.096,00 | 19.769.046/0001-06 | 4,46% | 4,46% | 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 | 0,55% | 3,69% | R\$ 9.560.166,00 | 20.139.534/0001-00 | 4,46% | 4,46% | Longo Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 7,38% | 1,91% | R\$ 129.062.916,69 | 11.060.913/0001-10 | 1,31% | 1,31% | Curto Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 10,87% | 1,09% | R\$ 190.154.828,70 | 10.740.670/0001-06 | 0,57% | 0,57% | Curto Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,16% | 1,25% | R\$ 2.772.879,86 | 19.542.287/0001-00 | 1,32% | 1,32% | Longo Prazo | FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior | Risco Alto |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL VALE II | TERCON INVESTIMENTOS LTDA | SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | 0,08% | 6,21% | R\$ 1.371.251,35 | 23.426.324/0001-91 | 0,76% | 0,76% | Médio Prazo | FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior | Risco Alto |
| SUL INVEST FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL (SÊNIORES SÉRIES 6) | SUL BRASIL GESTORA DE ATIVOS LTDA | SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | 0,17% | 3,70% | R\$ 2.964.019,80 | 09.257.784/0001-02 | 1,19% | 1,19% | Médio Prazo | FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior | Risco Alto |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES) | RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA | SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | 0,28% | 14,22% | R\$ 4.876.413,51 | 13.633.964/0001-19 | 0,73% | 0,73% | Curto Prazo | FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior | Risco Alto |
| RDF - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS | TERCON INVESTIMENTOS LTDA | SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | 0,18% | 8,28% | R\$ 3.231.099,91 | 19.425.700/0001-56 | 0,88% | 0,88% | Médio Prazo | FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior | Risco Alto |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS SRM - SENIOR 3 | NOVA SRM ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS E FINANÇAS S.A. | SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | 0,40% | 5,39% | R\$ 6.953.476,00 | 09.260.031/0001-56 | 0,70% | 0,70% | Médio Prazo | FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior | Risco Alto |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF | SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA | BANCO SANTANDER BRASIL S.A. | 2,05% | 2,90% | R\$ 35.866.204,49 | 13.455.117/0001-01 | 1,31% | 1,31% | Curto Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Médio |
| SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RF CRÉDITO PRIVADO | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A | 0,40% | 0,64% | R\$ 7.023.873,89 | 04.899.128/0001-90 | 0,52% | 0,34% | Curto Prazo | FI Renda Fixa "Crédito Privado" | Risco Baixo |
| SUL AMÉRICA INFLATIE FI RF LONGO PRAZO | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A | 0,50% | 1,98% | R\$ 8.663.402,62 | 09.326.708/0001-01 | 4,08% | 0,13% | Curto Prazo | FI 100% Títulos Públicos | Risco Médio |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 10,26% | 0,00% | R\$ 179.451.281,87 | | 5,71% | 5,71% | Curto Prazo | Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) | Risco Médio |
| WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA | WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | 1,88% | 2,05% | R\$ 32.819.370,36 | 03.499.367/0001-90 | 0,81% | 0,81% | Curto Prazo | FI Renda Fixa - Geral | Risco Médio |
| Renda Fixa | | | 85,38% | | R\$ 1.493.767.043,09 | | | 2,00% | | | |

| Nome do Fundo | Gestor | Administrador | % PL RECIPIREV | % PL Fundo | Valor (R\$) | CNPJ | Rentabilidade do Produto (mensal) | Rentabilidade do Produto (anual) | Prazo de Liquidação | Artigo da Resolução 3.922/10 | Classificação Risco do Fundo |
|---|--|--|----------------|------------|-------------------|--------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|---|------------------------------|
| AZ LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA | BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA | 0,70% | 11,16% | R\$ 12.175.145,26 | 14.550.994/0001-24 | 11,45% | 11,45% | 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 | BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | 0,69% | 2,43% | R\$ 11.999.217,47 | 11.392.165/0001-72 | 9,22% | 9,22% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Muito Alto |
| BB AÇÕES PIPE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 0,38% | 5,40% | R\$ 6.613.002,76 | 17.116.227/0001-08 | 3,55% | 3,55% | Médio Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Alto |
| BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 0,25% | 8,27% | R\$ 4.400.298,03 | 18.270.783/0001-99 | 9,97% | 9,97% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Muito Alto |
| BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 1,22% | 10,05% | R\$ 21.383.137,33 | 10.418.335/0001-88 | 8,13% | 8,13% | Curto Prazo | FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações | Risco Muito Alto |
| BRANDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS | BRAM - BRANDESCO ASSET MANAGEMENT S.A. - DTVM | BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA | 1,27% | 1,93% | R\$ 22.220.444,94 | 06.916.384/0001-73 | 11,32% | 11,32% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Alto |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,00% | 0,00% | R\$ 0,00 | 05.900.798/0001-41 | 4,82% | 22,22% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Alto |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,85% | 4,57% | R\$ 14.826.979,58 | 15.154.220/0001-47 | 4,57% | 5,02% | Curto Prazo | FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações | Risco Muito Alto |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50 | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,49% | 8,55% | R\$ 8.512.638,25 | 03.737.217/0001-77 | 11,94% | 11,94% | Curto Prazo | FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações | Risco Alto |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII | RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 0,28% | 4,83% | R\$ 4.858.863,75 | 20.716.161/0001-93 | 1,02% | 1,02% | Longo Prazo | FI Imobiliários | Risco Médio |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,27% | 2,54% | R\$ 4.660.000,00 | 17.098.794/0001-70 | 9,64% | 9,64% | Curto Prazo | FI Imobiliários | Risco Médio |
| SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO | SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | 0,42% | 22,79% | R\$ 7.321.419,48 | 16.841.067/0001-99 | 2,90% | 2,90% | Curto Prazo | FI Imobiliários | Risco Médio |
| ÁTICO FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA | ATICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA | BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | 0,45% | 4,56% | R\$ 7.930.868,10 | 12.312.767/0001-35 | -0,14% | -0,14% | Médio Prazo | FI em Participações | Risco Muito Alto |
| ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA | ATICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA | BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | 0,48% | 3,14% | R\$ 8.329.500,70 | 11.490.580/0001-69 | -0,14% | -0,14% | Médio Prazo | FI em Participações | Risco Muito Alto |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA | REAG GESTORA DE RECURSOS LTDA | REAG ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA | 0,37% | 3,40% | R\$ 6.514.855,81 | 17.213.821/0001-09 | -0,10% | -0,10% | Longo Prazo | FI em Participações | Risco Muito Alto |

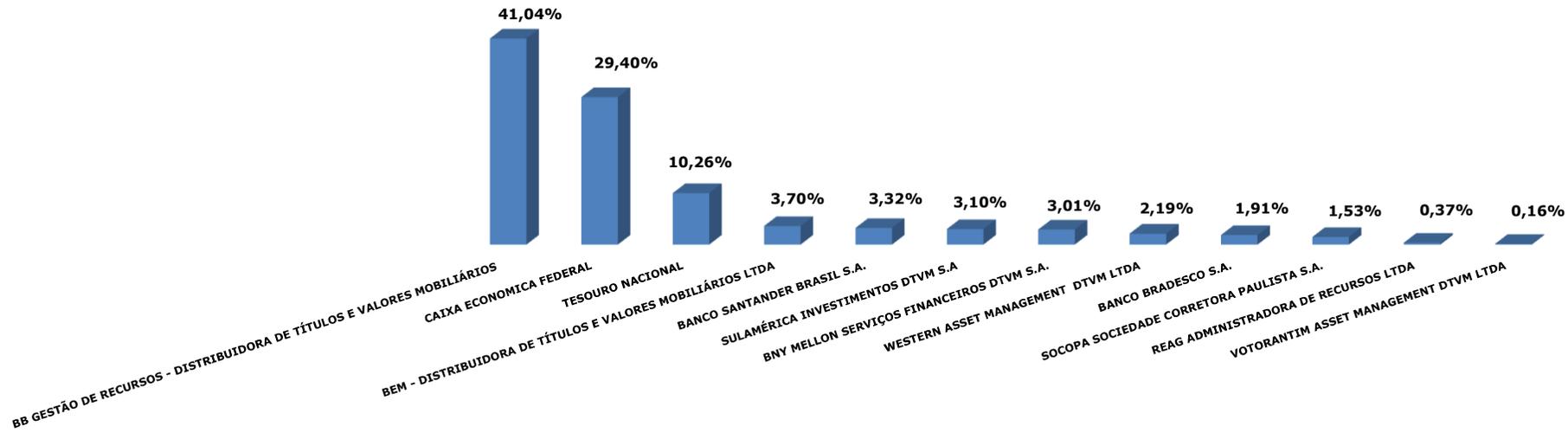
| Nome do Fundo | Gestor | Administrador | % PL RECIPIREV | % PL Fundo | Valor (R\$) | CNPJ | Rentabilidade do Produto (mensal) | Rentabilidade do Produto (anual) | Prazo de Liquidação | Artigo da Resolução 3.922/10 | Classificação Risco do Fundo |
|--|---|--|----------------|------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|---|------------------------------|
| TERRAS BRASIL – FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA | BRZ INVESTIMENTOS LTDA | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | 0,13% | 9,94% | R\$ 2.239.264,51 | 19.412.474/0001-79 | 104,77% | 104,77% | Médio Prazo | FI em Participações | Risco Muito Alto |
| QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA | BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA | 0,42% | 8,87% | R\$ 7.428.492,81 | 09.289.072/0001-75 | 7,66% | 7,66% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Alto |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES | SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA | BANCO SANTANDER BRASIL S.A. | 1,27% | 3,34% | R\$ 22.223.153,80 | 02.436.763/0001-05 | 7,49% | 7,49% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Muito Alto |
| SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A | 1,10% | 3,83% | R\$ 19.168.089,88 | 13.823.084/0001-05 | 0,60% | 0,60% | Curto Prazo | FI Multimercado - Aberto | Risco Médio |
| SUL AMÉRICA EVOLUTION FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A | 0,63% | 3,61% | R\$ 11.037.308,49 | 12.839.769/0001-87 | 0,69% | 0,34% | Curto Prazo | FI Multimercado - Aberto | Risco Alto |
| SUL AMÉRICA HIGH YIELD FIM CRÉDITO PRIVADO | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A | 0,00% | 0,00% | -R\$ 0,00 | 19.225.709/0001-13 | 1,07% | 1,07% | Médio Prazo | FI Multimercado - Aberto | Risco Alto |
| SUL AMERICA TOTAL RETURN FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A | 0,47% | 7,95% | R\$ 8.264.464,04 | 11.458.144/0001-02 | 11,14% | 11,14% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Muito Alto |
| VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA | BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA | 0,61% | 2,30% | R\$ 10.664.409,21 | 07.488.106/0001-25 | 7,48% | 7,48% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Muito Alto |
| VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO | VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | 0,16% | 1,66% | R\$ 2.814.160,93 | 14.491.564/0001-89 | 1,22% | 1,24% | Médio Prazo | FI Multimercado - Aberto | Risco Médio |
| WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA AÇÕES FUNDO DE INVESTIMENTO | WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | 0,00% | 0,00% | R\$ 0,00 | 16.703.203/0001-84 | 11,06% | 37,79% | Curto Prazo | FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações | Risco Muito Alto |
| WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA | 0,31% | 4,00% | R\$ 5.492.750,33 | 09.087.523/0001-91 | 10,39% | 7,70% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Muito Alto |
| XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES | XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA | BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | 0,91% | 4,10% | R\$ 15.934.738,96 | 16.575.255/0001-12 | 5,48% | 5,48% | Curto Prazo | FI de Ações - Geral | Risco Alto |
| XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA | BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | 0,48% | 2,91% | R\$ 8.421.829,90 | 11.616.403/0001-86 | 2,59% | 2,59% | Curto Prazo | FI Multimercado - Aberto | Risco Muito Alto |
| Renda Variável | | | 14,60% | | R\$ 255.435.034,32 | | | 6,15% | | | |
| Saldo Conta Corrente | | | 0,02% | | R\$ 426.622,02 | | | | | | |
| Total Geral | | | 100,00% | | R\$ 1.749.628.699,42 | | Rentabilidade Reciprev | 2,62% | | | |

Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2018

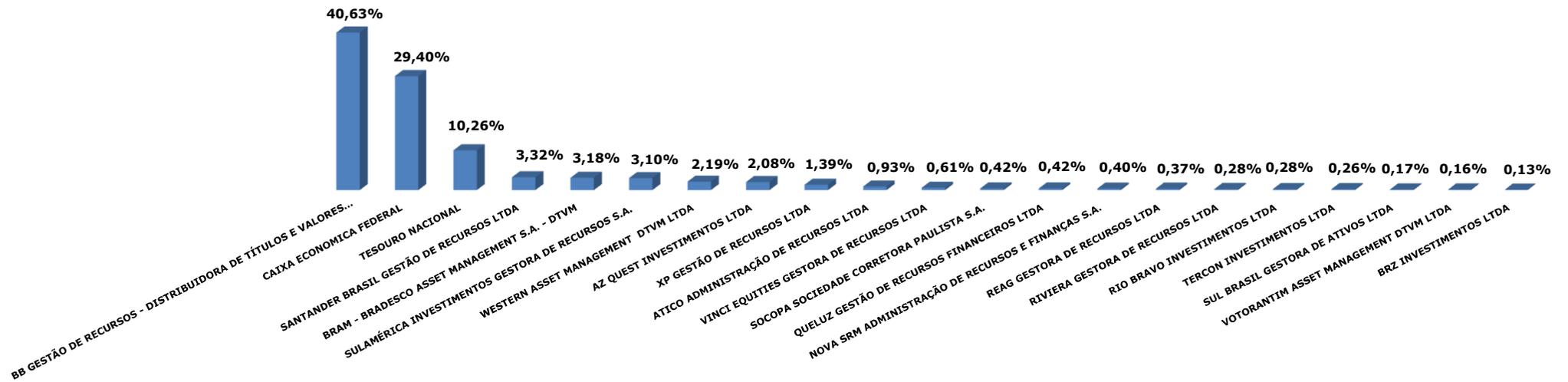


31/12/2017 31/01/2018 28/02/2018 31/03/2018 30/04/2018 31/05/2018 30/06/2018 31/07/2018 31/08/2018 30/09/2018 31/10/2018 28/11/2018 31/12/2018

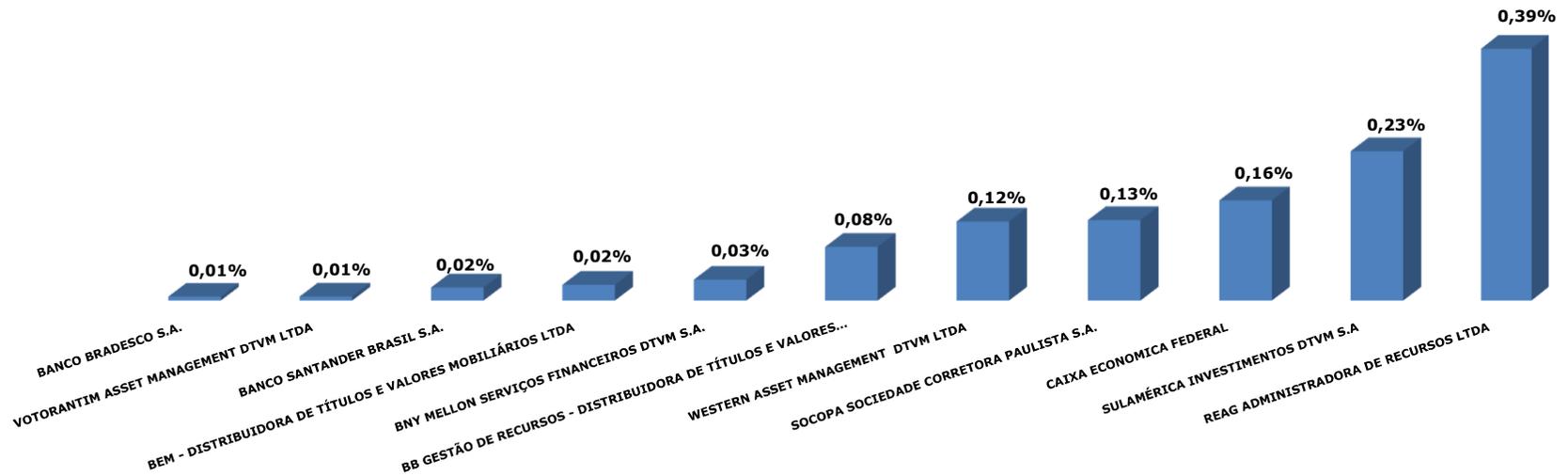
Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV - 2018



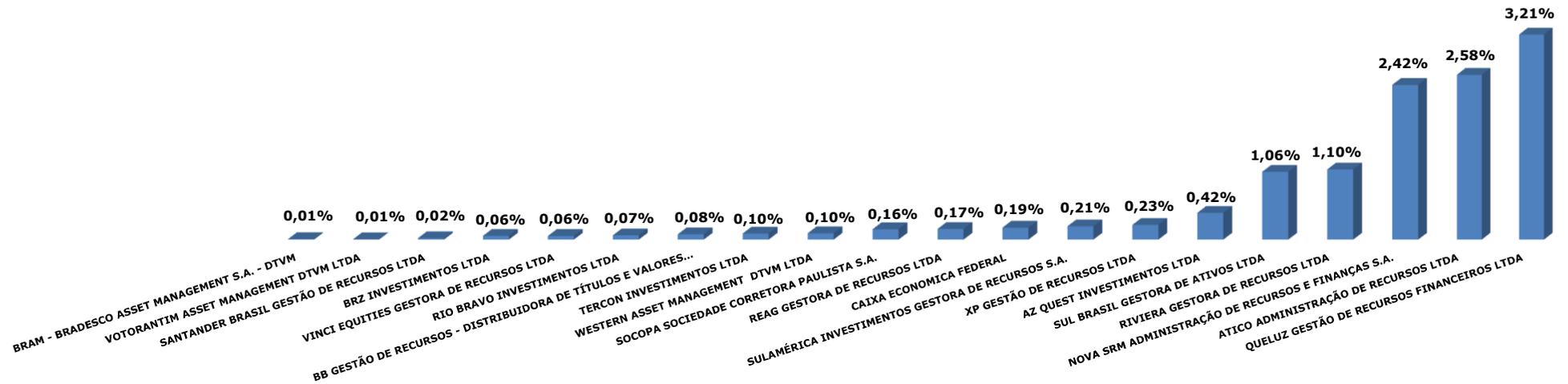
Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV - 2018



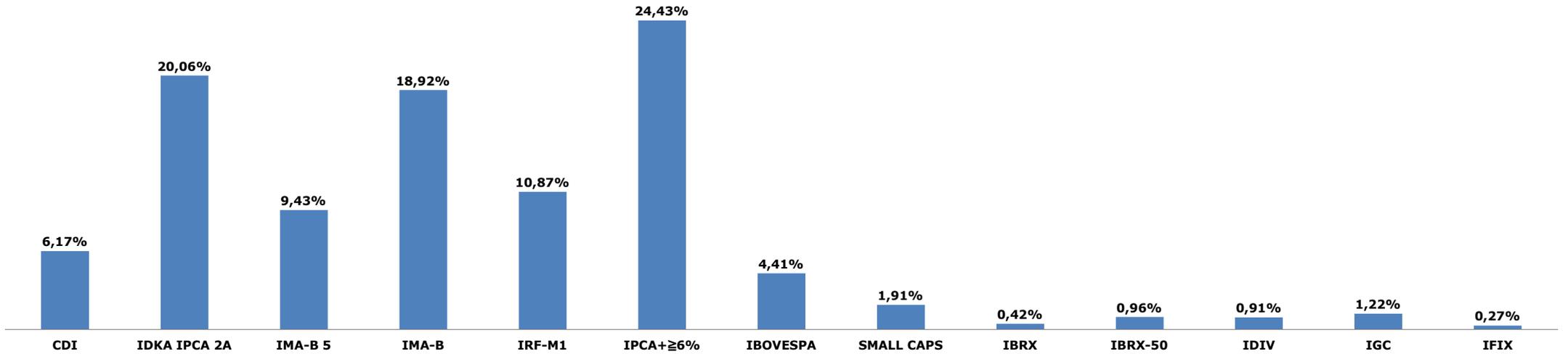
Percentual de participação dos investimentos da Reciprev em relação ao Volume sob Administração Anbima



Percentual de participação dos investimentos da Reciprev em relação ao Volume sob Gestão Anbima

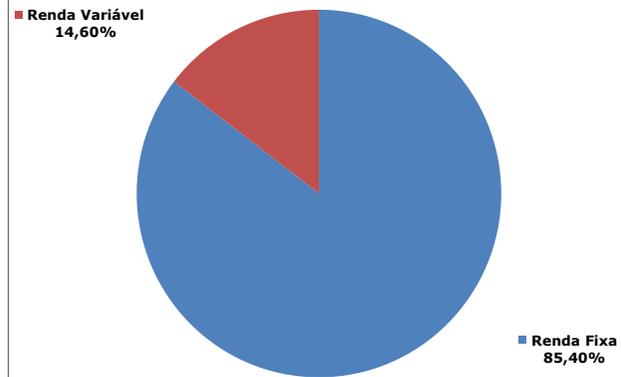


Percentual de Composição da Carteira RECIPREV por Benchmark - 2018

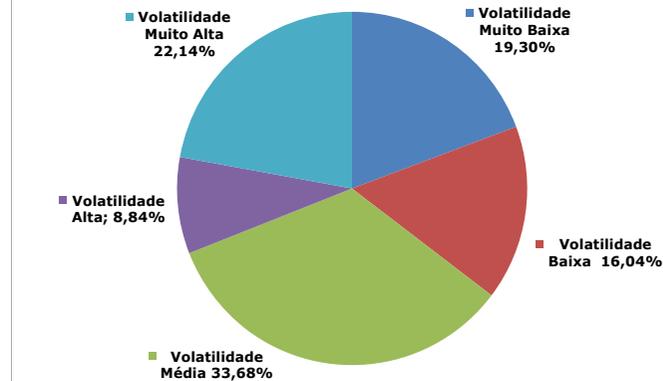


Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2018

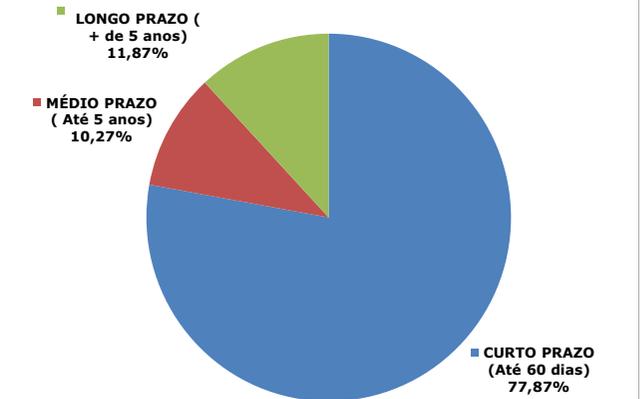
RENDA FIXA X RENDA VARIÁVEL



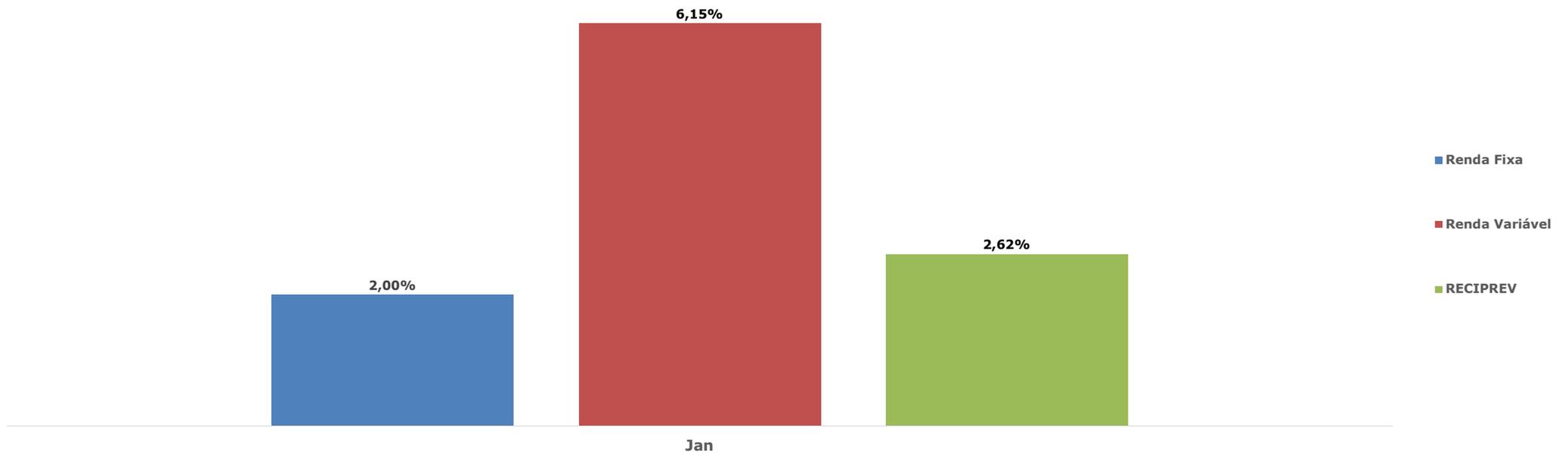
VOLATILIDADE DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS E TÍTULOS



PRAZOS GERAIS DE LIQUIDAÇÃO



Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2018

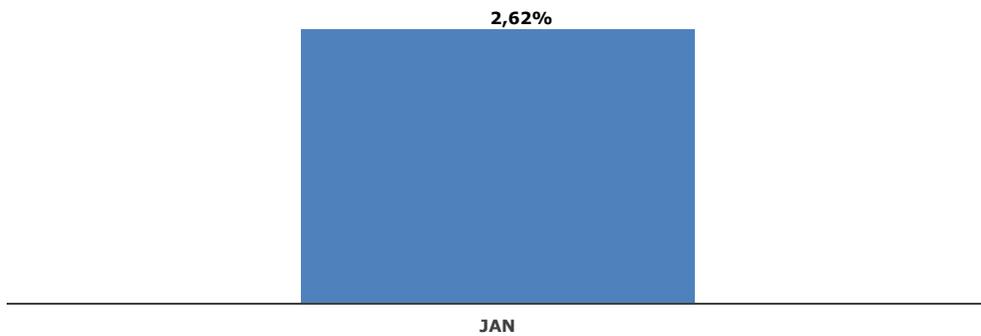


Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2018

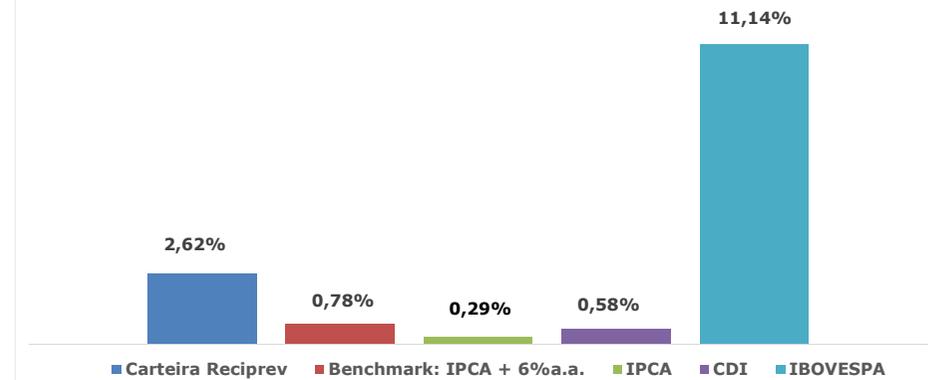


Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2018

Rentabilidade Anual Acumulada no Período



Acumulado Janeiro a Dezembro 2018 - Rentabilidade Carteira X Índices



Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores
Relatórios da Carteira de Investimentos RECIFIN

| | |
|-------------------------|-------------------|
| Data da Posição: | 31/01/2018 |
|-------------------------|-------------------|

| 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 GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | R\$ 10.689,89 | R\$ 0,01 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. - DTVM | BANCO BRADESCO S.A. | R\$ 0,00 | R\$ 231.602,34 |
| Saldo Conta Corrente | | | | R\$ 1,00 |
| Total Carteira RECIFIN | | | R\$ 10.689,89 | R\$ 231.603,35 |

RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

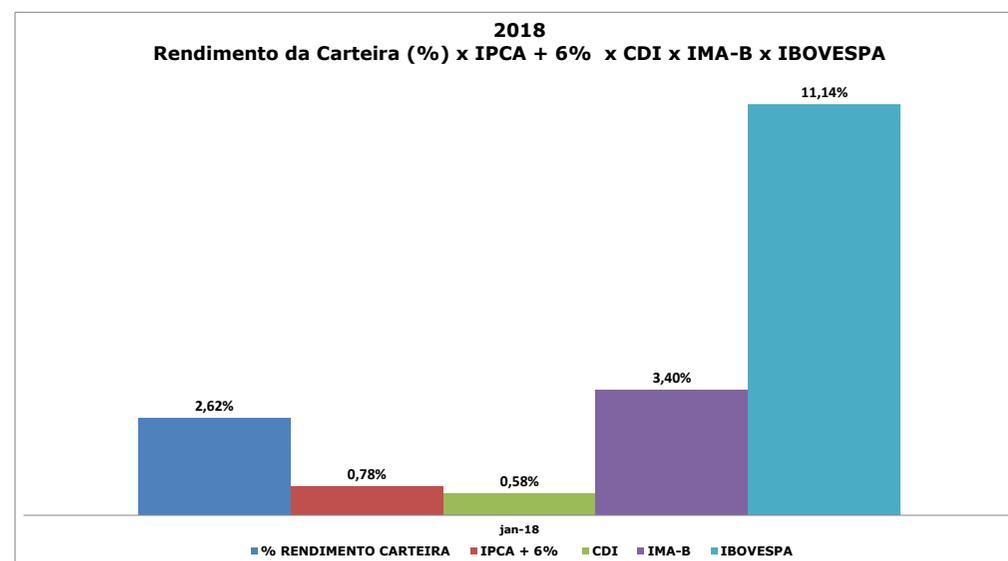
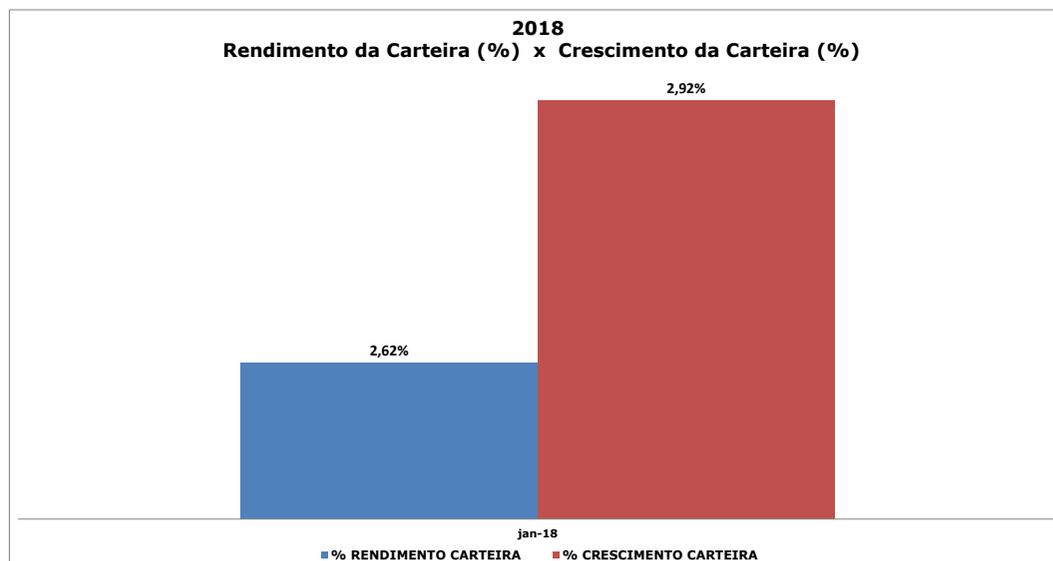
ANO 2018

| FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV | | | | |
|-------------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|--|
| DATA | SALDO R\$ | RENDIMENTO R\$ | % RENDIMENTO CARTEIRA | |
| 31/01/2018 | R\$ 1.749.628.699,47 | R\$ 44.619.049,75 | 2,62% | |
| 28/02/2018 | | | | |
| 31/03/2018 | | | | |
| 30/04/2018 | | | | |
| 31/05/2018 | | | | |
| 30/06/2018 | | | | |
| 31/07/2018 | | | | |
| 31/08/2018 | | | | |
| 30/09/2018 | | | | |
| 31/10/2018 | | | | |
| 30/11/2018 | | | | |
| 31/12/2018 | | | | |
| TOTAL | | R\$ 44.619.049,75 | 2,62% | |

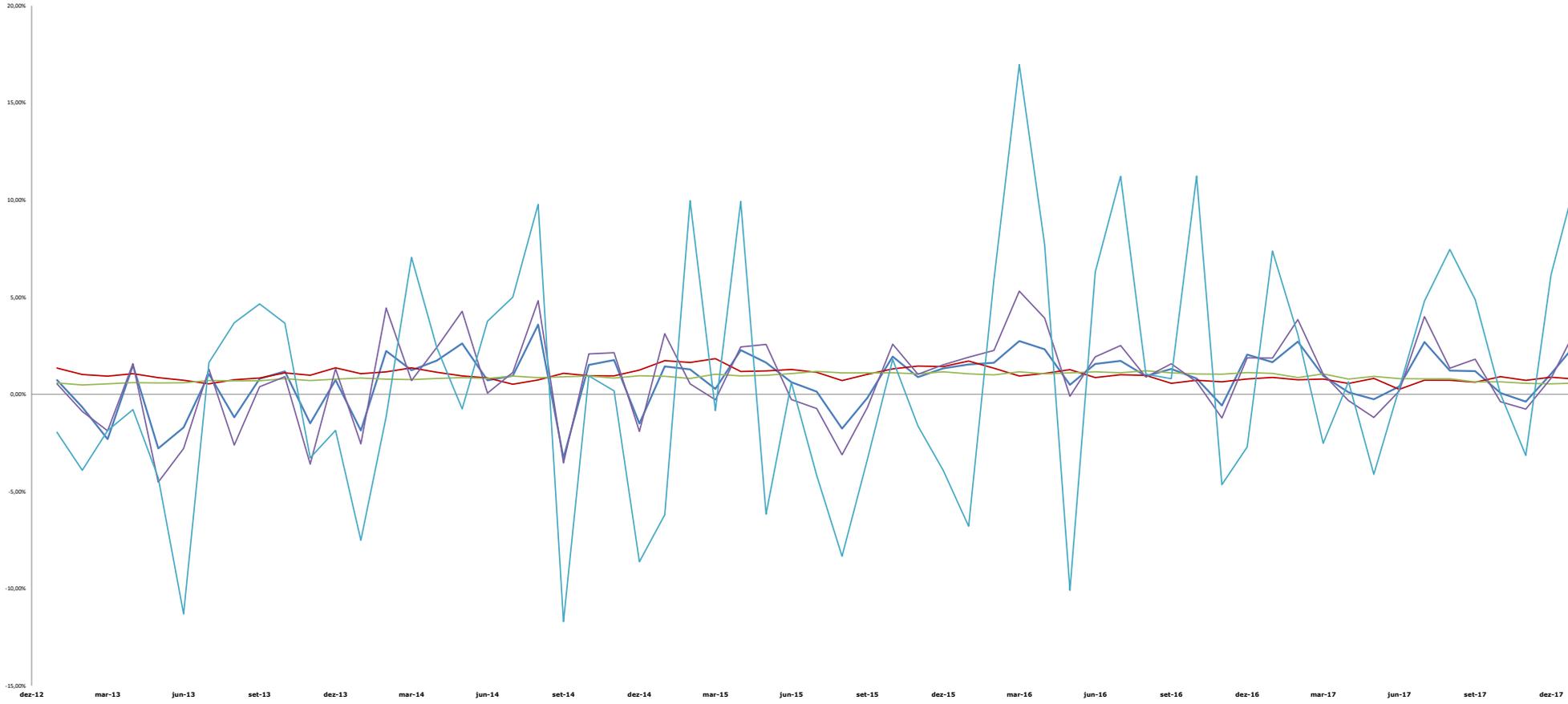
| FUNDO FINANCEIRO RECIFIN | | | |
|--------------------------|----------------|-----------|--|
| SALDO R\$ | RENDIMENTO R\$ | | |
| R\$ 231.603,35 | R\$ | 10.689,89 | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| TOTAL | R\$ | 10.689,89 | |

| TOTAL FUNDOS: RECIPREV E RECIFIN | | | |
|----------------------------------|----------------|---------------|--|
| SALDO R\$ | RENDIMENTO R\$ | | |
| R\$ 1.749.860.302,82 | R\$ | 44.629.739,64 | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| TOTAL | R\$ | 44.629.739,64 | |

GRÁFICO COMPARATIVO DA CARTEIRA RECIPREV



2013 - 2018
Rendimento da Carteira(%) x IPCA + 6% x CDI x IMA-B x IBOVESPA



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

FLUXO MENSAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

ANO 2018

| MÊS | JANEIRO | | | | |
|--|----------------|--|--------------|-------------------|------------------------|
| RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES E COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS | | COMPETÊNCIA | VALOR | | ACUMULADO ANUAL |
| PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL) | | Contribuição de 11 de 2017 e Parcelamento 25/60. Recebimento a maior de R\$ 179,35 | R\$ | 7.461.606,66 R\$ | 7.461.606,66 |
| PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL INATIVOS) | | Contribuição de 11 de 2017 | R\$ | 1.485.960,95 R\$ | 1.485.960,95 |
| PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR) | | Contribuição de 11 de 2017 | R\$ | 6.050.060,00 R\$ | 6.050.060,00 |
| COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA | | 01/2018 | R\$ | 114.994,89 R\$ | 114.994,89 |
| CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL) | | Contribuição de 12 de 2017 | R\$ | - R\$ | - |
| CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR) | | Contribuição de 12 de 2017 | R\$ | - R\$ | - |
| TOTAL | | | R\$ | 15.112.622,50 R\$ | 15.112.622,50 |
| RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS | | | VALOR | | ACUMULADO ANUAL |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS) | | | R\$ | 32.500,00 R\$ | 32.500,00 |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS) | | | R\$ | 32.800,00 R\$ | 32.800,00 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - R\$ | 68.761,43 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - R\$ | - |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - R\$ | - |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - R\$ | - |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - R\$ | - |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - R\$ | - |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - (CUPOM/JUROS) | | | R\$ | - R\$ | - |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO) | | | R\$ | - R\$ | - |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO) | | | R\$ | - R\$ | - |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO) | | | R\$ | - R\$ | - |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO) | | | R\$ | - R\$ | - |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO) | | | R\$ | 134.061,43 R\$ | - |
| TOTAL | | | R\$ | 134.061,43 R\$ | 134.061,43 |
| FOLHA DE PAGAMENTO E CONSIGNAÇÕES | | | VALOR | | ACUMULADO ANUAL |
| FOLHA DE PAGAMENTO | | | -R\$ | 7.777.210,52 -R\$ | 7.777.210,52 |
| CONSIGNAÇÕES | | | -R\$ | 2.160.300,17 -R\$ | 2.160.300,17 |
| DEVOLUÇÕES DE FOLHA NÃO PROCESSADAS E DE CONSIGNAÇÕES | | | R\$ | 141,36 R\$ | 141,36 |
| TOTAL | | | -R\$ | 9.937.369,33 -R\$ | 9.937.369,33 |
| PAGAMENTOS DIVERSOS | | | VALOR | | ACUMULADO ANUAL |
| TARIFA DE CUSTÓDIA DO FUNDO FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS | | | -R\$ | 14,25 -R\$ | 14,25 |
| 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\$ | 375,31 -R\$ | 375,31 |
| TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPREV | | | -R\$ | 226.000,00 -R\$ | 226.000,00 |
| TOTAL | | | -R\$ | 226.389,56 -R\$ | 226.389,56 |
| RESUMO GERAL | | | VALOR | | ACUMULADO ANUAL |
| TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES E COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS | | | R\$ | 15.112.622,50 R\$ | 15.112.622,50 |
| TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS | | | R\$ | 134.061,43 R\$ | 134.061,43 |
| TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS E CONSIGNAÇÕES | | | -R\$ | 9.937.369,33 -R\$ | 9.937.369,33 |
| TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS | | | -R\$ | 226.389,56 -R\$ | 226.389,56 |
| TOTAL | | | R\$ | 5.082.925,04 R\$ | 5.082.925,04 |

ESTATÍSTICA DA CARTERIA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

| FUNDO | Benchmark | Retorno Médio Mensal | Retorno Médio Anual | Maior Retorno | Menor Retorno | Qtde. mês Positivo | Qtde. mês Negativo | Qtde. mês acima do Benchmark | Qtde. mês abaixo do Benchmark | Risco Mensal Período | Risco Anual do Período | Retorno Relativo ao Benchmark | Sharpe | Tracking Error | VAR (95%) |
|--|------------------|----------------------|---------------------|---------------|---------------|--------------------|--------------------|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------------------|-------------------------------|--------|----------------|-----------|
| ÁTICO FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA | IPCA+9,00% | -0,03% | -0,37% | 9,25% | -3,38% | 5 | 64 | 1 | 68 | 1,20% | 4,17% | -57,68% | -2,66 | 4,27% | 1,95% |
| ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA | IPCA+ 10,50% | 0,43% | 5,29% | 39,38% | -20,82% | 6 | 79 | 3 | 82 | 5,82% | 20,17% | -53,38% | -0,27 | 20,11% | 10,15% |
| AZ LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | IBOVESPA | 0,44% | 5,41% | 11,71% | -11,45% | 42 | 31 | 32 | 41 | 4,98% | 17,23% | -7,92% | -0,31 | 9,12% | 8,75% |
| AZ QUEST VALORE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - CRÉDITO PRIVADO | CDI | 0,98% | 12,36% | 1,43% | 0,53% | 45 | 0 | 32 | 13 | 0,20% | 0,68% | 1,02% | 0,45 | 0,30% | 1,30% |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES | Índice Small Cap | 1,21% | 15,46% | 10,64% | -10,30% | 56 | 29 | 57 | 28 | 4,54% | 15,73% | 129,90% | 0,30 | 9,61% | 8,78% |
| BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO | IGC | 0,50% | 6,14% | 11,85% | -9,83% | 46 | 39 | 18 | 67 | 4,77% | 16,54% | -8,49% | -0,28 | 0,79% | 8,46% |
| BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | IBOVESPA | 0,83% | 10,41% | 11,10% | -8,60% | 31 | 22 | 24 | 29 | 5,28% | 18,28% | -8,78% | -0,07 | 6,68% | 9,65% |
| BB AÇÕES PIPE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | Índice Small Cap | 0,99% | 12,52% | 8,48% | -8,58% | 35 | 21 | 33 | 23 | 4,04% | 14,01% | 45,88% | 0,07 | 10,41% | 7,72% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CDI | 0,79% | 9,92% | 1,17% | 0,43% | 81 | 0 | 1 | 80 | 0,20% | 0,68% | -5,24% | -1,30 | 0,07% | 1,11% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | IDKA IPCA 2A | 0,99% | 12,58% | 3,50% | -0,91% | 73 | 8 | 31 | 50 | 0,79% | 2,72% | -4,07% | 0,65 | 0,57% | 2,29% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | IMA-B | 1,00% | 12,68% | 5,33% | -4,50% | 62 | 23 | 17 | 68 | 2,02% | 7,01% | -2,25% | 0,27 | 0,22% | 4,35% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO | IMA-B | 1,05% | 13,32% | 2,53% | -0,52% | 34 | 1 | 15 | 20 | 0,67% | 2,31% | -5,81% | 0,44 | 4,82% | 2,14% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO | IDKA IPCA 2A | 1,01% | 12,79% | 2,21% | 0,21% | 33 | 0 | 12 | 21 | 0,46% | 1,58% | -5,01% | 0,32 | 1,96% | 1,76% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO | IPCA + 6,00% | 1,04% | 13,18% | 2,05% | 0,45% | 48 | 0 | 26 | 22 | 0,34% | 1,18% | 1,60% | 1,07 | 0,65% | 1,60% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | IPCA + 6,00% | 1,21% | 15,52% | 5,14% | -2,54% | 38 | 11 | 28 | 21 | 1,60% | 5,53% | 10,44% | 0,66 | 5,56% | 3,85% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO | IMA-B | 1,16% | 14,83% | 3,69% | -2,41% | 39 | 8 | 23 | 24 | 1,42% | 4,93% | -3,66% | 0,58 | 2,69% | 3,51% |
| BRADERCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B | IMA-B | 1,03% | 13,02% | 5,14% | -4,37% | 62 | 23 | 46 | 39 | 2,04% | 7,06% | -0,11% | 0,31 | 0,32% | 4,40% |
| BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS | IBOVESPA | 0,86% | 10,76% | 12,66% | -12,05% | 46 | 39 | 50 | 35 | 4,80% | 16,64% | 68,37% | 0,00 | 9,51% | 8,87% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | CDI | 0,60% | 7,44% | 0,93% | 0,28% | 71 | 0 | 0 | 71 | 0,20% | 0,68% | -16,17% | -4,76 | 0,06% | 0,92% |
| TERRAS BRASIL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA | IPCA+6,00% | -0,81% | -9,28% | 104,77% | -62,23% | 2 | 42 | 1 | 43 | 18,57% | 64,33% | -54,64% | -0,33 | 64,43% | 31,28% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | IPCA + 6% | 0,84% | 10,53% | 2,11% | -2,09% | 45 | 3 | 23 | 25 | 0,79% | 2,75% | -7,60% | -0,51 | 2,39% | 2,14% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | IMA-B | 1,09% | 13,94% | 5,89% | -2,76% | 36 | 13 | 22 | 27 | 1,85% | 6,41% | -6,15% | 0,32 | 3,19% | 4,16% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | IMA-B | 1,01% | 12,80% | 4,05% | -2,76% | 26 | 9 | 15 | 20 | 1,58% | 5,48% | -7,07% | 0,09 | 3,68% | 3,62% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | IMA-B | 1,15% | 14,71% | 7,83% | -4,91% | 31 | 16 | 23 | 24 | 2,65% | 9,18% | -4,04% | 0,30 | 3,33% | 5,54% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | IMA-B | 1,09% | 13,90% | 7,77% | -4,02% | 23 | 12 | 17 | 18 | 2,39% | 8,28% | -4,38% | 0,19 | 7,50% | 5,05% |

| FUNDO | Benchmark | Retorno Médio Mensal | Retorno Médio Anual | Maior Retorno | Menor Retorno | Qtde. mês Positivo | Qtde. mês Negativo | Qtde. mês acima do Benchmark | Qtde. mês abaixo do Benchmark | Risco Mensal Período | Risco Anual do Período | Retorno Relativo ao Benchmark | Sharpe | Tracking Error | VAR (95%) |
|---|--------------------|----------------------|---------------------|---------------|---------------|--------------------|--------------------|------------------------------|-------------------------------|----------------------|------------------------|-------------------------------|-------------|----------------|--------------|
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO | Índice Small Cap | 0,43% | 5,29% | 13,33% | -13,84% | 34 | 28 | 34 | 28 | 4,94% | 17,13% | 9,11% | -0,34 | 5,79% | 8,68% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50 | IBRX-50 | 0,21% | 2,49% | 11,94% | -13,12% | 44 | 41 | 34 | 51 | 5,30% | 18,38% | -19,58% | -0,45 | 3,22% | 9,07% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII | IFIX | 1,13% | 14,38% | 27,60% | -16,19% | 33 | 16 | 25 | 24 | 6,91% | 23,94% | 4,10% | 0,10 | 22,16% | 12,72% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | IMA-B 5 | 0,99% | 12,60% | 3,61% | -1,05% | 77 | 8 | 14 | 71 | 0,80% | 2,77% | -1,89% | 0,65 | 0,17% | 2,31% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | IRFM-1 | 0,87% | 11,01% | 1,62% | 0,28% | 85 | 0 | 10 | 75 | 0,25% | 0,87% | -1,29% | 0,24 | 0,04% | 1,29% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO | IPCA + 11,40% | 1,28% | 16,44% | 2,27% | 0,05% | 45 | 0 | 20 | 25 | 0,37% | 1,28% | -0,95% | 3,43 | 0,98% | 1,88% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS SRM - SENIOR 3 | 120% do DI | 1,11% | 14,19% | 1,46% | 0,22% | 50 | 0 | 36 | 14 | 0,24% | 0,84% | -0,62% | 2,80 | 0,02% | 1,51% |
| QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | IBRX | 0,74% | 9,26% | 8,31% | -7,48% | 53 | 32 | 43 | 42 | 3,50% | 12,12% | 18,96% | -0,13 | 10,19% | 6,56% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA | IPCA+8,00% | 0,10% | 1,16% | 14,74% | -0,55% | 1 | 58 | 1 | 58 | 1,94% | 6,72% | -45,93% | -1,51 | 6,61% | 3,30% |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII | IPCA + 6,9506% | 0,96% | 12,16% | 4,31% | -1,67% | 35 | 6 | 21 | 20 | 1,10% | 3,81% | -2,05% | 0,00 | 3,93% | 2,78% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES) | 125% do DI | 1,17% | 14,98% | 1,53% | 0,44% | 48 | 0 | 35 | 13 | 0,24% | 0,84% | -0,37% | 3,65 | 0,27% | 1,57% |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) | IPCA+6,00% | 0,91% | 11,55% | 11,67% | -8,30% | 52 | 33 | 42 | 43 | 3,95% | 13,68% | -6,27% | 0,05 | 13,68% | 7,49% |
| RDF - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS | 150% do DI | 1,44% | 18,74% | 1,83% | 0,81% | 40 | 0 | 30 | 10 | 0,28% | 0,97% | -0,07% | 6,80 | 0,11% | 1,90% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL VALE II | 125% do DI | 0,85% | 10,71% | 1,04% | 0,70% | 7 | 0 | 7 | 0 | 0,14% | 0,48% | 0,25% | 5,35 | 0,02% | 1,08% |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF | IMA-B 5 | 0,96% | 12,12% | 2,96% | -1,20% | 69 | 7 | 11 | 65 | 0,79% | 2,74% | -1,15% | 0,52 | 0,10% | 2,26% |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVETIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES | IBOVESPA | 0,67% | 8,36% | 11,03% | -11,26% | 46 | 39 | 47 | 38 | 4,79% | 16,58% | 44,10% | -0,15 | 8,17% | 8,65% |
| SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO | IPCA+7,50% | 0,91% | 11,48% | 4,69% | -2,14% | 35 | 15 | 19 | 31 | 1,58% | 5,46% | -10,26% | -0,07 | 5,28% | 3,51% |
| SUL AMERICA TOTAL RETURN FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | IBRX-50 | 0,21% | 2,53% | 14,70% | -17,93% | 44 | 41 | 38 | 47 | 5,72% | 19,81% | -19,34% | -0,42 | 11,42% | 9,78% |
| SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | CDI | 0,91% | 11,44% | 1,42% | 0,28% | 70 | 0 | 54 | 16 | 0,26% | 0,90% | 4,00% | 0,83 | 0,53% | 1,33% |
| SUL AMÉRICA EVOLUTION FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | CDI | 0,93% | 11,72% | 4,42% | -2,70% | 70 | 13 | 53 | 30 | 1,13% | 3,91% | 5,82% | 0,23 | 3,80% | 2,79% |
| SUL AMÉRICA INFLATIE FI RF LONGO PRAZO | IMA-B | 1,03% | 13,13% | 5,64% | -4,08% | 64 | 21 | 47 | 38 | 2,05% | 7,10% | 0,56% | 0,33 | 1,24% | 4,42% |
| SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RF CRÉDITO PRIVADO | CDI | 0,88% | 11,08% | 1,30% | 0,50% | 85 | 0 | 72 | 13 | 0,21% | 0,71% | 1,79% | 0,39 | 0,28% | 1,22% |
| SUL INVEST FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL (SÊNIORES SÉRIES 6) | IPCA + 7,50% | 1,12% | 14,33% | 2,19% | 0,29% | 49 | 0 | 24 | 25 | 0,36% | 1,26% | 0,06% | 1,93 | 0,48% | 1,72% |
| VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | IBOVESPA | 0,80% | 10,06% | 8,50% | -7,39% | 53 | 32 | 49 | 36 | 3,48% | 12,06% | 60,93% | -0,06 | 13,54% | 6,59% |
| VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO | IPCA | 1,09% | 13,87% | 2,91% | -1,06% | 49 | 3 | 29 | 23 | 0,71% | 2,47% | 3,93% | 0,86 | 2,46% | 2,27% |
| WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA | CDI | 0,90% | 11,35% | 2,19% | -0,27% | 83 | 2 | 49 | 36 | 0,42% | 1,44% | 3,52% | 0,38 | 1,26% | 1,58% |
| WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | Sem benchmark | 0,35% | 4,26% | 15,06% | -11,03% | 42 | 43 | 42 | 43 | 5,23% | 18,13% | 9,70% | -0,36 | 8,87% | 9,09% |
| XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES | Sem benchmark | 1,18% | 15,18% | 12,51% | -9,31% | 42 | 21 | 34 | 29 | 4,55% | 15,77% | 52,57% | 0,27 | 15,46% | 8,77% |
| XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | CDI | 1,00% | 12,62% | 3,62% | -2,41% | 75 | 10 | 47 | 38 | 1,06% | 3,68% | 12,22% | 0,49 | 3,53% | 2,75% |
| CARTEIRA RECIPREV | IPCA+6% ano | 0,92% | 11,67% | 4,55% | -2,78% | 67 | 18 | 42 | 43 | 1,38% | 4,78% | -5,53% | 0,18 | 4,79% | 3,20% |

CONCEITOS

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

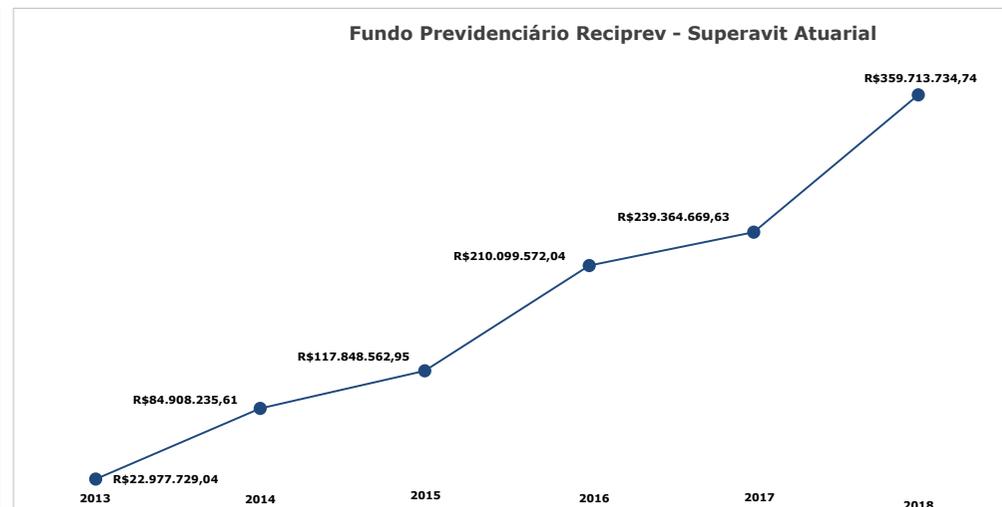
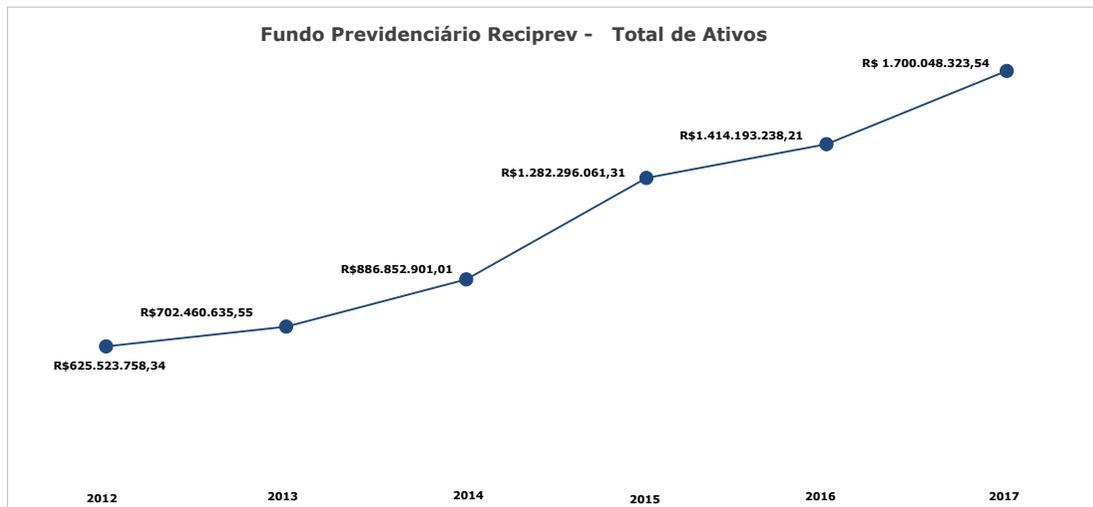
➤ **Retorno em relação ao Benchmark:** Trata-se do comparativo do retorno do ativo em todo o período avaliado em relação ao retorno esperado do ativo (Benchmark);

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

➤ **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;

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



EQUIPE DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

PANORAMA MACROECONÔMICO

O ano de 2018 começou bem para o mercado de ações. O Ibovespa disparou 11,14% no mês, refletindo os sinais de recuperação da economia doméstica. No mercado de juros houve aumento nos preços dos Títulos Públicos de médio e longo prazos, reflexo da expectativa de inflação controlada e manutenção da taxa de juros por mais tempo no patamar atual. O IPCA de janeiro ficou em 0,29%, abaixo da expectativa do mercado de 0,41%.

DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

| | | | | | | | |
|--|---------|--------------|-------|---|--------------|----------------|----------------------------|
| IPCA do mês de | JANEIRO | 0,29% | Sendo | Meta Atuarial para o Ano de 2018 | | | IPCA + 6,00% ao ano |
| Meta Atuarial para o mês de | JANEIRO | 0,78% | | Meta Atuarial acumulada no ano de 2018 | | | 0,78% |
| Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em | JANEIRO | 2,62% | | Renda Fixa | 2,00% | Renda Variável | 6,15% |
| Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2018 | | 2,62% | | Percentual de atingimento da meta atuarial acumulada no ano de 2018 | | | 337,28% |

A Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev possui a maior parte de seus recursos aplicados em fundos que têm como benchmark o CDI (Certificado de Depósito Interbancário), o IMA (Índice de Mercado da Anbima); IDKA (Índice de Duração Constante ANBIMA), e IRF-M1 (Índice de Renda Fixa do Mercado), compostos por títulos prefixados e pós-fixados, bem como atrelados a índice de preço. Possui, ainda, valores 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

Paulo José Batbosa

Equipe Investimentos

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

Concordamos com as informações do presente relatório.

Manoel Carneiro Soares Cardoso

Diretor Presidente

Francisco Canindé Antunes Furtado Junior

Diretor Executivo

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

Andreson Carlos Gomes de Oliveira

Chefe de Divisão de Investimentos

Paulo José Barbosa

Equipe Investimentos

Waldemir Almeida Moreira

Representante Titular da Secretaria de Finanças da Prefeitura do Recife

Roberto Wagner Martins Mateus

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

Originais assinados e arquivados na Reciprev

Recife (PE), 08 de fevereiro de 2018