

# 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

<b>Data da Posição:</b>	<b>29/06/2018</b>
-------------------------	-------------------

<b>Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores)</b>		
<b>Renda Fixa</b>		
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	607.106.439,20
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	491.941.061,57
TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	R\$	163.273.898,59
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$	121.360.239,56
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	104.498.457,27
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$	40.427.961,77
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	33.032.271,72
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$	6.527.162,97
NOVA SRM ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS E FINANÇAS S.A.	R\$	4.301.432,14
TERCON INVESTIMENTOS LTDA	R\$	3.531.507,50
<b>TOTAL RF</b>	<b>R\$</b>	<b>1.576.000.432,28</b>
<b>Renda Variável</b>		
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	23.237.232,68
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	23.121.221,36
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$	22.249.900,16
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	22.195.460,48
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$	21.183.201,09
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$	19.449.867,92
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	19.414.848,62
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	9.138.900,81
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	8.836.482,67
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$	8.311.851,04
ATICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	7.881.377,41
SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	R\$	7.537.515,10
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$	6.741.214,56
REAG GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	6.475.664,85
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$	4.775.967,55
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	2.896.308,88
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$	2.359.663,36
<b>TOTAL RV</b>	<b>R\$</b>	<b>215.806.678,53</b>
<b>SALDO CONTA CORRENTE</b>	<b>R\$</b>	<b>1,00</b>
<b>PATRIMÔNIO</b>	<b>R\$</b>	<b>1.791.807.111,81</b>

<b>Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores)</b>		
<b>Renda Fixa</b>		
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	607.106.439,20
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	491.941.061,57
TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	R\$	163.273.898,59
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$	121.360.239,56
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$	104.498.457,27
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A	R\$	40.427.961,77
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	33.032.271,72
SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	R\$	7.832.939,64
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	R\$	6.527.162,97
<b>TOTAL RF</b>	<b>R\$</b>	<b>1.576.000.432,28</b>
<b>Renda Variável</b>		
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$	50.813.879,05
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	R\$	46.196.465,53
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	29.331.091,38
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	23.121.221,36
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A	R\$	21.183.201,09
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$	19.414.848,62
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	8.836.482,67
SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	R\$	7.537.515,10
REAG ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA	R\$	6.475.664,85
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	2.896.308,88
<b>TOTAL RV</b>	<b>R\$</b>	<b>215.806.678,53</b>
<b>SALDO CONTA CORRENTE</b>	<b>R\$</b>	<b>1,00</b>
<b>PATRIMÔNIO</b>	<b>R\$</b>	<b>1.791.807.111,81</b>

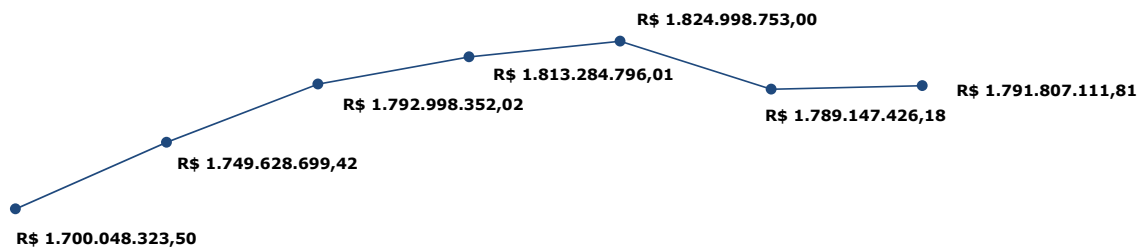
Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
AZ QUEST VALORE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - CRÉDITO PRIVADO	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,36%	3,37%	R\$ 6.527.162,97	19.782.311/0001-88	0,53%	3,33%	Curto Prazo	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	Risco Baixo
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)	0,05%	0,07%	R\$ 963.607,45	13.077.415/0001-05	0,43%	2,80%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	19,65%	5,76%	R\$ 352.016.448,16	13.322.205/0001-35	0,29%	3,15%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Muito Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	4,93%	2,36%	R\$ 88.278.873,00	07.442.078/0001-05	-0,35%	1,17%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	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)	1,17%	7,22%	R\$ 20.959.635,29	15.486.093/0001-83	0,27%	1,79%	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)	4,55%	7,55%	R\$ 81.616.056,00	19.303.795/0001-35	1,39%	5,37%	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)	1,46%	10,61%	R\$ 26.179.452,16	19.523.306/0001-50	0,15%	2,08%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,75%	3,72%	R\$ 13.443.613,10	20.734.937/0001-06	1,12%	4,24%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	1,32%	2,08%	R\$ 23.648.754,04	19.523.305/0001-06	0,58%	3,57%	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)	2,90%	4,12%	R\$ 51.988.112,24	08.702.798/0001-25	-0,43%	1,06%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Baixo
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RF IMA-B 5	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	1,56%	5,22%	R\$ 27.973.399,82	20.216.216/0001-04	0,38%	-0,10%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Baixo
BRADESCO FI RF IRF - M 1 TP	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	2,30%	4,04%	R\$ 41.228.655,04	11.484.558/0001-06	0,50%	2,13%	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)	0,01%	0,05%	R\$ 170.072,46	13.397.466/0001-14	0,30%	1,00%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Muito Baixo

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	5,66%	7,48%	R\$ 101.340.075,00	18.598.256/0001-08	1,38%	5,28%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,19%	5,61%	R\$ 21.357.840,00	18.598.288/0001-03	-0,01%	1,98%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,43%	2,52%	R\$ 25.684.400,00	20.139.595/0001-78	-0,01%	1,99%	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	0,32%	10,87%	R\$ 5.697.468,00	19.769.046/0001-06	-0,97%	0,08%	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	0,50%	3,17%	R\$ 8.936.949,00	20.139.534/0001-00	-0,97%	0,09%	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	7,30%	1,71%	R\$ 130.806.403,65	11.060.913/0001-10	0,42%	2,68%	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	10,91%	1,15%	R\$ 195.546.017,88	10.740.670/0001-06	0,50%	2,95%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,14%	1,25%	R\$ 2.571.908,04	19.542.287/0001-00	1,25%	7,26%	Médio Prazo	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	0,01%	14,22%	R\$ 174.714,20	13.633.964/0001-19	53,59%	-94,45%	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.	0,19%	10,44%	R\$ 3.356.793,29	19.425.700/0001-56	0,78%	4,80%	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.	0,24%	3,78%	R\$ 4.301.432,14	09.260.031/0001-56	0,62%	3,82%	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.	5,83%	9,19%	R\$ 104.498.457,27	13.455.117/0001-01	0,44%	2,85%	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	0,41%	1,01%	R\$ 7.287.561,13	04.899.128/0001-90	0,49%	2,72%	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	1,85%	8,49%	R\$ 33.140.400,63	09.326.708/0001-01	0,29%	-1,20%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	9,11%	0,00%	R\$ 163.273.898,59		-1,34%	-1,10%	Curto Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Médio

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	0,86%	0,84%	R\$ 15.411.881,24	03.499.367/0001-90	0,01%	2,79%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Médio
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	0,98%	6,58%	R\$ 17.620.390,48	17.517.577/0001-78	-0,32%	-2,06%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
<b>Renda Fixa</b>			<b>87,96%</b>		<b>R\$ 1.576.000.432,28</b>			<b>0,23%</b>			
AZ LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,61%	9,23%	R\$ 10.866.482,24	14.550.994/0001-24	-4,37%	-0,53%	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.	0,64%	1,90%	R\$ 11.383.417,92	11.392.165/0001-72	-2,60%	3,61%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
BB AÇÕES PIPE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,00%	0,00%	-R\$ 0,00	17.116.227/0001-08	-4,14%	-18,64%	Médio Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,22%	5,21%	R\$ 3.876.945,90	18.270.783/0001-99	-4,84%	-3,11%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	1,02%	7,62%	R\$ 18.318.514,58	10.418.335/0001-88	-4,40%	-7,37%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	Risco Muito Alto
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	1,09%	1,38%	R\$ 19.449.867,92	06.916.384/0001-73	-5,36%	-2,56%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,71%	5,39%	R\$ 12.732.984,32	15.154.220/0001-47	-4,39%	-9,81%	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	0,40%	4,84%	R\$ 7.209.776,39	03.737.217/0001-77	-5,62%	-5,19%	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 DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,27%	4,83%	R\$ 4.775.967,55	20.716.161/0001-93	-0,38%	2,93%	Longo Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,18%	2,20%	R\$ 3.178.460,64	17.098.794/0001-70	-10,98%	-10,65%	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%	22,66%	R\$ 7.537.515,10	16.841.067/0001-99	1,02%	8,25%	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.	0,44%	4,56%	R\$ 7.881.377,41	12.312.767/0001-35	-0,13%	-0,76%	Médio 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.	0,46%	3,14%	R\$ 8.311.851,04	11.490.580/0001-69	-0,03%	-0,35%	Curto Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto

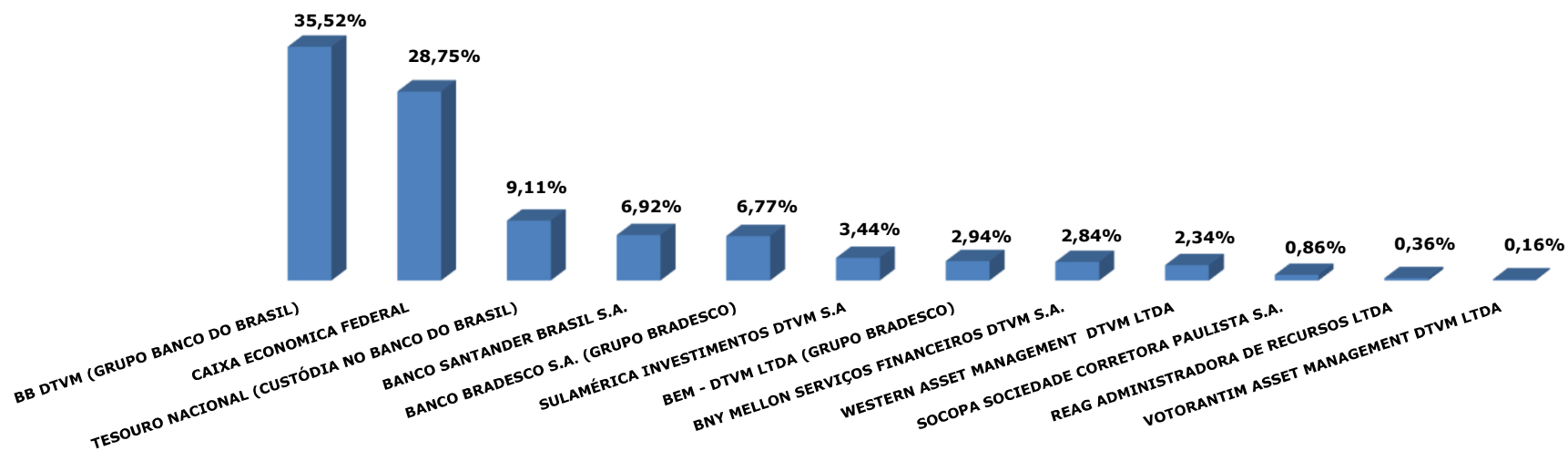
Nome do Fundo	Gestor	Administrador	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	REAG GESTORA DE RECURSOS LTDA	REAG ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA	0,36%	3,40%	R\$ 6.475.664,85	17.213.821/0001-09	-0,18%	-0,70%	Longo Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
TERRAS BRASIL – FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,13%	9,94%	R\$ 2.359.663,36	19.412.474/0001-79	6,36%	115,78%	Médio Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,38%	10,21%	R\$ 6.741.214,56	09.289.072/0001-75	-4,26%	-2,30%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVETIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	1,08%	3,14%	R\$ 19.414.848,62	02.436.763/0001-05	-5,01%	-6,09%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
SUL AMÉRICA EVOLUTION FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A	0,74%	2,51%	R\$ 13.331.623,94	12.839.769/0001-87	0,30%	3,00%	Curto Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Alto
SUL AMÉRICA EQUITIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS DTVM S.A	0,44%	4,92%	R\$ 7.851.577,15	11.458.144/0001-02	-2,70%	5,59%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,51%	3,47%	R\$ 9.138.900,81	07.488.106/0001-25	-3,85%	-7,89%	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%	1,71%	R\$ 2.896.308,88	14.491.564/0001-89	0,84%	4,20%	Médio Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Médio
WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	0,27%	3,51%	R\$ 4.831.991,77	09.087.523/0001-91	-4,07%	-5,26%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
WESTERN ASSET LONG & SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	0,22%	1,29%	R\$ 4.004.490,89	07.672.392/0001-84	0,69%	0,11%	Curto Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Médio
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	0,79%	5,05%	R\$ 14.140.911,37	16.575.255/0001-12	-3,16%	-6,39%	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.	0,51%	3,56%	R\$ 9.096.321,31	11.616.403/0001-86	1,25%	10,81%	Curto Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Muito Alto
<b>Renda Variável</b>			<b>12,04%</b>		<b>R\$ 215.806.678,53</b>			<b>-3,05%</b>			
<b>Saldo Conta Corrente</b>			<b>0,00%</b>		<b>R\$ 1,00</b>						
<b>Total Geral</b>			<b>100,00%</b>		<b>R\$ 1.791.807.111,81</b>		<b>Rentabilidade Reciprev</b>	<b>-0,19%</b>			

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

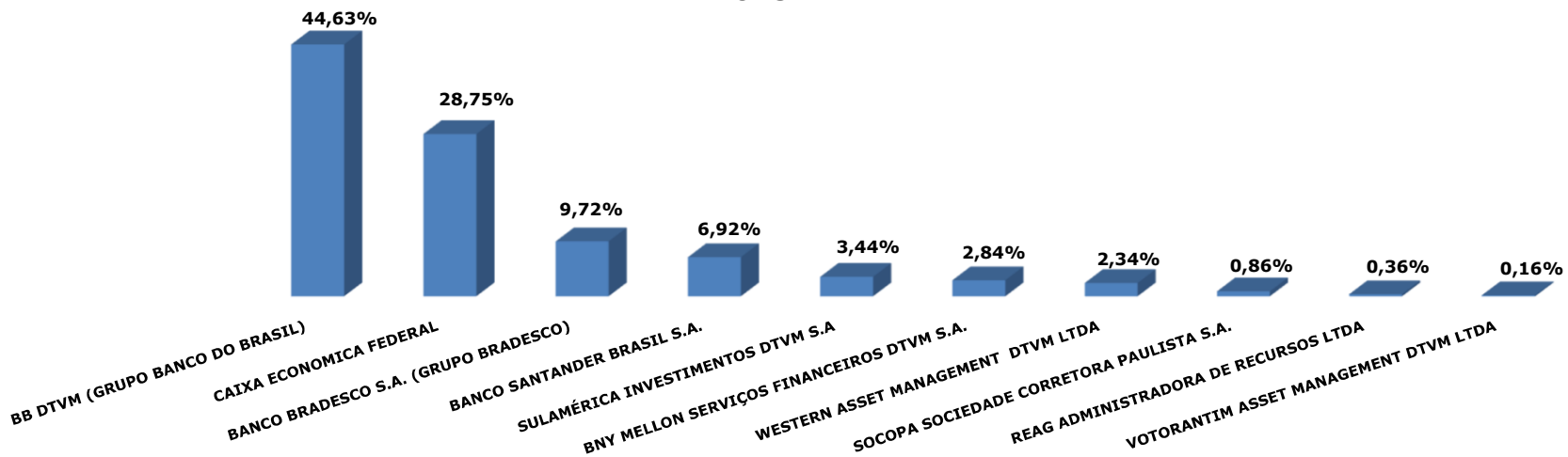


31/12/2017    31/01/2018    28/02/2018    31/03/2018    30/04/2018    31/05/2018    30/06/2018    31/07/2018    31/08/2018    30/09/2018    31/10/2018    28/11/2018    31/12/2018

### Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV - 2018

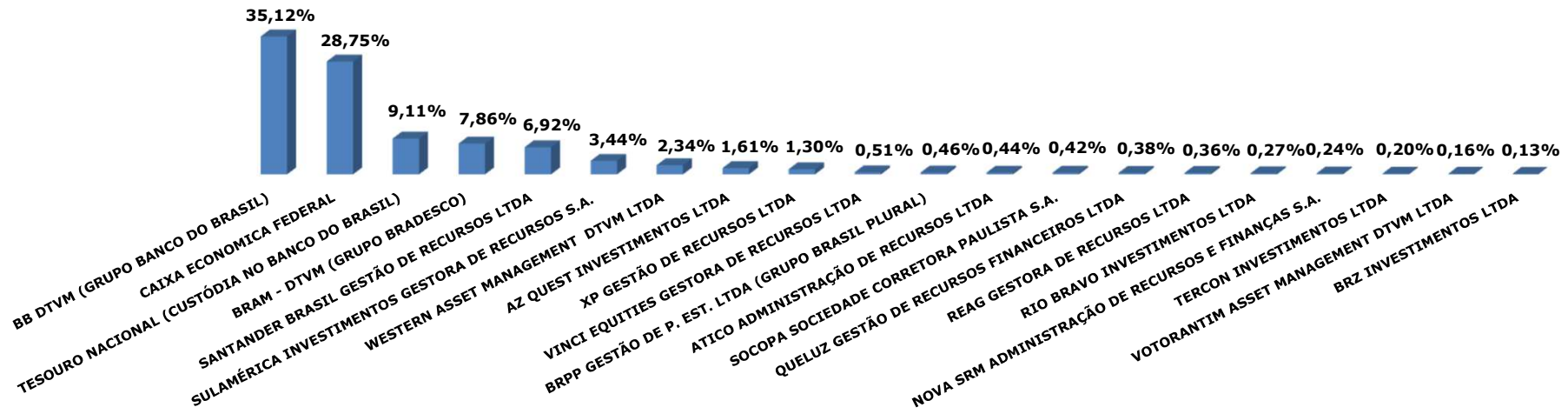


### Percentual de Participação das Instituições Administradoras Consolidado por Grupo Econômico - Carteira RECIPREV - 2018

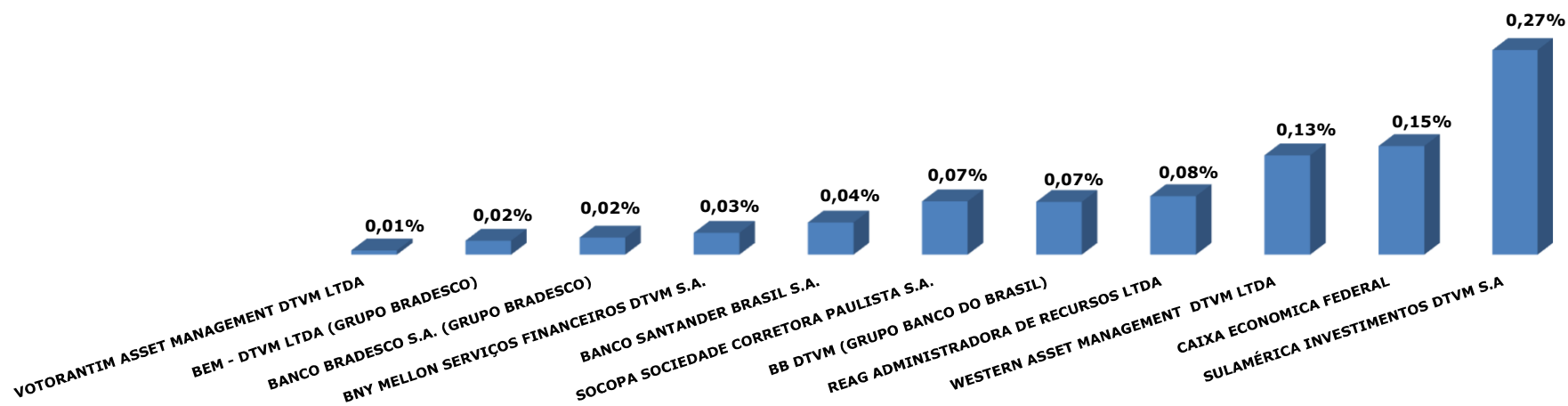




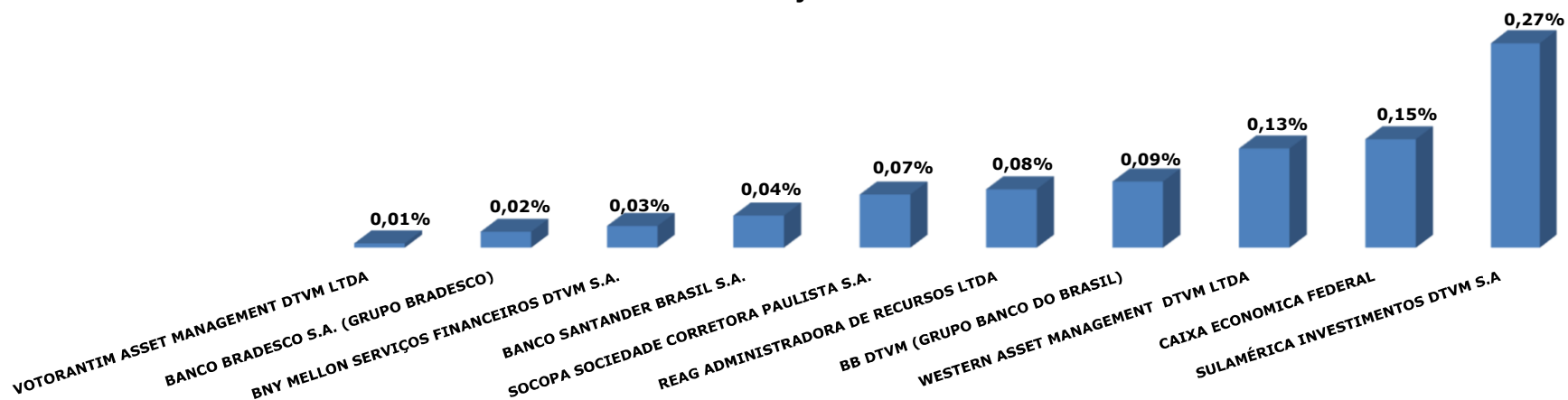
## Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV - 2018



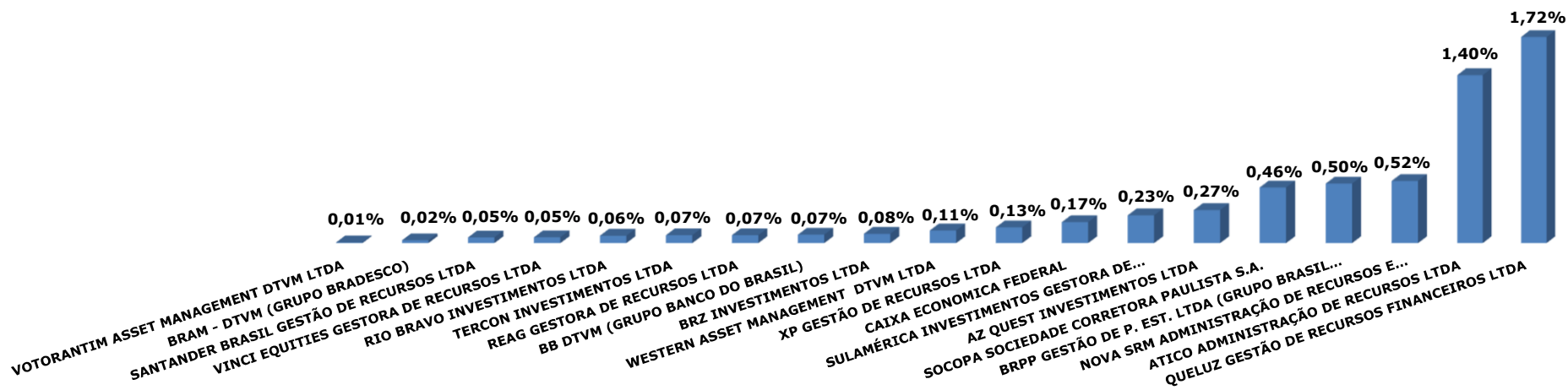
### Percentual de participação dos investimentos da Reciprev em relação ao Volume sob Administração Anbima



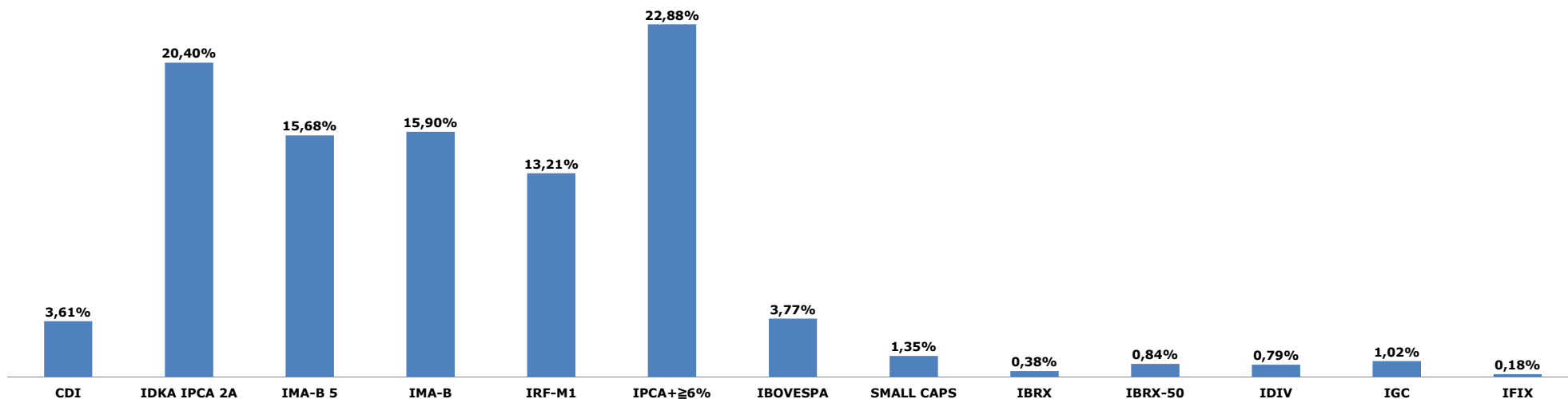
### Percentual de participação dos investimentos da Reciprev em relação ao Volume Consolidado por Grupo Econômico sob Administração Anbima



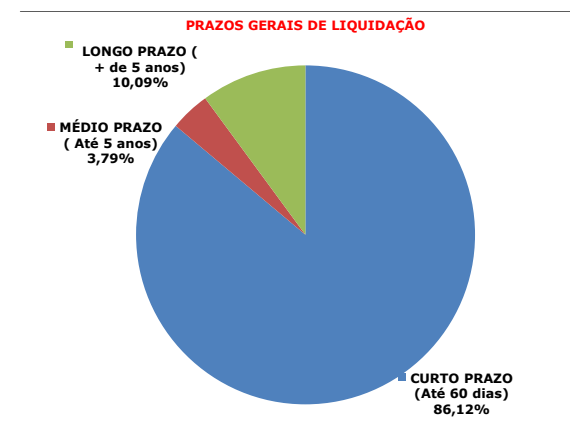
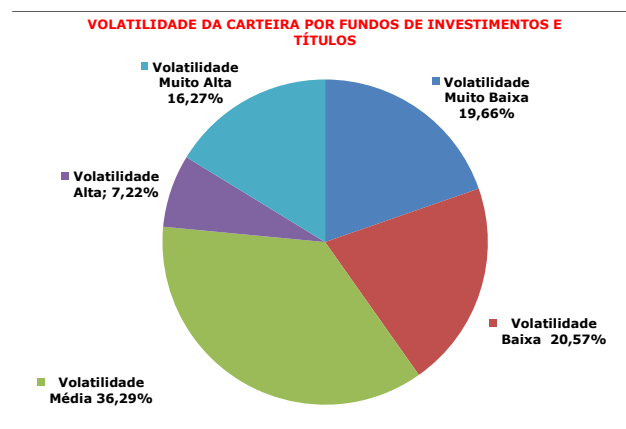
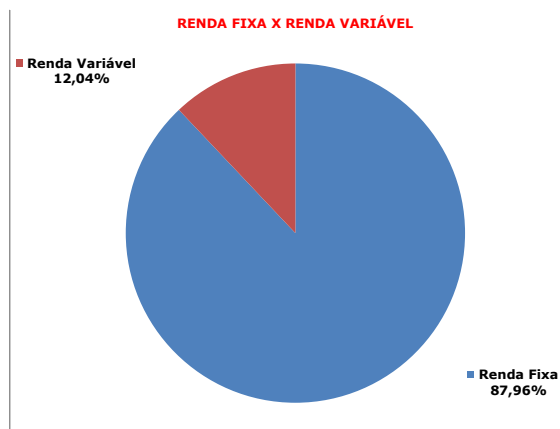
### Percentual de participação dos investimentos da Reciprev em relação ao Volume sob Gestão Anbima



## Percentual de Composição da Carteira RECIPREV por Benchmark - 2018



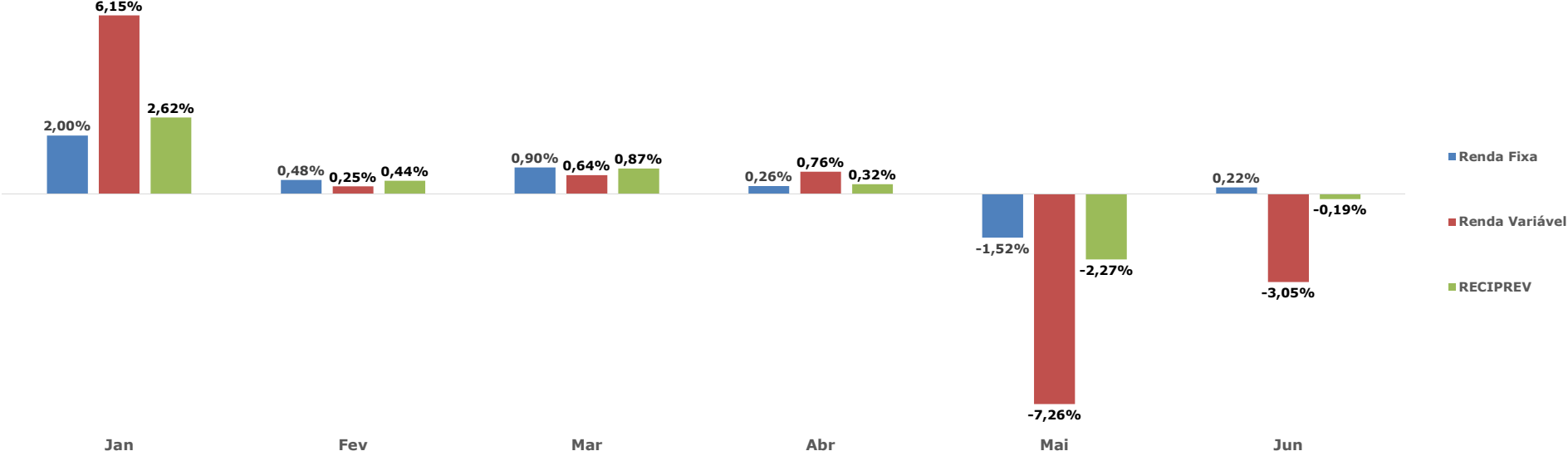
## Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2018



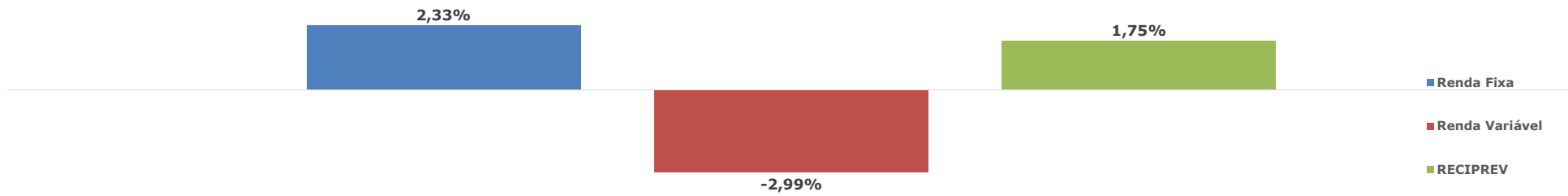


SEGMENTO	Tipo de Ativo	Limite da Reolução CMN (%)	Posição Atual da Carteira (R\$)	Posição Atual da Carteira (%)	Estratégia de Alocação - Política de Investimento de 2017			Meta de rentabilidade para o Exercício por tipo de Ativo	Resumo da Estratégia				Estratégia de alocação para os próximos 5 anos	
					Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)		% de Recursos do Ativo	Índice	Meta de Rentabilidade	Resumo da Estratégia	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
Renda Variável	FI Ações referenciados	30,00%	R\$ 38.261.275,30	2,14%	0,00%	1,32%	15,00%	25,00%	100,00%	IBRX	15,00%	Manutenção	1,00%	15,00%
	Sub-total		R\$ 38.261.275,30	2,14%		1,32%								
	FI de Índices Referenciados em Ações	20,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,50%	15,00%	25,00%	100,00%	Outros	15,00%	Aumento	1,00%	15,00%
	Sub-total		R\$ 0,00	0,00%		1,50%								
	FI em Ações	15,00%	R\$ 107.696.158,27	6,01%	10,00%	12,00%	15,00%	25,00%	56,08% 20,40% 13,52% 10,00%	IBOVESPA SMALL CAPS IBRX IGC	25,00% 25,00% 25,00% 25,00%	Aumento Aumento Aumento Aumento	7,00%	15,00%
	Sub-total		R\$ 107.696.158,27	6,01%		12,00%								
	FI Multimercado - Aberto	5,00%	R\$ 29.328.745,02	1,64%	3,00%	4,50%	5,00%	8,00%	72,73% 27,27%	CDI IPCA+≥6%	7,96% 6,38%	Aumento Aumento	3,00%	5,00%
	Sub-total		R\$ 29.328.745,02	1,64%		4,50%								
	FI em Participações - Fechado	5,00%	R\$ 25.028.556,67	1,40%	0,00%	0,38%	3,00%	23,82%	100,00%	IPCA+≥6%	23,82%	Redução	0,20%	2,00%
	Sub-total		R\$ 25.028.556,67	1,40%		0,38%								
	FI Imobiliários	5,00%	R\$ 15.491.943,28	0,86%	0,90%	1,87%	5,00%	8,00%	84,09% 15,91%	IPCA+≥6% IFIX	8,00% 8,00%	Aumento Manutenção	1,00%	5,00%
	Sub-total		R\$ 15.491.943,28	0,86%		1,87%								
	Sub-total		R\$ 215.806.678,53	12,04%		21,57%								
	Saldo Conta Corrente		R\$ 1,00	0,00%										
Total por Renda Fixa e Variável			R\$ 1.791.807.111,81	100,00%		100,00%								

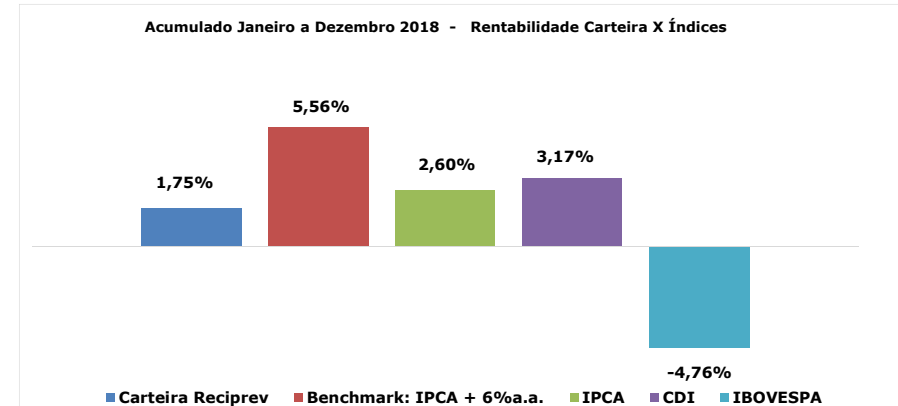
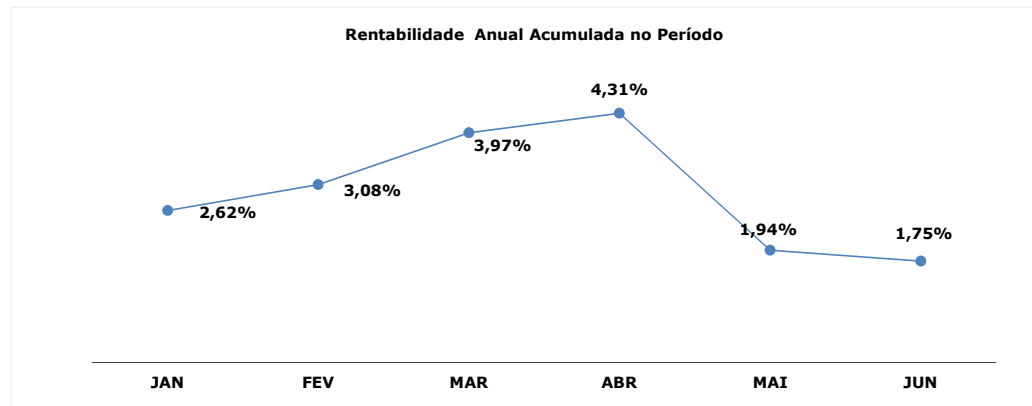
# Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2018



## Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2018



## Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2018





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

Data da Posição:	29/06/2018
------------------	------------

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 DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 30.151,57	R\$ 14.242,84
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\$ 2.116,99	R\$ 909.405,31
Saldo Conta Corrente				R\$ 1,00
Total Carteira RECIFIN			R\$ 32.268,56	R\$ 923.649,15

## 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	R\$ 1.792.998.351,99	R\$ 7.733.786,90	0,44%
29/03/2018	R\$ 1.813.284.796,12	R\$ 15.559.132,81	0,87%
30/04/2018	R\$ 1.824.998.752,94	R\$ 5.884.245,53	0,32%
30/05/2018	R\$ 1.789.147.426,15	-R\$ 41.624.222,75	-2,28%
29/06/2018	R\$ 1.791.807.111,74	-R\$ 3.204.823,24	-0,19%
31/07/2018			
31/08/2018			
30/09/2018			
31/10/2018			
30/11/2018			
31/12/2018			
<b>TOTAL</b>		R\$ 28.967.169,00	1,74%

### FUNDO FINANCEIRO RECIFIN

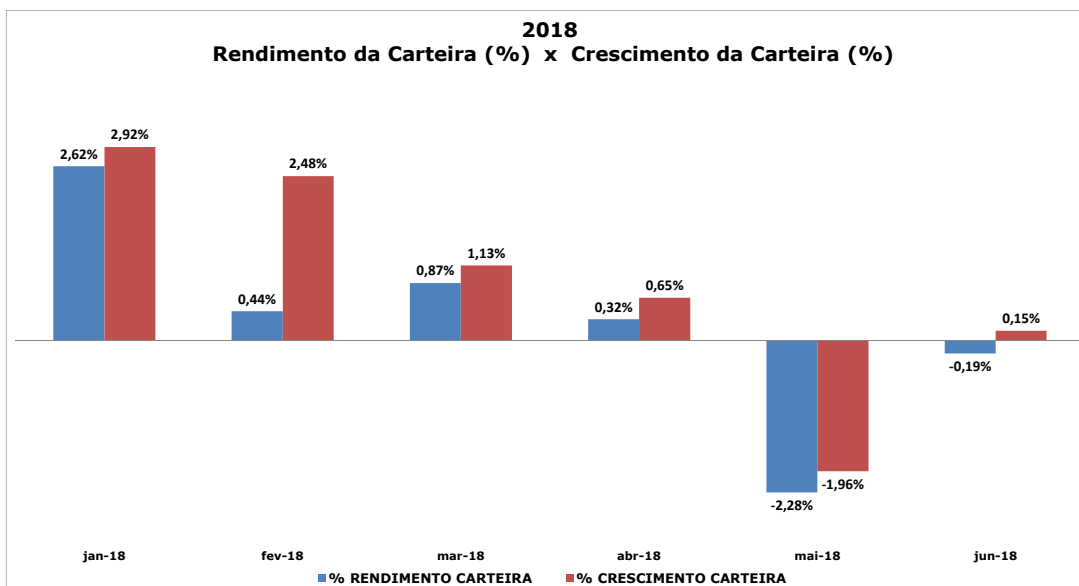
SALDO R\$	RENDIMENTO R\$
R\$ 231.603,35	R\$ 10.689,89
R\$ 8.721.018,25	R\$ 56.412,73
R\$ 180.886,63	R\$ 44.109,85
R\$ 274.214,12	R\$ 29.846,25
R\$ 1.051.721,08	R\$ 33.706,01
R\$ 923.649,15	R\$ 32.268,56
<b>TOTAL</b>	R\$ 207.033,29

### TOTAL FUNDOS: RECIPREV E RECIFIN

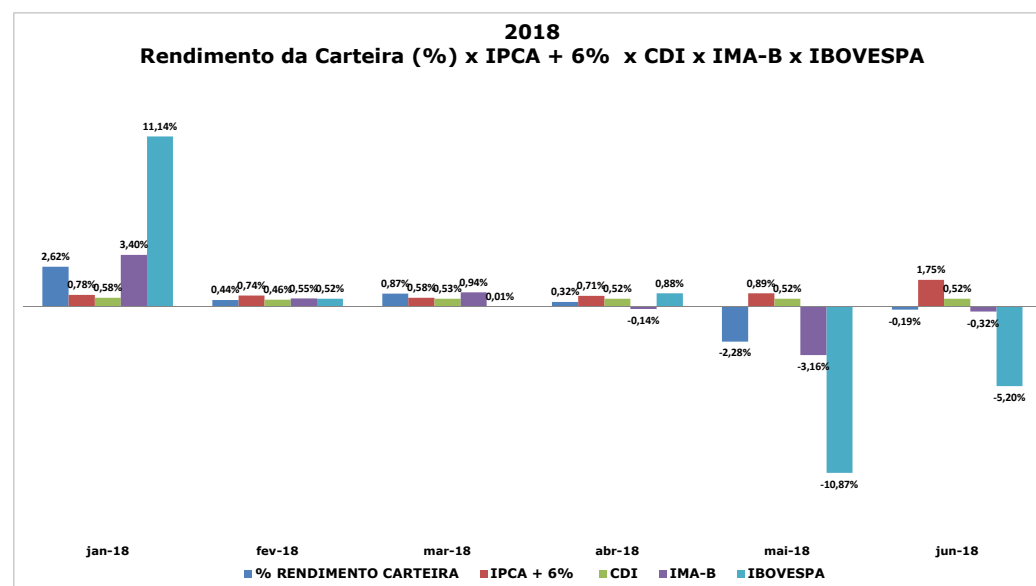
SALDO R\$	RENDIMENTO R\$
R\$ 1.749.860.302,82	R\$ 44.629.739,64
R\$ 1.801.719.370,24	R\$ 7.790.199,63
R\$ 1.813.465.682,75	R\$ 15.603.242,66
R\$ 1.825.272.967,06	R\$ 5.914.091,78
R\$ 1.790.199.147,23	-R\$ 41.590.516,74
R\$ 1.792.730.760,89	-R\$ 3.172.554,68
<b>TOTAL</b>	R\$ 29.174.202,29

### GRÁFICO COMPARATIVO DA CARTEIRA RECIPREV

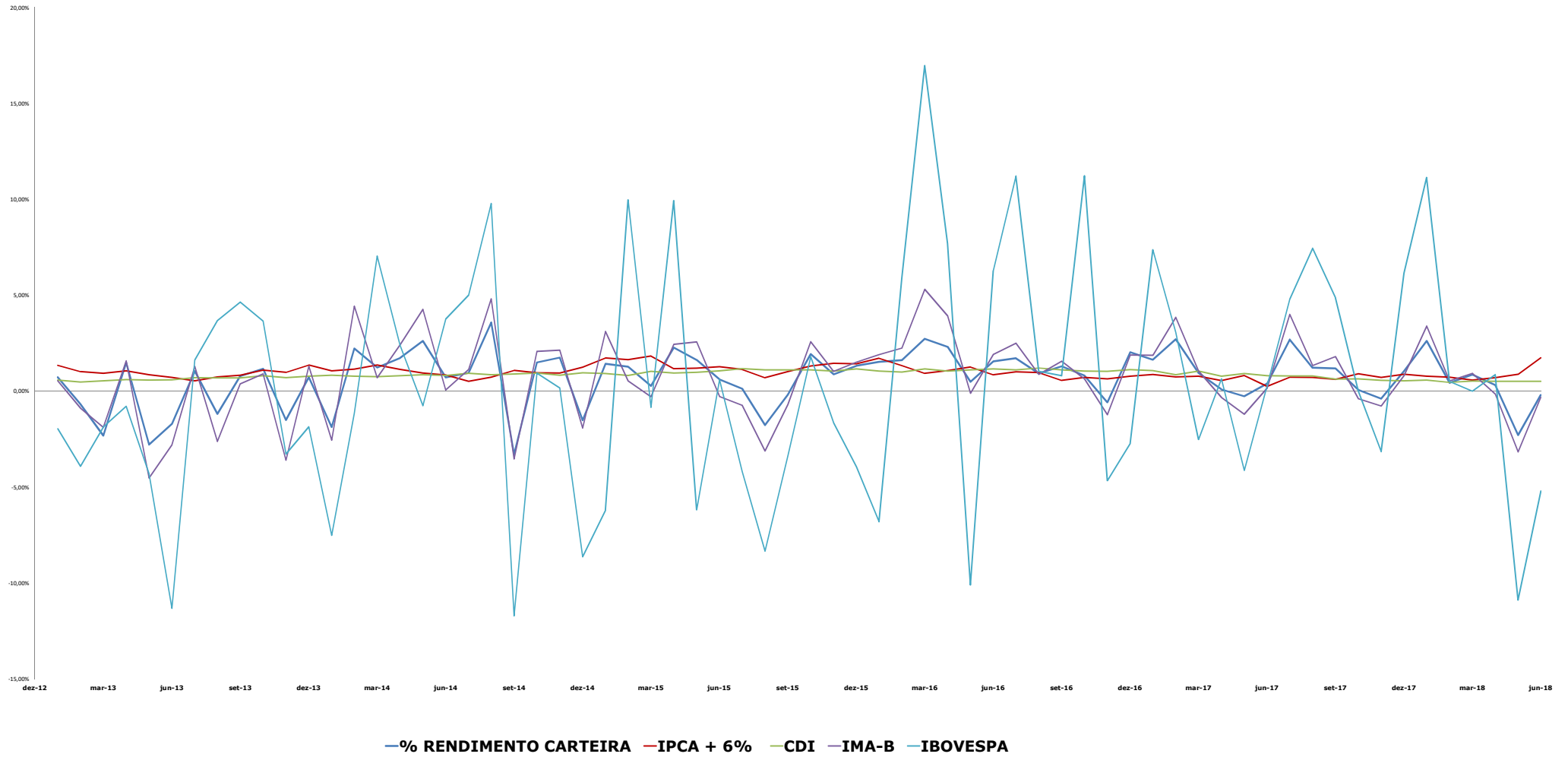
**2018**  
Rendimento da Carteira (%) x Crescimento da Carteira (%)



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



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



**FLUXO MENSAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPIV**

**ANO 2018**

<b>MÊS</b>	<b>JUNHO</b>				
<b>RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES E COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS</b>		<b>COMPETÊNCIA</b>	<b>VALOR</b>		<b>ACUMULADO ANUAL</b>
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		Contribuição de 05/2018 e Parcelamento 30/60	R\$	7.748.965,19	R\$ 59.578.684,79
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL INATIVOS/PENSIONISTAS)		Contribuição de 05/2018	R\$	1.510.724,65	R\$ 11.939.086,01
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		Contribuição de 05/2018	R\$	6.192.324,30	R\$ 48.555.770,19
COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA		06/2018	R\$	205.794,74	R\$ 1.107.882,33
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		Contribuição de 05 de 2018	R\$	53.719,75	R\$ 260.895,56
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		Contribuição de 05 de 2018	R\$	45.662,01	R\$ 222.406,37
<b>TOTAL</b>			R\$	15.757.190,64	R\$ 121.664.725,25
<b>RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS</b>			<b>VALOR</b>		<b>ACUMULADO ANUAL</b>
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)			R\$	25.000,00	R\$ 208.000,00
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)			R\$	24.262,00	R\$ 167.324,00
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$	71.521,56	R\$ 423.984,80
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			-		R\$ 576.641,95
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			-		R\$ 2.277.478,77
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			-		R\$ 697.238,89
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			-		R\$ 637.723,72
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			-		R\$ 374.536,48
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) - (CUPOM/JUROS)			-		R\$ 4.678.733,43
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			-		R\$ 2.716.081,20
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			-		R\$ 554.890,82
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			-		R\$ 669.036,03
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			-		R\$ 147.814,71
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			-		R\$ 233.595,32
<b>TOTAL</b>			R\$	120.783,56	R\$ 14.363.080,12
<b>FOLHA DE PAGAMENTO E CONSIGNAÇÕES</b>			<b>VALOR</b>		<b>ACUMULADO ANUAL</b>
FOLHA DE PAGAMENTO			-R\$	8.013.767,58	-R\$ 47.089.748,80
CONSIGNAÇÕES			-R\$	1.688.014,82	-R\$ 10.587.929,44
DEVOLUÇÕES DE FOLHA NÃO PROCESSADAS E DE CONSIGNAÇÕES			R\$	1.618,77	R\$ 34.586,66
<b>TOTAL</b>			-R\$	9.700.163,63	-R\$ 57.643.091,58
<b>PAGAMENTOS DIVERSOS</b>			<b>VALOR</b>		<b>ACUMULADO ANUAL</b>
TARIFA DE CUSTÓDIA DO FUNDO FII - BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS			-		-R\$ 59,25
TARIFA DE CUSTÓDIA TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)			-		R\$ -
CUSTO SELIC TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)			-R\$	377,56	-R\$ 2.352,04
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPIV			-R\$	203.672,99	-R\$ 1.252.139,29
<b>TOTAL</b>			-R\$	204.050,55	-R\$ 1.254.550,58
<b>RESUMO GERAL</b>			<b>VALOR</b>		<b>ACUMULADO ANUAL</b>
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES E COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS			R\$	15.757.190,64	R\$ 121.664.725,25
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS			R\$	120.783,56	R\$ 14.363.080,12
TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS E CONSIGNAÇÕES			-R\$	9.700.163,63	-R\$ 57.643.091,58
TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS			-R\$	204.050,55	-R\$ 1.254.550,58
<b>TOTAL</b>			R\$	5.973.760,02	R\$ 77.130.163,21

## ESTATÍSTICA DA CARTERIA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPEV

FUNDO	Benchmark	Retorno Médio Mensal	Retorno Médio Anual	Maior Retorno	Menor Retorno	Qtde. mês Positivo	Qtde. mês Negativo	Qtde. mês acima do Benchmark	Qtde. mês abaixo do Benchmark	Risco Mensal Período	Risco Anual do Período	Retorno Relativo ao Benchmark	Sharpe	Tracking Error	VAR (95%)
ÁTICO FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	IPCA+9,00%	-0,04%	-0,45%	9,25%	-3,38%	5	69	1	73	1,16%	4,02%	-60,30%	-2,70	4,14%	1,88%
AZ LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,27%	3,23%	11,71%	-11,45%	45	33	37	41	4,98%	17,24%	-4,09%	-0,42	8,86%	8,57%
AZ QUEST VALORE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - CRÉDITO PRIVADO	CDI	0,93%	11,76%	1,43%	0,47%	50	0	36	14	0,23%	0,80%	1,11%	0,37	0,29%	1,31%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Índice Small Cap	1,08%	13,74%	10,64%	-10,30%	59	31	61	29	4,54%	15,72%	150,08%	0,20	9,45%	8,64%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	IGC	0,30%	3,63%	11,85%	-9,83%	47	43	21	69	4,80%	16,62%	-7,42%	-0,42	0,89%	8,30%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IBOVESPA	0,54%	6,64%	11,10%	-9,70%	33	25	28	30	5,29%	18,32%	-6,21%	-0,25	6,45%	9,37%
BB AÇÕES PIPE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Índice Small Cap	0,50%	6,17%	8,48%	-11,71%	35	26	33	28	4,32%	14,95%	30,79%	-0,33	10,44%	7,69%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,77%	9,64%	1,17%	0,39%	86	0	1	85	0,21%	0,72%	-5,66%	-1,24	0,07%	1,11%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA IPCA 2A	0,96%	12,14%	3,50%	-0,91%	77	9	33	53	0,80%	2,76%	-4,08%	0,59	0,56%	2,27%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	0,92%	11,59%	5,33%	-4,50%	64	26	17	73	2,02%	7,01%	-2,35%	0,15	0,22%	4,26%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	0,98%	12,35%	2,53%	-0,52%	38	2	19	21	0,68%	2,36%	-1,42%	0,35	4,81%	2,10%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA IPCA 2A	0,96%	12,12%	2,21%	0,21%	38	0	14	24	0,46%	1,58%	-4,10%	0,41	2,28%	1,71%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + 6,00%	1,02%	12,93%	2,05%	0,45%	53	0	27	26	0,34%	1,18%	1,12%	1,32	0,66%	1,58%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + 6,00%	1,09%	13,89%	5,14%	-3,13%	41	13	29	25	1,65%	5,71%	5,02%	0,44	5,75%	3,81%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	1,05%	13,33%	3,69%	-2,78%	43	9	27	25	1,48%	5,12%	-1,47%	0,38	2,64%	3,49%
BRADERCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	IMA-B	0,94%	11,88%	5,14%	-4,37%	64	26	47	43	2,04%	7,07%	-0,39%	0,19	0,32%	4,32%
BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	IBOVESPA	0,66%	8,20%	12,66%	-12,05%	49	41	52	38	4,88%	16,89%	71,99%	-0,14	9,27%	8,80%
BRADERCO FI RF IRF - M 1 TP	IRF-M1	0,85%	10,68%	1,65%	0,17%	90	0	22	68	0,27%	0,95%	-1,63%	0,14	0,19%	1,30%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RF IMA-B 5	IMA-B 5	0,97%	12,22%	2,97%	-1,72%	43	3	16	30	0,86%	2,96%	-1,20%	0,24	0,28%	2,38%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	CDI	0,58%	7,17%	0,93%	0,25%	76	0	0	76	0,21%	0,71%	-17,09%	-4,52	0,06%	0,92%
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	IPCA+ 10,50%	0,40%	4,96%	39,38%	-20,82%	6	84	3	87	5,66%	19,60%	-56,34%	-0,29	19,55%	9,85%
TERRAS BRASIL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	IPCA+6,00%	-0,62%	-7,19%	104,77%	-62,23%	3	46	2	47	17,60%	60,96%	-54,37%	-0,31	61,04%	29,72%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IPCA + 6%	0,84%	10,51%	2,11%	-2,09%	50	3	24	29	0,76%	2,63%	-8,11%	-0,33	2,28%	2,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,97%	12,31%	5,89%	-3,32%	38	16	24	30	1,88%	6,53%	-5,06%	0,15	3,11%	4,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,86%	10,77%	4,05%	-3,32%	28	12	17	23	1,66%	5,75%	-5,99%	-0,13	3,54%	3,60%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,96%	12,10%	7,83%	-4,91%	33	19	23	29	2,64%	9,14%	-6,02%	0,08	3,20%	5,33%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,85%	10,64%	7,77%	-4,02%	25	15	17	23	2,40%	8,31%	-6,35%	-0,11	7,18%	4,82%

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	0,17%	2,06%	13,33%	-13,84%	35	32	36	31	5,00%	17,32%	7,44%	-0,50	5,59%	8,52%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	IBRX-50	0,01%	0,11%	11,94%	-13,12%	46	44	35	55	5,33%	18,45%	-20,19%	-0,57	3,14%	8,91%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	IFIX	0,64%	7,94%	27,60%	-16,19%	34	20	27	27	6,94%	24,03%	-8,78%	-0,14	21,88%	12,28%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B 5	0,95%	12,06%	3,61%	-1,59%	81	9	14	76	0,83%	2,88%	-1,99%	0,52	0,17%	2,33%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRFM-1	0,85%	10,72%	1,62%	0,19%	90	0	10	80	0,26%	0,92%	-1,39%	0,18	0,05%	1,29%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO	IPCA + 11,90%	1,26%	16,26%	2,27%	0,05%	50	0	21	29	0,35%	1,22%	-1,99%	3,93	1,05%	1,84%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS SRM - SENIOR 3	120% do DI	1,07%	13,57%	1,46%	0,22%	55	0	39	16	0,27%	0,94%	-0,63%	2,38	0,02%	1,52%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBRX	0,59%	7,34%	8,31%	-9,12%	56	34	47	43	3,60%	12,47%	26,26%	-0,26	9,97%	6,58%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	IPCA+8,00%	0,08%	0,95%	14,74%	-0,55%	1	63	1	63	1,86%	6,45%	-49,09%	-1,54	6,36%	3,16%
BB RECEÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	IPCA + 6,9506%	0,90%	11,31%	4,31%	-1,67%	38	8	23	23	1,12%	3,87%	-4,72%	-0,05	4,07%	2,74%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	125% do DI	-4,32%	-41,12%	53,59%	-69,06%	49	4	36	17	17,18%	59,53%	-94,68%	-0,88	59,20%	26,18%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)	IPCA+6,00%	0,79%	9,89%	11,67%	-8,30%	53	37	43	47	3,90%	13,51%	-16,28%	-0,05	13,52%	7,28%
RDF - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	150% do DI	1,37%	17,69%	1,83%	0,70%	45	0	35	10	0,34%	1,18%	-0,06%	5,26	0,10%	1,93%
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B 5	0,92%	11,55%	2,96%	-1,58%	73	8	11	70	0,83%	2,86%	-1,24%	0,40	0,09%	2,28%
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES	IBOVESPA	0,48%	5,95%	11,03%	-11,26%	48	42	51	39	4,80%	16,61%	46,91%	-0,28	7,99%	8,48%
SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	IPCA+7,50%	0,92%	11,61%	4,69%	-2,14%	39	16	22	33	1,54%	5,34%	-10,39%	0,05	5,19%	3,47%
SUL AMÉRICA EQUITIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBRX-50	0,14%	1,69%	14,70%	-17,93%	46	44	42	48	5,62%	19,48%	-10,21%	-0,45	11,31%	9,55%
SUL AMÉRICA EVOLUTION FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	CDI	0,90%	11,41%	4,42%	-2,70%	75	13	56	32	1,10%	3,81%	5,87%	0,23	3,69%	2,72%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RF LONGO PRAZO	IMA-B	0,96%	12,09%	5,64%	-4,08%	67	23	50	40	2,04%	7,08%	0,98%	0,22	1,22%	4,34%
SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RF CRÉDITO PRIVADO	CDI	0,86%	10,79%	1,30%	0,45%	90	0	73	17	0,22%	0,76%	1,69%	0,33	0,28%	1,22%
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,58%	7,24%	8,50%	-11,40%	55	35	51	39	3,65%	12,66%	60,93%	-0,26	13,18%	6,66%
VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	1,04%	13,26%	2,91%	-1,06%	53	4	30	27	0,72%	2,48%	2,11%	0,81	2,50%	2,23%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	CDI	0,87%	10,97%	2,19%	-0,27%	87	3	52	38	0,43%	1,50%	2,94%	0,29	1,28%	1,58%
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IMA-B 5	0,99%	12,51%	4,07%	-2,49%	48	10	31	27	1,21%	4,19%	-0,27%	0,31	1,61%	2,99%
WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	Sem benchmark	0,19%	2,26%	15,06%	-11,03%	44	46	46	44	5,23%	18,13%	12,61%	-0,46	8,65%	8,93%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	CDI	0,92%	11,61%	2,77%	-1,40%	77	13	53	37	0,83%	2,88%	7,41%	0,37	2,78%	2,29%
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Sem benchmark	0,92%	11,61%	12,51%	-11,09%	44	24	37	31	4,67%	16,16%	59,75%	0,06	14,95%	8,70%
XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	CDI	1,03%	13,03%	3,62%	-2,41%	80	10	51	39	1,06%	3,67%	18,16%	0,68	3,57%	2,77%
<b>CARTEIRA RECIPREV</b>	<b>IPCA+6% ano</b>	<b>0,86%</b>	<b>10,86%</b>	<b>4,55%</b>	<b>-2,78%</b>	<b>70</b>	<b>20</b>	<b>43</b>	<b>47</b>	<b>1,39%</b>	<b>4,81%</b>	<b>-10,58%</b>	<b>0,07</b>	<b>4,84%</b>	<b>3,16%</b>

---

## 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);

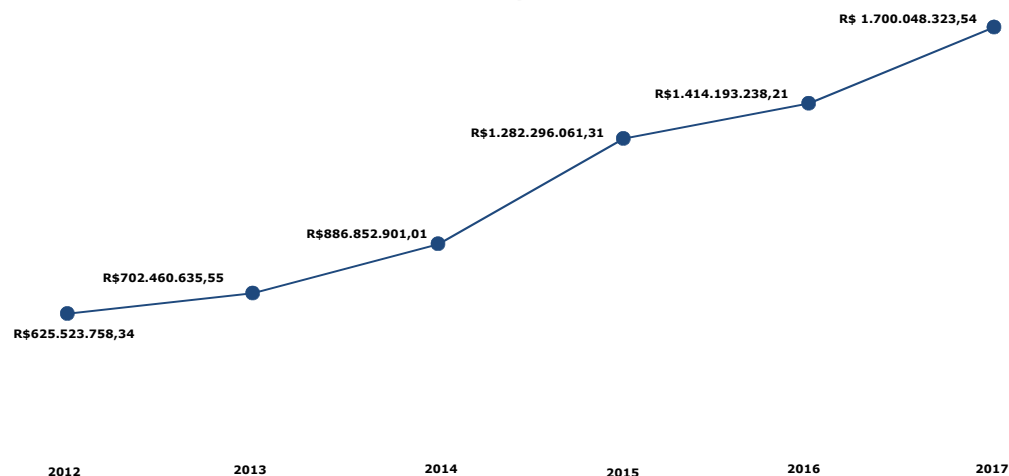
> **Sharpe:** Dado pela fórmula: (Retorno médio anual do ativo - Retorno médio anual do CDI) / (Risco anual do Ativo). Portanto, quanto maior, melhor;

> **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;

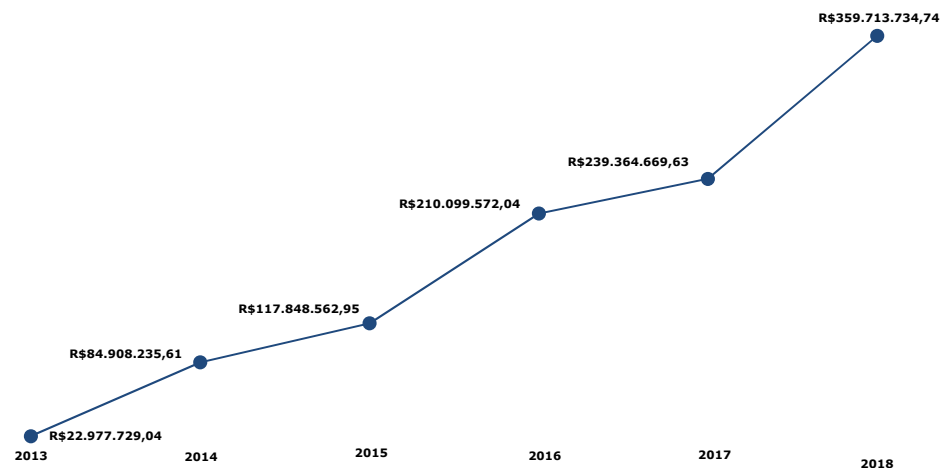
> **VAR (95%):** Menor retorno possível dentro do intervalo de confiança de 95%. Portanto, quanto mais próximo de zero, melhor;

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

**Fundo Previdenciário Reciprev - Total de Ativos**



**Fundo Previdenciário Reciprev - Superavit Atuarial**



### EQUIPE DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

#### PANORAMA MACROECONÔMICO

A inflação do mês de junho ficou acima das expectativas do mercado. Fechou com 1,26%. O mercado financeiro em junho continuou a apresentar resultados muito abaixo do esperado. A renda fixa apresentou rendimentos muito pequenos e a renda variável, em decorrência, dos cenários, apresentou resultados negativos.

#### DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

IPCA do mês de	JUNHO	<b>1,26%</b>	Sendo	Meta Atuarial para o Ano de 2018		<b>IPCA + 6,00% ao ano</b>	
Meta Atuarial para o mês de	JUNHO	<b>1,75%</b>		Meta Atuarial acumulada no ano de 2018		<b>5,56%</b>	
Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em	JUNHO	<b>-0,19%</b>		Renda Fixa	<b>0,22%</b>	Renda Variável	<b>-3,05%</b>
Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2018		<b>1,76%</b>		Percentual de atingimento da meta atuarial acumulada no ano de 2018		<b>31,64%</b>	

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](http://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), 19 de julho de 2018**