

Relatório Mensal de Investimentos  
Portaria MPS Nº 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:	30/09/2021
------------------	------------

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores)		
Renda Fixa		%
TESOURO NACIONAL	R\$ 919.664.828,24	35,72%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 431.642.478,05	16,76%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 147.063.205,74	5,71%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 21.852.322,08	0,85%
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 355.716,99	0,01%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 4.573,30	0,00%
<b>TOTAL RF</b>	<b>R\$ 1.520.583.124,41</b>	<b>59,06%</b>
Renda Variável		%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 184.912.215,64	7,18%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 100.881.544,11	3,92%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 78.965.319,83	3,07%
BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	R\$ 72.989.822,94	2,83%
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 67.025.144,27	2,60%
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 63.323.454,09	2,46%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 62.180.043,18	2,42%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$ 53.064.016,81	2,06%
SOMMA INVESTIMENTOS S/A	R\$ 31.511.983,53	1,22%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 30.373.413,28	1,18%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 17.333.357,65	0,67%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 16.444.134,38	0,64%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$ 12.353.653,40	0,48%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 5.604.802,62	0,22%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 3.662.609,74	0,14%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 2.506.710,51	0,10%
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 874.159,20	0,03%
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$ 615.686,01	0,02%
<b>TOTAL RV</b>	<b>R\$ 804.622.071,21</b>	<b>31,25%</b>
Exterior		%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 161.098.182,30	6,26%
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 38.671.616,58	1,50%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 24.985.511,74	0,97%
BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	R\$ 24.687.030,85	0,96%
<b>TOTAL EXTERIOR</b>	<b>R\$ 249.442.341,47</b>	<b>9,69%</b>
SALDO CONTA CORRENTE	R\$ 38.599,75	0,00%
<b>PATRIMÔNIO</b>	<b>R\$ 2.574.686.136,83</b>	<b>100,00%</b>

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores)		
Renda Fixa		%
TESOURO NACIONAL	R\$ 919.664.828,24	35,72%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 431.642.478,05	16,76%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 147.063.205,74	5,71%
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	R\$ 21.852.322,08	0,85%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$ 355.716,99	0,01%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 4.573,30	0,00%
<b>TOTAL RF</b>	<b>R\$ 1.520.583.124,41</b>	<b>59,06%</b>
Renda Variável		%
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	R\$ 277.718.760,51	10,79%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 254.213.621,46	9,87%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	R\$ 85.343.476,35	3,31%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 82.346.189,54	3,20%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 62.180.043,18	2,42%
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$ 30.373.413,28	1,18%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$ 6.226.078,24	0,24%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 5.604.802,62	0,22%
RJI CTVM LTDA	R\$ 615.686,01	0,02%
<b>TOTAL RV</b>	<b>R\$ 804.622.071,21</b>	<b>31,25%</b>
Exterior		%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 161.098.182,30	6,26%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	R\$ 63.358.647,43	2,46%
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	R\$ 24.985.511,74	0,97%
<b>TOTAL EXTERIOR</b>	<b>R\$ 249.442.341,47</b>	<b>9,69%</b>
SALDO CONTA CORRENTE	R\$ 38.599,75	0,00%
<b>PATRIMÔNIO</b>	<b>R\$ 2.574.686.136,83</b>	<b>100,00%</b>

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (Índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% 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
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	1,00%	CDI	Não possui	1,29%	1,44%	R\$ 33.331.081,52	13.077.415/0001-05	0,35%	1,66%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,30 a 0,50	IMA GERAL EX-C	Não possui	0,00%	0,00%	R\$ -	25.078.994/0001-90	-0,01%	-1,38%	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)	0,15%	IPCA + 6,00%	Não possui	0,99%	7,22%	R\$ 25.420.671,24	15.486.093/0001-83	1,13%	2,87%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IPCA + 6,00%	Não possui	2,03%	9,05%	R\$ 52.276.374,38	19.303.795/0001-35	1,20%	3,51%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IMA-B	Não possui	1,19%	10,61%	R\$ 30.761.694,57	19.523.306/0001-50	1,19%	3,38%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IMA-B	Não possui	0,20%	2,16%	R\$ 5.273.384,03	19.523.305/0001-06	1,30%	4,66%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Baixo
BRADERCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	0,20%	IMA-B	Não possui	0,00%	0,00%	R\$ -	08.702.798/0001-25	-0,20%	-3,14%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	3,00%	CDI	Não possui	0,01%	0,02%	R\$ 355.716,99	13.397.466/0001-14	0,27%	1,14%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Muito Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,98%	5,61%	R\$ 25.316.460,00	18.598.288/0001-03	0,96%	1,27%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	1,18%	2,17%	R\$ 30.478.260,00	20.139.595/0001-78	0,96%	1,28%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,27%	10,87%	R\$ 7.026.192,00	19.769.046/0001-06	-0,49%	-1,21%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,43%	5,05%	R\$ 10.968.937,00	20.139.534/0001-00	-0,49%	-1,28%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IRF-M 1+	Não possui	3,30%	5,74%	R\$ 84.911.121,86	10.577.519/0001-90	-0,78%	-6,12%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IDKA IPCA 2A	Não possui	10,60%	2,47%	R\$ 272.941.507,20	14.386.926/0001-71	1,08%	2,79%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,40%	IPCA	Não possui	0,00%	0,00%	R\$ -	23.215.097/0001-55	0,35%	-1,16%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Muito Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	SINGULARE CTVM S.A.	SINGULARE CTVM S.A.	0,20%	125% do DI	Não possui	0,00%	14,22%	R\$ 4.573,30	13.633.964/0001-19	48,27%	-22,53%	Médio Prazo	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	Risco Muito Alto

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (Índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,40%	CDI	0,2	0,20%	0,97%	R\$ 5.143.104,72	19.488.768/0001-84	0,55%	4,05%	Curto Prazo	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	Risco Baixo
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,55%	IMA-B	0,2	0,65%	7,13%	R\$ 16.709.217,36	14.115.118/0001-70	-0,38%	-2,91%	Curto Prazo	FI Renda Fixa "Referenciado"	Risco Alto
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	0,20%	IMA-B 5	Não possui	0,00%	0,00%	R\$ -	13.455.117/0001-01	0,99%	2,33%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219 (7604)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+7.002299%	Não possui	1,30%	0,00%	R\$ 33.416.722,19		1,77%	8,43%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220 (7608)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+7.002655%	Não possui	2,79%	0,00%	R\$ 71.845.952,77		1,77%	8,43%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 (7647)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+6.261127%	Não possui	1,42%	0,00%	R\$ 36.649.639,15		2,42%	8,83%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571 (7632)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+6.269771%	Não possui	1,42%	0,00%	R\$ 36.645.280,59		2,51%	8,93%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045-CÓDIGO: 15759226)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,86%	Não possui	1,68%	0,00%	R\$ 43.240.955,68		0,45%	0,45%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045-CÓDIGO: 15759225)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,86%	Não possui	1,68%	0,00%	R\$ 43.240.955,68		0,45%	0,45%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045-CÓDIGO: 15759224)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,86%	Não possui	1,68%	0,00%	R\$ 43.240.955,68		0,45%	0,45%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040-CÓDIGO: 15860603)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,94%	Não possui	6,46%	0,00%	R\$ 166.389.940,44		0,08%	0,08%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040-CÓDIGO: 15860602)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,94%	Não possui	0,81%	0,00%	R\$ 20.798.742,56		0,08%	0,08%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040-CÓDIGO: 15860600)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,94%	Não possui	1,62%	0,00%	R\$ 41.597.485,11		0,08%	0,08%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040-CÓDIGO: 15836500)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,93%	Não possui	1,62%	0,00%	R\$ 41.597.485,11		0,15%	0,15%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040-CÓDIGO: 15836499)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,94%	Não possui	4,85%	0,00%	R\$ 124.934.749,53		0,15%	0,15%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045-CÓDIGO: 15786866)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,865%	Não possui	3,36%	0,00%	R\$ 86.426.385,50		0,39%	0,39%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045-CÓDIGO: 15786865)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,865%	Não possui	5,04%	0,00%	R\$ 129.639.578,25		0,39%	0,39%	Longo Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	0,40%	IMA-B 5	Não possui	0,00%	0,00%	R\$ 0,00	17.517.577/0001-78	0,67%	-1,44%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio

Renda Fixa				59,06%				R\$ 1.520.583.124,41				2,40%			
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	0,67%	1,57%	R\$	17.333.357,65	11.182.064/0001-77	-4,73%	-1,21%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
SOMMA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	SOMMA INVESTIMENTOS S/A	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	1,22%	9,16%	R\$	31.511.983,53	14.550.994/0001-24	-5,45%	-3,29%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,50%	Índice Small Cap	20,00%	2,46%	3,97%	R\$	63.323.454,09	11.392.165/0001-72	-4,19%	-1,53%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
BNP PARIBAS ACTION FIC FI AÇÕES	BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	0,78%	7,64%	R\$	20.076.344,91	12.239.939/0001-92	-6,13%	-9,33%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	2,00%	SMLL	20,00%	2,06%	9,65%	R\$	52.913.478,04	11.108.013/0001-03	-5,27%	-3,44%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	1,00%	IGC	Não possui	2,19%	5,03%	R\$	56.389.600,07	10.418.335/0001-88	-6,75%	-5,50%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	Risco Alto
BB AÇÕES QUANTITATIVO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	0,88%	1,70%	R\$	22.575.719,76	07.882.792/0001-14	-3,98%	-3,26%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (Índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% PL RECIPEV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	1,50%	IBOVESPA	Não possui	2,60%	5,06%	R\$ 67.025.144,27	06.916.384/0001-73	-5,97%	-7,21%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,70%	IBRX-50	Não possui	3,23%	7,36%	R\$ 83.210.587,29	03.737.217/0001-77	-7,25%	-6,05%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,50%	Índice Small Cap	Não possui	1,79%	4,41%	R\$ 46.168.933,20	15.154.220/0001-47	-6,52%	-6,24%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	Risco Muito Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,50%	IBOVESPA	Não possui	2,16%	5,72%	R\$ 55.532.695,14	30.068.224/0001-04	-5,52%	-5,72%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,72%	IDIV	20,00%	2,69%	6,89%	R\$ 69.301.405,83	15.154.441/0001-15	-6,49%	-7,26%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,85%	IPCA + 6,9506%	20,00%	0,10%	4,83%	R\$ 2.506.710,51	20.716.161/0001-93	23,76%	7,40%	Médio Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	SINGULARE CTVM S.A.	SINGULARE CTVM S.A.	1,36%	IPCA+7,50%	20,00%	0,22%	21,92%	R\$ 5.604.802,62	16.841.067/0001-99	-2,33%	17,22%	Médio Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	1,50%	IPCA+9,00%	Não possui	0,24%	4,55%	R\$ 6.226.078,24	12.312.767/0001-35	-0,08%	-0,44%	Curto Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	RJI CTVM LTDA	0,30%	IPCA+ 10,50%	Vide regulamento	0,02%	3,14%	R\$ 615.686,01	11.490.580/0001-69	-0,30%	159,83%	Curto Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
TERRAS BRASIL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	2,00%	IPCA+6,00%	20,00%	0,03%	9,94%	R\$ 874.159,20	19.412.474/0001-79	10,49%	20,46%	Médio Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAU)	ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAU)	2,50%	IBOVESPA	20,00%	2,42%	8,58%	R\$ 62.180.043,18	23.731.629/0001-07	-8,10%	-3,72%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBRX	20,00%	0,40%	8,93%	R\$ 10.218.056,14	09.289.072/0001-75	-8,92%	-15,28%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
MONGERAL AEGON FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	0,14%	11,37%	R\$ 3.662.609,74	33.254.944/0001-44	-7,46%	-18,20%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Médio
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	2,50%	IBOVESPA	20,00%	1,18%	11,45%	R\$ 30.373.413,28	02.436.763/0001-05	-7,96%	-11,37%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
SUL AMÉRICA EQUITIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	1,50%	IBRX-50	20,00%	2,06%	8,95%	R\$ 53.064.016,81	11.458.144/0001-02	-7,31%	-9,02%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	1,23%	5,10%	R\$ 31.580.138,29	07.488.106/0001-25	-6,93%	-8,90%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	2,50%	Sem benchmark	Não possui	0,48%	8,36%	R\$ 12.353.653,40	09.087.523/0001-91	-8,13%	-14,52%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
<b>Renda Variável</b>						<b>31,25%</b>		<b>R\$ 804.622.071,21</b>			<b>-6,20%</b>			

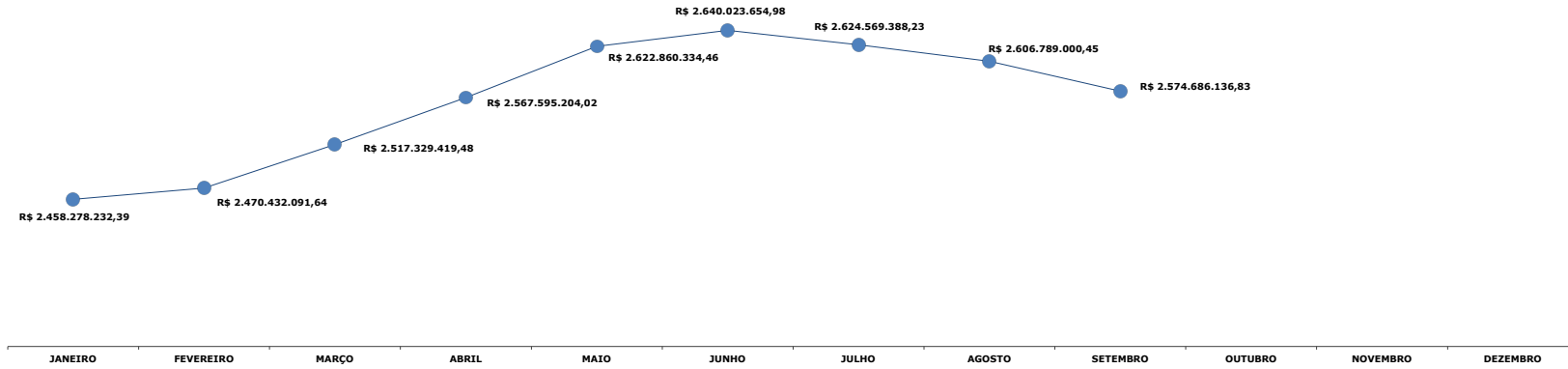
Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (Índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% PL RECIPEV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,70%	BDRX	Não possui	6,26%	4,83%	R\$ 161.098.182,30	17.502.937/0001-68	-0,25%	16,72%	Curto Prazo	Fundo de Ações – BDR Nível I - Art. 9º, III	Risco Alto
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,70%	MSCI World	Não possui	0,97%	0,88%	R\$ 24.985.511,74	38.001.966/0001-16	0,68%	11,83%	Curto Prazo	FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	Risco Alto
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	0,80%	MSCI World	Não possui	1,50%	2,47%	R\$ 38.671.616,58	33.913.562/0001-85	0,61%	5,53%	Curto Prazo	FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	Risco Muito Alto
ACCESS USA COMPANIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INVESTIMENTO NO EXTERIOR	BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	0,70%	RUSSEL 1000 Growth	Não possui	0,96%	0,40%	R\$ 24.687.030,85	11.147.668/0001-82	0,17%	21,37%	Curto Prazo	FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	Risco Alto
<b>Exterior</b>						<b>9,69%</b>		<b>R\$ 249.442.341,47</b>			<b>0,02%</b>			
<b>Saldo Conta Corrente</b>						<b>0,00%</b>		<b>R\$ 38.599,75</b>						
<b>Total Geral</b>						<b>100,00%</b>		<b>R\$ 2.574.686.136,83</b>		<b>Rentabilidade Reciprev</b>	<b>0,42%</b>			

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

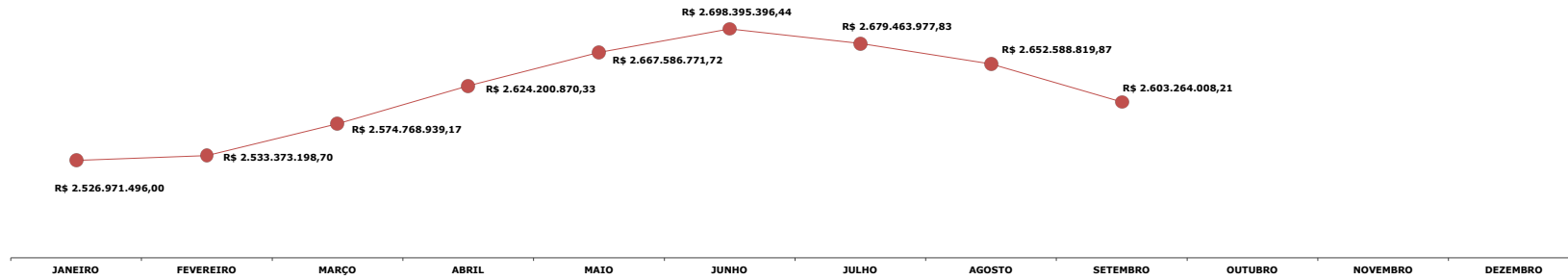
\* A partir de 01/01/2019, os títulos públicos do Tesouro Nacional em posse do Fundo Previdenciário RECIPEV: TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS COM VENCIMENTO EM 15/05/2045 (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10399219; TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10399220; TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 e TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571, passaram a ser marcados pela "CURVA DE JUROS", de aquisição dos títulos, respectivamente: IPCA+7,002399%; IPCA+7,002655%; IPCA+6,261127% e IPCA+6,269771%, conforme definido na Política de Investimentos de 2019 e em conformidade com as normas da Secretaria de Previdência (Portaria nº 577, de 27 de dezembro de 2017 e Portaria SPREV nº 4, de 05 de fevereiro de 2018). Como os títulos são de longo prazo e com expectativa de se levar ao vencimento final, com a marcação pela curva de juros, evitaremos a volatilidade dos mesmos. O total dos referidos títulos em 31/12/2018, apresentavam "valor de mercado" já que eram "marcados à mercado", o valor de R\$ 187.984.960,92. Com a mudança de metodologia, passando a ser usada marcação pela "curva de juros", o valor dos mesmos no dia 01/01/2019, passou a valer R\$ 150.374.784,14, correspondente ao valor de aquisição atualizados pelas taxas de compra de cada um. Deste modo, apesar da redução do Patrimônio Líquido da carteira, no valor equivalente a diferença do preço à mercado e na curva de juros, reduzimos a volatilidade da carteira e utilizamos o valor real dos ativos até o seu vencimento, nesta data os preços à mercado e pela curva de juros se encontram. A partir de setembro de 2021, iniciamos a compra de NTN-B 2040 e 2045, com todas marcadas pela curva de juros.

TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) / Marcação a Mercado	R\$	948.242.699,61
Preço da Carteira à Mercado	R\$	2.603.264.008,21
Provisão para perdas futuras de investimentos	R\$	4.425.548,81






















**Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos na Curva RECIPREV 2021**



**Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos à Mercado RECIPREV 2021**





ADMINISTRADORES DE RECURSOS	GRUPO ECONÔMICO DO ADMINISTRADOR DE RECURSOS	GESTORES DE RECURSOS	VALOR	% CARTEIRA	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 226.028.525,58	8,78%	
		BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 874.159,20	0,03%	
		RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 2.506.710,51	0,10%	
		TOTAL	R\$ 229.409.395,29	8,91%	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 777.652.875,99	30,20%	
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 69.301.405,83	2,69%	
		TOTAL	R\$ 846.954.281,82	32,90%	
		GESTOR/CUSTODIA	VALOR	% CARTEIRA	
		TESOURO NACIONAL - Valor na Curva	R\$ 919.664.828,24	35,72%	
		TESOURO NACIONAL - Valor à Mercado	R\$ 948.242.699,61	36,43%	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 355.716,99	0,01%	
		TOTAL	R\$ 355.716,99	0,01%	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 67.025.144,27	2,60%	
		CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 17.333.357,65	0,67%	
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 10.218.056,14	0,40%	
		SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$ 53.064.016,81	2,06%	
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 31.580.138,29	1,23%	
		MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 50.500.443,57	1,96%	
		AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 63.323.454,09	2,46%	
		SOMMA INVESTIMENTOS S/A	R\$ 31.511.983,53	1,22%	
		TOTAL	R\$ 324.556.594,33	12,61%	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 30.373.413,28	1,18%	
		TOTAL	R\$ 30.373.413,28	1,18%	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 62.180.043,18	2,42%	
		TOTAL	R\$ 62.180.043,18	2,42%	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 6.226.078,24	0,24%	
		TOTAL	R\$ 6.226.078,24	0,24%	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL (GRUPO BNP)	R\$ 97.676.853,79	3,79%	
		WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$ 12.353.653,41	0,48%	
		XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 38.671.616,58	1,50%	
		TOTAL	R\$ 148.702.123,78	5,78%	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 5.609.375,93	0,22%	
		TOTAL	R\$ 5.609.375,93	0,22%	
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA	
		BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$ 615.686,01	0,02%	
		TOTAL	R\$ 615.686,01	0,02%	
		TOTAL GERAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV	Na Curva	R\$ 2.574.647.537,08	100,00%
			À Mercado	R\$ 2.603.225.408,46	

PRAZOS DE LIQUIDAÇÃO DA CARTEIRA							
CARTEIRA GERAL	RENDA FIXA	RENDA VARIÁVEL	EXTERIOR	TOTAL			
CURTO PRAZO ( Até 60 dias)	R\$ 413.391.749,65	R\$ 795.636.398,87	R\$ 249.442.341,47	R\$ 1.458.470.489,99			56,65%
MÉDIO PRAZO ( Até 5 anos)	R\$ 283.787.277,78	R\$ 8.985.672,33	- R\$	R\$ 292.772.950,11			11,37%
LONGO PRAZO ( + de 5 anos)	R\$ 823.404.096,98	R\$ -	- R\$	R\$ 823.404.096,98			31,98%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 1.520.583.124,41</b>	<b>R\$ 804.622.071,21</b>	<b>R\$ 249.442.341,47</b>	<b>R\$ 2.574.647.537,08</b>			<b>100,00%</b>

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DA CARTEIRA - INDICES			
ÍNDICE	VALOR		%
IPCA+26%	R\$ 1.013.189.310,45		39,35%
IBOVESPA	R\$ 354.205.103,15		13,76%
IDKA IPCA 2A	R\$ 272.941.507,20		10,60%
SMALL CAPS	R\$ 162.405.865,33		6,31%
BDRX	R\$ 161.098.182,30		6,26%
S&P500	R\$ 88.344.159,17		3,43%
IBRX-50	R\$ 136.274.604,10		5,29%
IMA-B	R\$ 126.534.144,96		4,91%
IGC	R\$ 56.389.600,07		2,19%
IDIV	R\$ 69.301.405,83		2,69%
IRF-M 1+	R\$ 84.911.121,86		3,30%
IBRX	R\$ 10.218.056,14		0,40%
CDI	R\$ 38.834.476,53		1,51%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.574.647.537,08</b>		<b>100,00%</b>

## Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV -2021

RENDA FIXA X RENDA VARIÁVEL X EXTERIOR			
	VALOR		%
RENDA FIXA	R\$ 1.520.583.124,41		59,06%
RENDA VARIÁVEL	R\$ 804.622.071,21		31,25%
EXTERIOR	R\$ 249.442.341,47		9,69%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.574.647.537,08</b>		<b>100,00%</b>

VOLATILIDADE DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS E TÍTULOS			
	VALOR		%
Volatilidade Alta	R\$ 690.785.360,84		26,83%
Volatilidade Média	R\$ 443.416.600,93		17,22%
Volatilidade Muito Alta	R\$ 476.677.459,82		18,51%
Volatilidade Muito Baixa	R\$ 920.020.545,22		35,73%
Volatilidade Baixa	R\$ 43.747.570,27		1,70%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.574.647.537,08</b>		<b>100,00%</b>

## Posição dos Gestores e Administradores da Carteira de Investimentos RECIPREV 2021

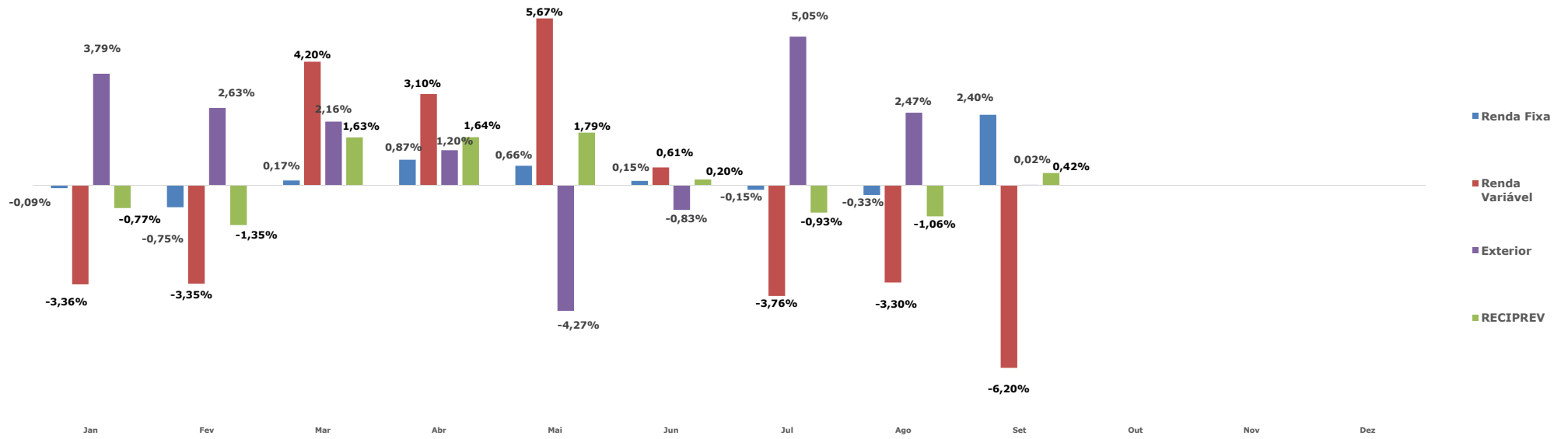
VOLUME DE APLICAÇÕES POR GESTOR				
GESTOR	VALOR APLICADO	% CARTEIRA	% Máximo Permitido	%
SOMMA INVESTIMENTOS S/A	R\$ 31.511.983,53	1,22%		0,78%
BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	R\$ 97.676.853,79	3,79%		0,17%
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 63.323.454,09	2,46%		0,40%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 226.028.525,58	8,78%		0,02%
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 67.380.861,25	2,62%		0,00%
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$ 615.686,01	0,02%		0,00%
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 874.159,20	0,03%		0,03%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 777.652.875,99	30,20%		0,18%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 17.333.357,65	0,67%		0,96%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 62.180.043,18	2,42%	Máximo permitido 5,00% do volume de gestão ANBIMA	0,01%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 50.500.443,57	1,96%		0,62%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 16.444.134,38	0,64%		1,87%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 2.506.710,51	0,10%		0,03%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 30.373.413,28	1,18%		0,01%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 5.609.375,93	0,22%		0,15%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$ 53.064.016,81	2,06%		0,20%
TESOURO NACIONAL	R\$ 919.664.828,24	35,72%		0,00%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 100.881.544,11	3,92%		0,24%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$ 12.353.653,41	0,48%		0,03%
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 38.671.616,58	1,50%		0,03%

VOLUME DE APLICAÇÕES POR ADMINISTRADOR						
ADMINISTRADOR	VALOR APLICADO	% CARTEIRA	% Máximo Permitido	% Máximo Permitido	Percentual do Volume de Recursos Reciprev em relação ao Volume ANBIMA de ADMINISTRAÇÃO	Percentual do Volume de Administração Anbima Junto a RPPS = Máximo 50%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA (GRUPO SAFRA)	R\$ -	0,00%			0,00%	8,39%
RJI CTVM LTDA	R\$ 615.686,01	0,02%			0,01%	8,78%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$ 6.226.078,24	0,24%			0,01%	0,57%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$ 62.180.043,18	2,42%			0,01%	0,01%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 5.609.375,93	0,22%	Máximo permitido 5,00% do volume de Administração ANBIMA	Máximo permitido de todos os RPPS 50,00% do volume de Administração ANBIMA	0,01%	0,13%
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$ 30.373.413,28	1,18%			0,01%	0,57%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$ 324.912.311,32	12,62%			0,06%	1,74%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 229.409.395,29	8,91%			0,00%	0,17%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	R\$ 148.702.123,78	5,78%			0,19%	3,26%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 846.954.281,82	32,90%			0,16%	15,04%
TESOURO NACIONAL	R\$ 919.664.828,24	35,72%				

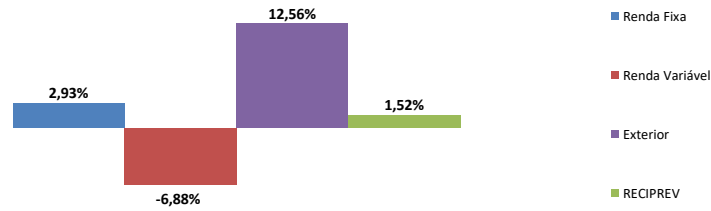
SEGMENTO	Tipo de Ativo	Limite da Resolução CMN (%)	Posição Atual da Carteira (R\$)	Posição Atual da Carteira (%)	Estratégia de Alocação - Política de Investimento de 2021			Meta de rentabilidade para o Exercício por tipo de Ativo	Resumo da Estratégia			Estratégia de alocação para os próximos 5 anos	
					Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)		Meta de Rentabilidade	Resumo da Estratégia	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	
Renda Fixa	Títulos Públicos de emissão do TN - Art. 7º, I, a	100,00%	R\$ 178.557.594,70	35,72%	0,00%	7,12%	100,00%	10,01%	10,01%	0,00%	5,00%	100,00%	
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	100,00%	R\$ 545.374.602,28	21,18%	0,00%	37,42%	100,00%	7,02%	7,02%	0,00	0,00%	100,00%	
									0,00%	0,00			
									0,00%	0,00			
									0,00%	0,00			
Renda Fixa	ETF - 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, c	100,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	0,00%	0,00	0,00%	100,00%		
Renda Fixa	Operações compromissadas - Art. 7º, II	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00	0,00%	5,00%		
Renda Fixa	FI Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, a	60,00%	R\$ 16.709.217,36	0,65%	0,00%	0,80%	75,00%	5,11%	5,11%	0,00	0,00%	75,00%	
Renda Fixa	ETF - Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, b	60,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	75,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	75,00%	
Renda Fixa	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	40,00%	R\$ 33.686.798,51	1,31%	0,00%	15,04%	55,00%	5,60%	5,60%	0,00	0,00%	55,00%	
									0,00%	0,00			
									0,00%	0,00			
									0,00%	0,00			
Renda Fixa	ETF - Demais Indicadores de RF - Art. 7º, IV, b	40,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	55,00%	0,00%	0,00	0,00%	55,00%		
Renda Fixa	Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, V, b	20,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%		
Renda Fixa	CDB - Certificado de Depósito Bancário - Art. 7º, VI, a	15,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%		
Renda Fixa	Poupança - Art. 7º, VI, b	15,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%		
Renda Fixa	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a	5,00%	R\$ 4.573,30	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00	0,00%	5,00%		
Renda Fixa	FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, b	5,00%	R\$ 5.143.104,72	0,20%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00	0,00%	10,00%		
Renda Fixa	FI Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, VII, c	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%		
Renda Variável	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, a	30,00%	R\$ 185.769.120,56	7,22%	0,00%	6,54%	45,00%	12,80%	12,80%	0,00	0,00%	45,00%	
									0,00%	0,00			
									0,00%	0,00			
Renda Variável	ETF - Índice de Ações (c/ no mínimo 50) - Art. 8º, I, b	30,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	45,00%		
Renda Variável	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	20,00%	R\$ 603.025.514,05	23,42%	0,00%	22,74%	35,00%	14,82%	14,82%	0,00	0,00%	35,00%	
									0,00%	0,00			
									0,00%	0,00			
									0,00%	0,00			
Renda Variável	ETF - Demais Índices de Ações - Art. 8º, II, b	20,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	35,00%		
Renda Variável	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	10,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00	0,00%	10,00%		
Renda Variável	FI em Participações - Art. 8º, IV, a	5,00%	R\$ 7.715.923,46	0,30%	0,00%	0,41%	2,00%	0,00%	0,00	0,00%	2,00%		
Renda Variável	FI Imobiliários - Art. 8º, IV, b	5,00%	R\$ 8.111.513,13	0,32%	0,00%	0,46%	1,00%	11,20%	11,20%	0,00	0,00%	1,00%	
									0,00%	0,00			
Exterior	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	10,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	2,49%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	
Exterior	FIC Aberto - Investimento no Exterior	10,00%	R\$ 88.344.159,17	3,43%	0,00%	5,23%	10,00%	12,38%	12,38%	0,00	0,00%	10,00%	
Exterior	Fundo de Ações - BDR Nível I	10,00%	R\$ 161.098.182,30	6,26%	0,00%	1,75%	10,00%	28,12%	28,12%	0,00	0,00%	10,00%	
	Saldo Conta Corrente		R\$ 38.599,75	0,00%									
Total por Renda Fixa, Variável e Exterior			R\$ 1.833.578.903,30	100,00%		100,00%							

POLÍTICA 2021										
TIPOS DE ATIVOS		Artigo da Resolução 3.922/10	Limite da Resolução CMN (%)	Limites da Política Carteira RECIPREV 2021		Limites da Política Carteira RECIPREV 2021			Carteira RECIPREV - Posição Atual	
				Política	Nível III	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)		
<b>RENDA FIXA</b>			<b>Limites 3.922/2010 Nível III</b>							
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)		Art. 7º, I, "a"	100,00%	0,00%	100,00%	0,00%	7,12%	100,00%	35,72%	-28,60%
Fundos 100% Títulos Públicos		Art. 7º, I, "b"	100,00%	0,00%	100,00%	0,00%	37,42%	100,00%	21,18%	16,24%
Fundos de índices carteira 100% Títulos Públicos		Art. 7º, I, "c"	100,00%	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%
Operações compromissadas		Art. 7º, II	5,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%
Fundos referenciados em indicadores RF		Art. 7º, III, "a"	75,00%	0,00%	75,00%	0,00%	0,80%	75,00%	0,65%	0,15%
Fundos de índices (ETF) em indicadores títulos		Art. 7º, III, "b"	75,00%	0,00%	75,00%	0,00%	0,00%	75,00%	0,00%	0,00%
Fundos Renda fixa em geral		Art. 7º, IV, "a"	55,00%	0,00%	55,00%	0,00%	15,04%	55,00%	1,31%	13,73%
Fundos de Índices (ETF) - quaisquer Indicadores		Art. 7º, IV, "b"	55,00%	0,00%	55,00%	0,00%	0,00%	55,00%	0,00%	0,00%
Letra Imobiliária Garantida		Art. 7º, V	20,00%	0,00%	20,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Certificado de Depósito Bancário - CDB		Art. 7º, VI, "a"	15,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Poupança		Art. 7º, VI, "b"	15,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior		Art. 7º, VII, "a"	15,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%
Fundos Renda fixa - Crédito Privado		Art. 7º, VII, "b"	20,00%	0,00%	20,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,20%	-0,20%
Fundos de debêntures de infraestrutura		Art. 7º, VII, "c"	15,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>							<b>60,38%</b>		<b>59,06%</b>	<b>1,32%</b>
<b>RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>			<b>Limites 3.922/2010 Nível III</b>	<b>Política</b>	<b>Nível III</b>			<b>Nível IV</b>		
Fundo de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações		Art. 8º, I, "a"	45,00%	0,00%	45,00%	0,00%	6,54%	45,00%	7,22%	-0,68%
ETF (Índices c/ no mínimo 50 ações)		Art. 8º, I, "b"	45,00%	0,00%	45,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Fundos de Ações em geral		Art. 8º, II, "a"	35,00%	0,00%	35,00%	0,00%	22,74%	35,00%	23,42%	-0,68%
ETF (Índices em geral)		Art. 8º, II, "b"	35,00%	0,00%	35,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Multimercado		Art. 8º, III	10,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%
FI em Participações		Art. 8º, IV, "a"	10,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,41%	2,00%	0,30%	0,11%
FI Imobiliários		Art. 8º, IV, "b"	15,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,46%	1,00%	0,32%	0,14%
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>							<b>30,15%</b>		<b>31,25%</b>	<b>-1,10%</b>
<b>EXTERIOR</b>			<b>Limites 3.922/2010</b>	<b>Limite Inicial</b>	<b>Nível III</b>					
FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa		Art. 9º, I								
FIC Abeerito - Investimento no Exterior		Art. 9º, II	10,00%	10,00%	10,00%	0,00%	9,47%	10,00%	9,69%	-0,22%
Fundo de Ações - BDR Nível I		Art. 9º, III								
<b>TOTAL EXTERIOR</b>							<b>9,47%</b>		<b>9,69%</b>	<b>-0,22%</b>

### Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPIREV - 2021



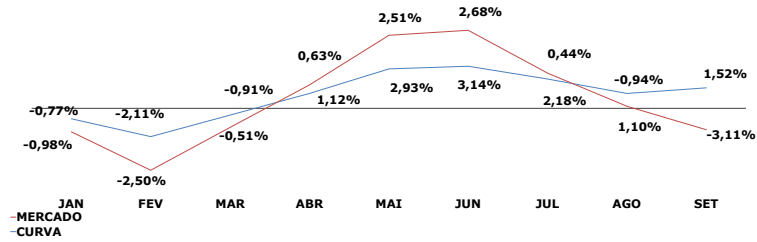
Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPIREV - 2021



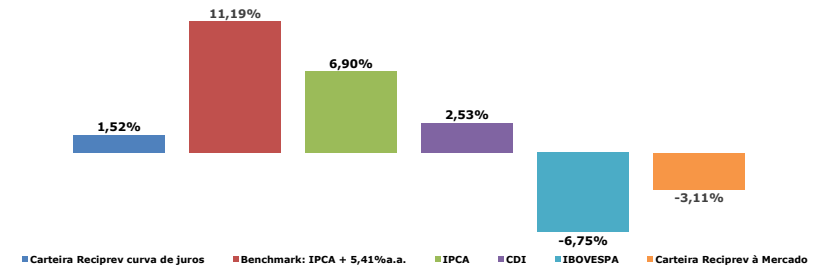
Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPIREV -2021

% Atingimento acumulado anual da meta na Curva	-9,67%
% Atingimento acumulado anual da meta à Mercado	-14,29%

Rentabilidade Anual Acumulada no Período



Acumulado Janeiro a Dezembro 2021 - Rentabilidade Carteira X Índices



Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

Relatórios da Carteira de Investimentos RECIFIN

Data da Posição:	30/09/2021
------------------	------------

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\$ 23.642,67	R\$ 449.528,73
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\$ 10.199,71	R\$ 104.244,83
Saldo Conta Corrente				R\$ 1,00
<b>Total Carteira RECIFIN</b>			<b>R\$ 33.842,38</b>	<b>R\$ 553.774,56</b>

RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

ANO 2021

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV - VALOR PELA CURVA DE JUROS			
DATA	SALDO R\$	RENDIMENTO R\$	% RENDIMENTO CARTEIRA NA CURVA
31/01/2021	R\$ 2.458.278.232,39 -R\$	19.095.842,30	-0,77%
28/02/2021	R\$ 2.470.432.091,64 -R\$	33.159.898,34	-1,35%
31/03/2021	R\$ 2.517.329.419,48 R\$	40.369.178,28	1,63%
30/04/2021	R\$ 2.567.595.204,02 R\$	40.944.324,80	1,64%
31/05/2021	R\$ 2.622.860.334,46 R\$	46.338.157,92	1,79%
30/06/2021	R\$ 2.640.023.654,98 R\$	5.203.786,55	0,20%
31/07/2021	R\$ 2.624.569.388,23 -R\$	24.636.722,80	-0,93%
31/08/2021	R\$ 2.606.789.000,45 -R\$	27.748.501,45	-1,06%
30/09/2021	R\$ 2.574.686.136,88 -R\$	40.708.224,39	0,42%
31/10/2021	R\$ - R\$	-	0,00%
30/11/2021	R\$ - R\$	-	0,00%
31/12/2021	R\$ - R\$	-	0,00%
<b>TOTAL</b>	<b>-R\$</b>	<b>12.493.741,73</b>	<b>1,52%</b>

FUNDO FINANCEIRO RECIFIN			
SALDO R\$	RENDIMENTO R\$	SALDO R\$	RENDIMENTO R\$
R\$ 180.341,05	R\$ 1.118,80	R\$ 24.834.872,69	R\$ 8.776,55
R\$ 12.768.088,52	R\$ 29.547,60	R\$ 5.613.426,17	R\$ 23.627,24
R\$ 2.490.084,45	R\$ 32.494,09	R\$ 509.901,69	R\$ 13.098,64
R\$ 575.365,77	R\$ 15.423,72	R\$ 126.972,60	R\$ 20.757,12
R\$ 553.774,56	R\$ 33.842,38	R\$ -	R\$ -
R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>178.686,14</b>	

TOTAL FUNDOS: RECIPREV E RECIFIN	
SALDO R\$	RENDIMENTO R\$
R\$ 2.458.458.573,44 -R\$	19.094.723,50
R\$ 2.495.266.964,33 -R\$	33.151.121,79
R\$ 2.530.097.508,00 R\$	40.398.725,88
R\$ 2.573.208.630,19 R\$	40.967.952,04
R\$ 2.625.350.418,91 R\$	46.370.652,01
R\$ 2.640.533.556,67 R\$	5.216.885,19
R\$ 2.625.144.754,00 -R\$	24.621.299,08
R\$ 2.606.915.973,05 -R\$	27.727.744,33
R\$ 2.575.239.911,44 -R\$	40.674.382,01
R\$ - R\$	-
R\$ - R\$	-
R\$ - R\$	-
R\$ - R\$	-
<b>TOTAL</b>	<b>-R\$ 12.315.055,59</b>

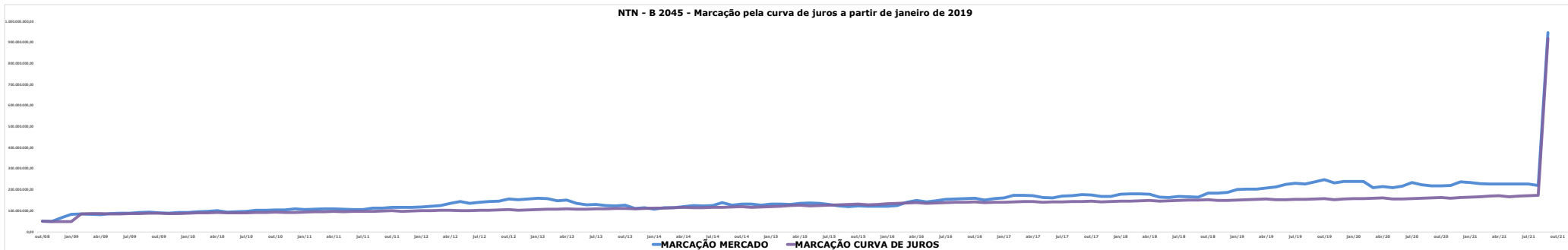
EVOLUÇÃO DA CARTEIRA CONSIDERANDO ENTRADAS LÍQUIDAS E PAGAMENTOS

ANO	RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES E PARCELAMENTO	PAGAMENTOS: FOLHA E CONSIGNAÇÕES	PAGAMENTOS: TAXA DE ADMINISTRAÇÃO E OUTRAS DESPESAS	ENTRADA LÍQUIDA ANUAL	RENDIMENTOS ANUAL	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DA CARTEIRA À MERCADO
2014	R\$ 115.431.675,14	-R\$ 3.221.190,93	-R\$ 18.536,66	R\$ 112.191.947,55	R\$ 72.522.075,78	R\$ 886.852.901,01
2015	R\$ 117.302.754,14	-R\$ 4.189.355,35	-R\$ 16.578.587,13	R\$ 96.534.811,66	R\$ 95.546.968,68	R\$ 1.078.056.212,44
2016	R\$ 143.494.169,55	-R\$ 7.018.990,34	-R\$ 2.720.504,82	R\$ 133.754.674,39	R\$ 202.325.745,52	R\$ 1.414.193.238,21
2017	R\$ 180.636.860,66	-R\$ 68.732.744,46	-R\$ 2.720.462,94	R\$ 109.183.653,26	R\$ 176.804.521,49	R\$ 1.700.048.323,54
2018	R\$ 214.384.992,90	-R\$ 129.774.770,08	-R\$ 40.998.812,81	R\$ 43.611.410,01	R\$ 190.832.868,93	R\$ 1.933.190.049,07
2019	R\$ 215.935.879,37	-R\$ 127.033.834,35	-R\$ 4.116.698,14	R\$ 84.785.346,88	R\$ 347.109.435,32	R\$ 2.442.162.349,29
2020	R\$ 170.946.149,56	-R\$ 137.850.291,09	-R\$ 3.963.467,19	R\$ 29.132.391,28	R\$ 98.314.570,92	R\$ 2.560.487.104,88
2021	R\$ 197.725.752,91	-R\$ 93.341.749,18	-R\$ 3.141.844,88	R\$ 101.242.158,85	-R\$ 12.493.741,73	R\$ 2.603.264.008,26
<b>TOTAIS</b>	<b>R\$ 1.158.132.481,32</b>	<b>-R\$ 477.821.176,60</b>	<b>-R\$ 71.117.069,69</b>	<b>R\$ 609.194.235,03</b>	<b>R\$ 1.183.456.186,64</b>	

GRÁFICO COMPARATIVO DA CARTEIRA RECIPREV

DATA	% RENDIMENTO CARTEIRA NA CURVA	% RENDIMENTO CARTEIRA À MERCADO	IPCA	IPCA + 6% até 31/12/2019. A partir de 01/01/2020 IPCA + 5,00%. A partir de 01/01/2021 IPCA + 5,41%	CDI	IMA-B	IBOVESPA	% CRESCIMENTO CARTEIRA NA CURVA	% CRESCIMENTO CARTEIRA À MERCADO
31/01/2021	-0,77%	-0,98%	0,25%	0,69%	0,15%	-0,85%	-3,32%	-1,11%	-1,31%
28/02/2021	-1,35%	-1,54%	0,86%	1,30%	0,13%	-1,52%	-4,37%	0,49%	0,25%
31/03/2021	1,63%	1,63%	0,93%	1,37%	0,20%	-0,46%	6,00%	1,90%	1,63%
30/04/2021	1,64%	1,56%	0,31%	0,75%	0,21%	0,65%	1,94%	2,00%	1,92%
30/05/2021	1,79%	1,86%	0,83%	1,27%	0,27%	1,06%	6,16%	2,15%	2,20%
30/06/2021	0,20%	0,17%	0,53%	0,97%	0,31%	0,42%	0,46%	0,65%	0,61%
31/07/2021	-0,93%	-2,18%	0,96%	1,40%	0,36%	-0,37%	-3,94%	-0,59%	-0,70%
31/08/2021	-1,06%	-1,38%	0,87%	1,31%	0,43%	-1,09%	-2,48%	-0,68%	-1,00%
30/09/2021	0,42%	-2,18%	1,16%	1,61%	0,44%	-0,13%	-6,57%	-1,23%	-1,86%
31/10/2021	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
30/11/2021	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
31/12/2021	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>TOTAL</b>	<b>1,52%</b>	<b>-3,11%</b>	<b>6,90%</b>	<b>11,19%</b>	<b>2,53%</b>	<b>-2,80%</b>	<b>-6,75%</b>	<b>3,57%</b>	<b>1,67%</b>

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





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

ANO 2021

MÊS SETEMBRO

RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO	COMPETÊNCIA	VALOR		ACUMULADO ANUAL
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	08/2021	R\$	9.952.727,79	R\$ 98.881.006,24
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL INATIVOS/PENSIONISTAS)	08/2021	R\$	1.678.887,04	R\$ 16.441.181,55
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	08/2021	R\$	7.994.497,65	R\$ 71.062.622,27
PARCELAMENTO	Parcela 9/60	R\$	1.069.462,53	R\$ 9.010.193,57
COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA	09/2021	R\$	375.673,65	R\$ 1.520.410,77
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)	08/2021	R\$	57.678,80	R\$ 444.872,35
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)	08/2021	R\$	46.388,95	R\$ 365.466,16
<b>TOTAL</b>		<b>R\$</b>	<b>21.175.316,41</b>	<b>R\$ 197.725.752,91</b>

RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS	VALOR		ACUMULADO ANUAL
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	R\$	635.501,20	R\$ 829.501,20
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)	R\$	-	R\$ 3.252.569,08
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSECTORIAL INVEST DUMAS LP (COTAS SÊNIORES) - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	R\$	-	R\$ 4.600,75
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	R\$	-	R\$ 657.960,76
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	R\$	-	R\$ 2.784.435,86
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	R\$	-	R\$ 1.596.087,54
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)	R\$	-	R\$ 289.177,99
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219	R\$	-	R\$ 1.042.237,91
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220	R\$	-	R\$ 2.240.811,50
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570	R\$	-	R\$ 1.042.237,91
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571	R\$	-	R\$ 1.042.237,91
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759224)	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759225)	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759226)	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786865)	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786866)	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836499 )	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836500)	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860600)	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860602)	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860603)	R\$	-	R\$ -
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (BB NTN-B 2040- CÓDIGO: 15917043)	R\$	-	R\$ -
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	R\$	-	R\$ 1.318.764,71
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	R\$	-	R\$ 1.582.589,88
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	R\$	-	R\$ 350.823,64
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)	R\$	-	R\$ 602.227,82
<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>635.501,20</b>	<b>R\$ 18.636.264,46</b>

FOLHA DE PAGAMENTO E CONSIGNAÇÕES	VALOR		ACUMULADO ANUAL
FOLHA DE PAGAMENTO	-R\$	8.599.672,90	-R\$ 77.234.975,13
CONSIGNAÇÕES	-R\$	3.664.313,18	-R\$ 16.174.261,14
DEVOLUÇÕES DE FOLHA NÃO PROCESSADAS E DE CONSIGNAÇÕES	R\$	-	R\$ 67.487,09
<b>TOTAL</b>	<b>-R\$</b>	<b>12.223.986,08</b>	<b>-R\$ 93.341.749,18</b>

PAGAMENTOS DIVERSOS	VALOR		ACUMULADO ANUAL
TARIFA DE CORRETAGEM DE FUNDOS IMOBILIÁRIOS	R\$	-	R\$ -
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\$	545,55	-R\$ 4.932,57
SISTEMA QUANTUM	-R\$	2.058,59	-R\$ 17.417,18
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPREV	-R\$	346.610,57	-R\$ 3.119.495,13
<b>TOTAL</b>	<b>-R\$</b>	<b>349.214,71</b>	<b>-R\$ 3.141.844,88</b>

RESUMO GERAL	VALOR		ACUMULADO ANUAL
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO	R\$	21.175.316,41	R\$ 197.725.752,91
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS	R\$	635.501,20	R\$ 18.636.264,46
TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS E CONSIGNAÇÕES	-R\$	12.223.986,08	-R\$ 93.341.749,18
TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS	-R\$	349.214,71	-R\$ 3.141.844,88
<b>TOTAL</b>	<b>R\$</b>	<b>9.237.616,82</b>	<b>R\$ 119.878.423,31</b>

**CONTRATOS DE PRESTAÇÃO DE SERVIÇOS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS**

CONTRATOS DE PRESTAÇÃO DE SERVIÇOS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS	VALOR		ACUMULADO ANUAL
Contrato de Sistema de Banco de Dados - Paramita Tecnologia Consultoria Financeira Ltda (QUANTUM)	-R\$	2.058,59	-R\$ 17.417,18
Contrato de Custódia Títulos junto ao Banco do Brasil S.A. O custo é somente o da SELIC. Encerrado em set/2021	-R\$	545,55	-R\$ 3.851,09
Contrato com a Corretora Santander. Destinado a venda do fundo: FII BB Recebíveis Imobiliário. Custo 0,10% de corretagem e os custos normais da operação.	R\$	-	R\$ -
Contrato com a Corretora. Destinado a venda do fundo Singularre FII. Custo zero de corretagem. Somente os custos normais da operação.	R\$	-	R\$ -
Contrato com a Corretora XPI. Destinado aos serviços de compra e venda de Títulos Públicos e Custódia de Títulos	R\$	-	R\$ -
Contrato com a Corretora Renascença. Destinado aos serviços de compra e venda de Títulos Públicos. Custo sobre as operações, quando houver, 0,001%	R\$	-	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>-R\$</b>	<b>2.604,14</b>	<b>-R\$ 21.268,27</b>





---

## CONCEITOS

---

\* Base de dados: Quantum; Econômica; ANBIMA; CETIP; Fundos de Investimentos; Carteira RECIPIEV;

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

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

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

\*\*\*\*\*O Ativo livre de risco considerado foi o CDI;

->Benchmark: Indicador de retorno do fundo

->Retorno médio mensal: 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 (\*\*);

->Retorno Total: Quanto o ativo proporcionou de retorno total, considerando o período avaliado do ativo, tendo como base o período da observação (\*\*);

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

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

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

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

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

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

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

->Risco Mensal 12 meses: Desvio padrão dos retornos dos últimos 12 meses com periodicidade mensal;

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

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

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

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

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

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

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

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

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

->Information Ratio: Dado pela fórmula: (Retorno médio anual do ativo - Retorno médio anual do Benchmark) / Treck Error. 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 HISTÓRICO (95%): Valor esperado da perda máxima ou da pior perda em um horizonte de tempo em um intervalo de confiança;

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

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

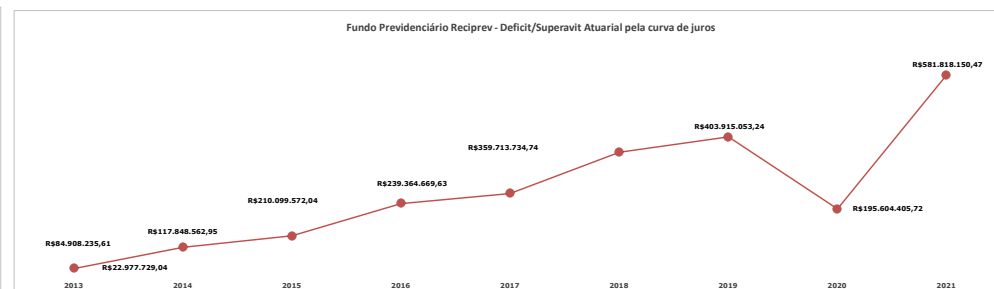
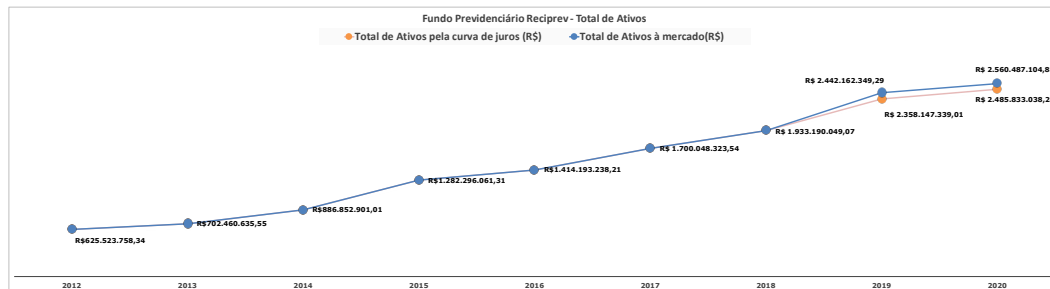
->Correlação Ibovespa: Correlação do ativo com o Ibovespa, ou seja, como o ativo se movimenta em relação ao comportamento do Ibovespa. Se igual ou próximo de zero, não há correlação. Se positiva, próxima de +1, têm mesmo sentido de movimento. Se negativa, próxima de -1, têm sentidos opostos de movimentos;

->Sharpe Modificada: Dado pela fórmula: (Retorno médio anual do ativo - Retorno médio anual do CDI) / (Risco anual do Ativo - Risco anual do CDI). Comparado com o Índice Sharpe, leva em consideração o risco do "ativo livre de risco". Portanto, quanto maior, melhor;

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

->Erro Quadrático Médio (EQM): Mede o quanto o retorno de um fundo se afasta do retorno de seu benchmark. Quanto mais próximo de zero maior a aderência dos retornos ao benchmark;

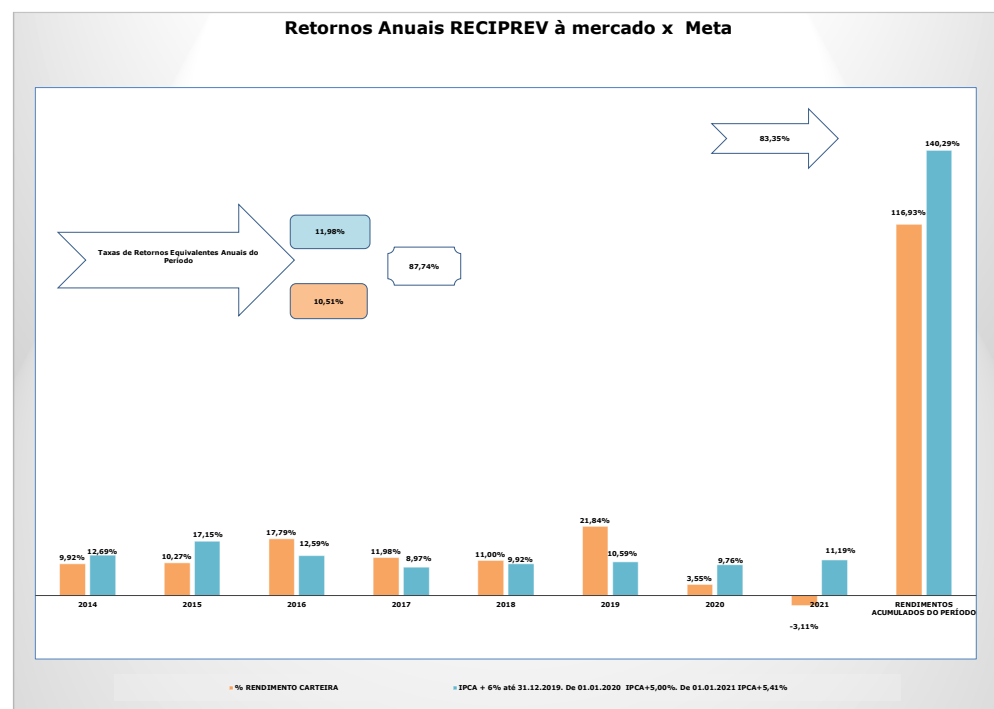
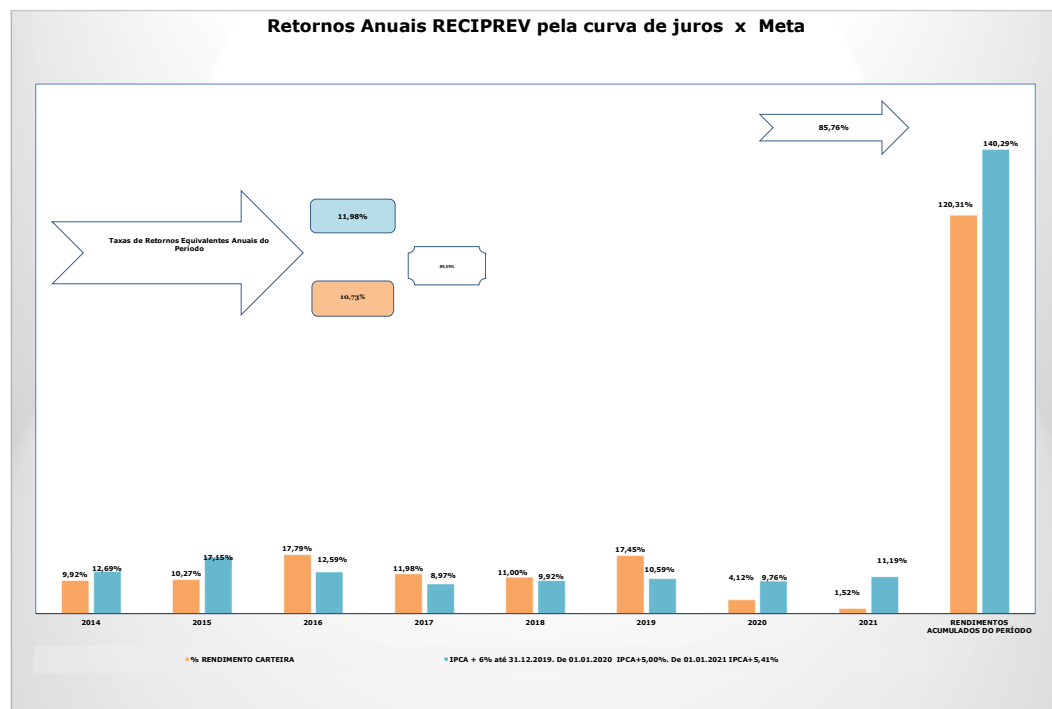
**EVOLUÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS E SUPERAVIT ATUARIAIS DA CARTERIA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV**



A redução do SUPERAVIT nos anos de 2020 e 2021, são decorrentes dos seguintes fatores:

- Taxa de Juros 2020: Meta Atuarial 5,87% ao ano + IPCA e 2021: Meta Atuarial 5,41% ao ano;
- Estimativa Tempo Anterior - Início das atividade aos 25 anos;
- Tábuas Biométricas;
- NTN-B 2045 da carteira marcada pela curva de juros e não à mercado.
- Aliquota abaixo de 14%

**RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV: 2014 À 2020**



**RESUMOS OPERACIONAIS - QUANTIDADES APROXIMADAS: 2014 À 2021**

Ano	Quantidade de Reuniões do Comitê de Investimentos (Atas)	Quantidade de Autorizações de Aplicações e Resgates - APR	Quantidade de Atestados de Compatibilidades de Investimentos de Longo Prazo	Quantidade de Decisões de Investimentos (Aplicações e Resgates)
2013	10	100	6	181
2014	12	175	20	278
2015	13	161	10	261
2016	12	167	3	323
2017	14	187	1	365
2018	13	298	0	461
2019	14	267	0	386
2020	14	208	0	293
2021	10	151	4	196
<b>TOTAIS</b>	<b>112</b>	<b>1.714</b>	<b>44</b>	<b>2.744</b>

## EQUIPE DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

## PANORAMA MACROECONÔMICO

0

## DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

IPCA do mês de	SETEMBRO	0,00%	Meta Atuarial para o Ano de 2021			IPCA + 5,41% ao ano
Meta Atuarial para o mês de	SETEMBRO	0,00%	Meta Atuarial acumulada no ano de 2021			0,00%
Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em	SETEMBRO	0,00%	Renda Fixa	0,00%	Renda Variável	0,00%
Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2021		0,00%	Percentual de atingimento da meta atuarial acumulada no ano de 2021			0,00%

Sendo

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

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

Marco Aurélio Correia Pinheiro

Chefe de Divisão de Investimentos

Gustavo Lins Dourado

Equipe Investimentos

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

Concordamos com as informações do presente relatório.

Manoel Carneiro Soares Cardoso

Diretor Presidente

Francisco Canindé Antunes Furtado Junior

Diretor Vice-Presidente

José Marcos Alves de Barros

Gerente de Investimentos

Marco Aurélio Correia Pinheiro

Chefe de Divisão de Investimentos

Gustavo Lins Dourado

Equipe Investimentos

José Ricardo Wanderlei Dantas de Oliveira

Representante Suplente da Secretaria de Finanças da Prefeitura do Recife

Sávio Tostes Barroso E Roberto Wagner Martins

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

Originais assinados e arquivados na Reciprev

Recife (PE), 08 DE OUTUBRO DE 2021

ASSINATURAS