

Relatório Mensal de Investimentos

Portaria MPS N° 1.467/2022 (Por ser acumulado do ano em curso contempla os relatórios trimestrais)



Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores
Relatório mensal e acumulado anual da Carteira de Investimentos RECIPREV

Data da Posição: 29/09/2023

| Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores) | | | |
|--|---------------------------------------|-----------------------------|----------------|
| Renda Fixa | | | |
| TESOURO NACIONAL | MARCADO NA CURVA | R\$ 1.877.290.313,31 | 60,64% |
| BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | LETRAS FINANCEIRAS - MARCADO NA CURVA | R\$ 298.000.160,44 | 9,63% |
| CAIXA DTVM S/A | | R\$ 85.959.410,52 | 2,78% |
| BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A. | | R\$ 75.483.288,27 | 2,44% |
| BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | | R\$ 54.923.473,01 | 1,77% |
| XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA | | R\$ 34.568.075,75 | 1,12% |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT | | R\$ 23.965.527,98 | 0,77% |
| ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA | | R\$ 23.640.009,41 | 0,76% |
| MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA | | R\$ 13.426.374,66 | 0,43% |
| SOMMA INVESTIMENTOS S/A | | R\$ 7.130.967,96 | 0,23% |
| BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO) | | R\$ 768.474,12 | 0,02% |
| SINGULARE CTVM S.A. | | R\$ 21.812,97 | 0,00% |
| TOTAL RF | | R\$ 2.495.177.888,39 | 80,60% |
| Renda Variável | | | |
| VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS) | | R\$ 124.383.397,05 | 4,02% |
| BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | | R\$ 81.953.015,71 | 2,65% |
| CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA | | R\$ 77.735.847,45 | 2,51% |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA | | R\$ 56.151.664,42 | 1,81% |
| BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO) | | R\$ 44.587.461,54 | 1,44% |
| CAIXA DTVM S/A | | R\$ 41.802.434,09 | 1,35% |
| BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL (GRUPO BNP) | | R\$ 35.427.053,67 | 1,14% |
| OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA | | R\$ 34.616.916,77 | 1,12% |
| SOMMA INVESTIMENTOS S/A | | R\$ 32.781.730,69 | 1,06% |
| XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA | | R\$ 27.038.612,37 | 0,87% |
| FINACAP INVESTIMENTOS LTDA | | R\$ 23.557.870,14 | 0,76% |
| SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | | R\$ 11.815.082,02 | 0,38% |
| TOTAL RV | | R\$ 591.851.085,93 | 19,12% |
| Fundos Estruturados | | | |
| QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA | | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% |
| TOTAL ESTRUTURADOS | | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% |
| Fundos Imobiliários | | | |
| SINGULARE CTVM S.A. | | R\$ 1.630.904,69 | 0,05% |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA | | R\$ 853.390,45 | 0,03% |
| TOTAL IMOBILIÁRIO | | R\$ 2.484.295,13 | 0,08% |
| SALDO CONTA CORRENTE | | R\$ 2,00 | 0,00% |
| PATRIMÔNIO | | R\$ 3.095.682.326,43 | 100,00% |

| Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores) | | | |
|--|--|-----------------------------|----------------|
| Renda Fixa | | | |
| TESOURO NACIONAL | | R\$ 1.877.290.313,31 | 60,64% |
| BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | | R\$ 298.768.634,56 | 9,65% |
| SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM | | R\$ 110.051.364,02 | 3,55% |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | R\$ 85.959.410,52 | 2,78% |
| BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | | R\$ 54.923.473,01 | 1,77% |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. | | R\$ 23.965.527,98 | 0,77% |
| ITAU UNIBANCO S.A. | | R\$ 23.640.009,41 | 0,76% |
| BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | | R\$ 20.557.342,62 | 0,66% |
| SINGULARE CTVM S.A. | | R\$ 21.812,97 | 0,00% |
| TOTAL RF | | R\$ 2.495.177.888,39 | 80,60% |
| Renda Variável | | | |
| BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | | R\$ 325.938.186,28 | 10,53% |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | R\$ 121.494.217,90 | 3,92% |
| BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | | R\$ 81.953.015,71 | 2,65% |
| BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP) | | R\$ 35.427.053,67 | 1,14% |
| SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM | | R\$ 27.038.612,37 | 0,87% |
| TOTAL RV | | R\$ 591.851.085,93 | 19,12% |
| Fundos Estruturados | | | |
| BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% |
| TOTAL ESTRUTURADOS | | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% |
| Fundos Imobiliários | | | |
| SINGULARE CTVM S.A. | | R\$ 1.630.904,69 | 0,05% |
| BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | | R\$ 853.390,45 | 0,03% |
| TOTAL IMOBILIÁRIO | | R\$ 2.484.295,13 | 0,08% |
| SALDO CONTA CORRENTE | | R\$ 2,00 | 0,00% |
| PATRIMÔNIO | | R\$ 3.095.682.326,43 | 100,00% |

| RESUMO GERAL POR ADMINISTRADOR DE RECURSOS | | | |
|--|--|-----------------------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL | | R\$ 1.877.290.313,31 | 60,64% |
| BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | | R\$ 648.672.348,82 | 20,95% |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | R\$ 207.453.628,42 | 6,70% |
| BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | | R\$ 137.729.879,17 | 4,45% |
| SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM | | R\$ 137.089.976,39 | 4,43% |
| BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP) | | R\$ 35.427.053,67 | 1,14% |
| BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | | R\$ 20.557.342,62 | 0,66% |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. | | R\$ 23.640.009,41 | 0,76% |
| BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% |
| SINGULARE CTVM S.A. | | R\$ 1.652.717,65 | 0,05% |
| TOTAL | | R\$ 3.095.682.326,43 | 100,00% |

ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

| 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 4.963/21 | Classificação do Risco do Fundo |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------|--|-------------------|---------------|------------|--------------------|--------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|--|---------------------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | BB DTYM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | BB DTYM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | 1,00% | CDI | Não possui | 0,25% | 0,23% | R\$ 7.727.694,54 | 13.077.415/0001-05 | 0,90% | 9,12% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, "a" | Risco Muito Alto |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO | BB DTYM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | BB DTYM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | 0,20% | IPCA + 6,00% | Não possui | 0,55% | 9,05% | R\$ 17.058.663,36 | 19.303.795/0001-35 | 1,09% | 8,79% | Longo Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Muito Alto |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO | BB DTYM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | BB DTYM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | 0,20% | IMA-B | Não possui | 0,36% | 10,61% | R\$ 11.101.487,29 | 19.523.306/0001-50 | 1,09% | 8,78% | Médio Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Alto |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | BB DTYM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | BB DTYM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | 0,20% | IDKA IPCA 2A | Não possui | 0,61% | 0,31% | R\$ 19.035.627,83 | 13.322.205/0001-35 | 0,21% | 8,59% | Curto Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Muito Baixo |
| BNB SOBERANO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA | BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A. | SANTANDER CACEIS BRASIL DTYM | 0,20% | CDI | Não possui | 2,44% | 4,34% | R\$ 75.483.288,27 | 30.568.193/0001-42 | 0,99% | 9,90% | Curto Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Muito Baixo |
| SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | SOMMA INVESTIMENTOS S/A | BEM - DTYM LTDA (GRUPO BRADESCO) | 0,50% | CDI | Não possui | 0,23% | 3,45% | R\$ 7.130.967,96 | 28.206.220/0001-95 | 1,26% | 7,99% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V, "b" | Risco Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | BRAM - DTYM (GRUPO BRADESCO) | BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | 1,50% | CDI | Não possui | 0,02% | 0,04% | R\$ 768.474,12 | 13.397.466/0001-14 | 0,81% | 8,24% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, "a" | Risco Muito Baixo |
| LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO LF00220095R (1288237000000002688) | BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | 0,00% | IPCA+6,71% | Não possui | 6,73% | - | R\$ 208.340.704,12 | 00.066.670/0001-00 | 0,74% | 8,99% | Médio Prazo | Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras - Art. 7º, IV | Risco Muito Baixo |
| LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO LF0022001E1 (1288237000000003145) | BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | 0,00% | IPCA+6,60% | Não possui | 2,90% | - | R\$ 89.659.456,32 | 00.066.670/0001-00 | 0,75% | 8,89% | Médio Prazo | Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras - Art. 7º, IV | Risco Muito Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CAIXA DTYM S/A | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,20% | IMA-B | Não possui | 0,89% | 5,61% | R\$ 27.423.872,85 | 18.598.288/0001-03 | 1,10% | 8,79% | Médio Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CAIXA DTYM S/A | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,20% | IMA-B | Não possui | 1,07% | 0,87% | R\$ 33.023.580,20 | 20.139.595/0001-78 | 1,10% | 8,80% | Médio Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CAIXA DTYM S/A | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,20% | IMA-B | Não possui | 0,24% | 0,78% | R\$ 7.466.930,16 | 19.769.046/0001-06 | -1,21% | 10,94% | Longo Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CAIXA DTYM S/A | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,20% | IMA-B | Não possui | 0,38% | 5,06% | R\$ 11.799.525,08 | 20.139.534/0001-00 | -1,22% | 10,92% | Longo Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Médio |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | CAIXA DTYM S/A | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,20% | IDKA IPCA 2A | Não possui | 0,18% | 0,11% | R\$ 5.689.354,17 | 14.386.926/0001-71 | 0,36% | 8,41% | Curto Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Médio |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | CAIXA DTYM S/A | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 0,80% | Não Possui | Não possui | 0,02% | 0,06% | R\$ 556.148,06 | 14.508.643/0001-55 | 0,90% | 4,79% | Curto Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Muito Baixo |
| XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO | XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA | SANTANDER CACEIS BRASIL DTYM | 0,50% | IPCA | Não possui | 1,12% | 10,97% | R\$ 34.568.075,75 | 14.146.491/0001-98 | -0,49% | 6,94% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, "a" | Risco Alto |

| Nome do Fundo | Gestor | Administrador | Taxa de Administração Anual (%) | Benchmark (Índice de Referência anual) | Taxa Performance* | % PL RECIPIV | % PL Fundo | | Valor (R\$) | CNPJ | Rentabilidade do Produto (mensal) | Rentabilidade do Produto (anual) | Prazo de Liquidação | Artigo da Resolução 4.963/21 | Classificação do Risco do Fundo |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|--|-------------------|--------------|------------|-----|----------------|--------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|---|---------------------------------|
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES) | SINGLARE CTVM S.A. | SINGLARE CTVM S.A. | 0,20% | 125% do DI | Não possui | 0,00% | 14,22% | R\$ | 21.812,97 | 13.633.964/0001-19 | 79,98% | 102,93% | Médio Prazo | Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior - Art. 7º, V, "a" | Risco Muito Alto |
| MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO | MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA | BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | 0,50% | IMA-B | 0,2 | 0,43% | 5,87% | R\$ | 13.426.374,66 | 14.115.118/0001-70 | -0,96% | 10,68% | Curto Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | Risco Baixo |
| ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA | ITAU UNIBANCO S.A. | 0,50% | IMA-B | Não possui | 0,76% | 5,02% | R\$ | 23.640.009,41 | 05.073.656/0001-58 | -1,26% | 10,64% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, "a" | Risco Médio |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT | BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. | 0,10% | IMA-B5 | Não possui | 0,77% | 2,14% | R\$ | 23.965.527,98 | 13.455.117/0001-01 | 0,11% | 8,70% | Curto Prazo | Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b" | 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 | 1,23% | - | R\$ | 37.978.554,63 | | 0,79% | 9,17% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | 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 | 2,64% | - | R\$ | 81.650.327,05 | | 0,79% | 9,17% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | 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 | 1,33% | - | R\$ | 41.229.809,42 | | 0,73% | 8,61% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | 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 | 1,33% | - | R\$ | 41.189.221,59 | | 0,73% | 8,62% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759226) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,86% | Não possui | 1,57% | - | R\$ | 48.624.587,81 | | 0,63% | 7,54% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759225) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,86% | Não possui | 1,57% | - | R\$ | 48.624.587,81 | | 0,63% | 7,54% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759224) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,86% | Não possui | 1,57% | - | R\$ | 48.624.587,81 | | 0,63% | 7,54% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860603) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,94% | Não possui | 6,04% | - | R\$ | 186.871.156,76 | | 0,63% | 7,59% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860602) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,94% | Não possui | 0,75% | - | R\$ | 23.358.894,60 | | 0,63% | 7,59% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860600) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,94% | Não possui | 1,51% | - | R\$ | 46.717.789,19 | | 0,63% | 7,59% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15917043) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+5,00% | Não possui | 1,74% | - | R\$ | 53.848.586,69 | | 0,64% | 4,87% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |

| 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 4.963/21 | Classificação do Risco do Fundo |
|---|---|---|---------------------------------|--|-------------------|---------------|------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|---|---------------------------------|
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223138) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+5,265% | Não possui | 1,46% | - | R\$ 45.141.787,56 | | 0,66% | 4,99% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223139) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+5,265% | Não possui | 4,37% | - | R\$ 135.425.362,68 | | 0,66% | 4,99% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223140) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+5,265% | Não possui | 5,83% | - | R\$ 180.567.150,24 | | 0,66% | 4,99% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223141) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+5,270% | Não possui | 1,46% | | R\$ 45.118.114,79 | | 0,66% | 4,99% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 19447309) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+5,730% | Não possui | 3,65% | | R\$ 112.987.543,36 | | 0,69% | 5,21% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 37517319) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+5,775% | Não possui | 8,70% | | R\$ 269.337.782,38 | | 0,70% | 2,62% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836500) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,94% | Não possui | 1,51% | - | R\$ 46.717.789,19 | | 0,63% | 7,59% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836499) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,93% | Não possui | 4,53% | - | R\$ 140.302.369,26 | | 0,63% | 7,59% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786866) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,865% | Não possui | 3,14% | - | R\$ 97.189.724,20 | | 0,63% | 7,55% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786865) | TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | 0,00% | IPCA+4,865% | Não possui | 4,71% | - | R\$ 145.784.586,30 | | 0,63% | 7,55% | Longo Prazo | Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | Risco Muito Baixo |
| Renda Fixa | | | | | | 80,60% | | R\$ 2.495.177.888,39 | | | 0,64% | | | |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA | CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA | BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | 2,00% | IBOVESPA | 20,00% | 2,51% | 6,07% | R\$ 77.735.847,45 | 11.182.064/0001-77 | -1,00% | 6,85% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, "a" | Risco Alto |
| SOMMA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | SOMMA INVESTIMENTOS S/A | BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | 2,00% | IBOVESPA | 20,00% | 1,06% | 10,42% | R\$ 32.781.730,69 | 14.550.994/0001-24 | 0,73% | -0,37% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, "a" | 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) | 2,00% | Índice Small Cap | 20,00% | 1,81% | 7,12% | R\$ 56.151.664,42 | 11.392.165/0001-72 | -1,06% | 5,86% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, "a" | Risco Alto |
| FINACAP MAURITSSDAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | FINACAP INVESTIMENTOS LTDA | BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | 2,00% | IBOVESPA | 20,00% | 0,76% | 6,93% | R\$ 23.557.870,14 | 05.964.067/0001-60 | 0,04% | 9,55% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, "a" | 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% | 0,45% | 6,87% | R\$ 14.030.168,28 | 12.239.939/0001-92 | -0,68% | 4,17% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, "a" | Risco Alto |

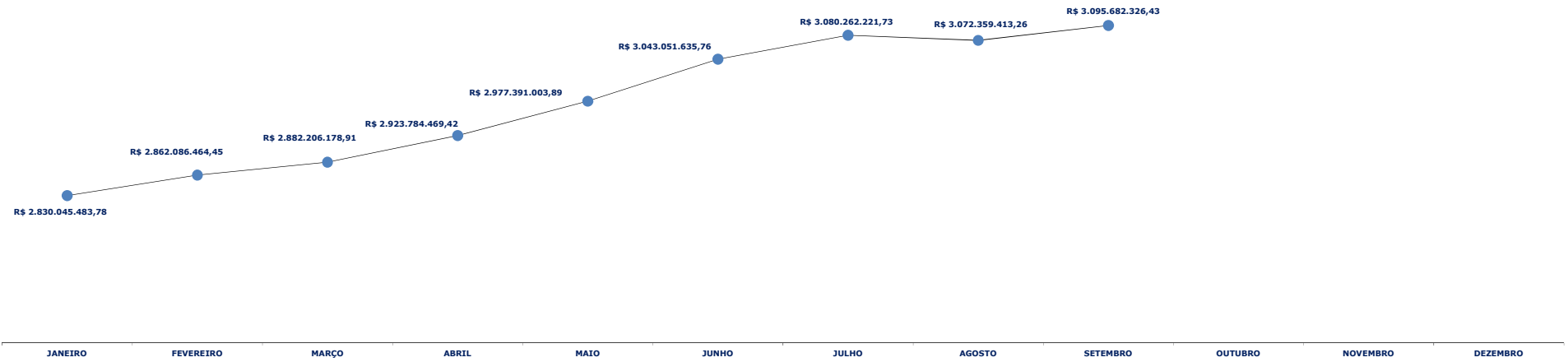
| Nome do Fundo | Gestor | Administrador | Taxa de Administração Anual (%) | Benchmark (Índice de Referência anual) | Taxa Performance* | % PL RECIPIV | % PL Fundo | Valor (R\$) | CNPJ | Rentabilidade do Produto (mensal) | Rentabilidade do Produto (anual) | Prazo de Liquidação | Artigo da Resolução 4.963/21 | Classificação do Risco do Fundo |
|---|--|---|---------------------------------|--|-------------------|--------------|------------|----------------------|--------------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|---|---------------------------------|
| 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% | 0,69% | 8,28% | R\$ 21.396.885,39 | 11.108.013/0001-03 | -3,13% | 4,37% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a" | Risco Alto |
| BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | 2,00% | IBOVESPA | 20,00% | 2,65% | 6,07% | R\$ 81.953.015,71 | 07.882.792/0001-14 | 0,47% | 4,43% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a" | Risco Alto |
| XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES | XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA | SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM | 3,00% | Sem benchmark | Não possui | 0,87% | 7,98% | R\$ 27.038.612,37 | 16.575.255/0001-12 | 1,24% | 10,47% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a" | Risco Alto |
| BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES MID SMALL CAPS | BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO) | BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | 1,50% | IBRX | Não possui | 1,44% | 6,57% | R\$ 44.587.461,54 | 06.988.623/0001-09 | -2,47% | -6,15% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a" | Risco Alto |
| OCCAM FIC FIA | OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA | BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | 2,00% | IBOVESPA | 0,2 | 1,12% | 4,47% | R\$ 34.616.916,77 | 11.628.883/0001.03 | 0,79% | 2,14% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a" | Risco Alto |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR | CAIXA DTVM S/A | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 1,50% | IBOVESPA | Não possui | 1,35% | 6,65% | R\$ 41.802.434,09 | 30.068.224/0001-04 | -0,01% | 6,08% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a" | 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% | 2,57% | 8,46% | R\$ 79.691.783,81 | 15.154.441/0001-15 | 0,54% | 9,82% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a" | Risco Alto |
| SUL AMERICA SELECTION FIC FIA | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO) | 2,00% | IVBX-2 | 20,00% | 0,38% | 6,53% | R\$ 11.815.082,02 | 34.525.068/0001-06 | -4,43% | 1,34% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a" | 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% | 1,44% | 9,05% | R\$ 44.691.613,23 | 07.488.106/0001-25 | 0,08% | 5,93% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a" | Risco Muito Alto |
| Renda Variável | | | | | | 19,12% | | R\$ 591.851.085,93 | | | -0,36% | | | |
| Exterior | | | | | | 0,00% | | R\$ - | | | 0,00% | | | |
| BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA | QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA | BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | 1,50% | IPCA+9,00% | Não possui | 0,20% | 4,55% | R\$ 6.169.054,97 | 12.312.767/0001-35 | -0,03% | -0,05% | Curto Prazo | Fundos de Investimento em Participações (FIP) - Art. 10, II | Risco Muito Alto |
| Fundos Estruturados | | | | | | 0,20% | | R\$ 6.169.054,97 | | | -0,03% | | | |
| SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO | SINGULARE CTVM S.A. | SINGULARE CTVM S.A. | 1,36% | IPCA+7,50% | 20,00% | 0,05% | 21,31% | R\$ 1.630.904,69 | 16.841.067/0001-99 | -1,75% | 10,81% | Médio Prazo | Fundos de Investimento Imobiliário (FII) - Art. 11 | Risco Médio |
| 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% | 0,03% | 4,83% | R\$ 853.390,45 | 20.716.161/0001-93 | 58,23% | 1,32% | Médio Prazo | Fundos de Investimento Imobiliário (FII) - Art. 11 | Risco Médio |
| Fundos Imobiliários | | | | | | 0,08% | | R\$ 2.484.295,13 | | | 19,11% | | | |
| Empréstimos Consignados | | | | | | 0,00% | | R\$ - | | | 0,00% | | | |
| Saldo Conta Corrente | | | | | | 0,00% | | R\$ 2,00 | | | | | | |
| Total Geral | | | | | | 100,00% | | R\$ 3.095.682.326,43 | | Rentabilidade Reciprev | 0,47% | | | |

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

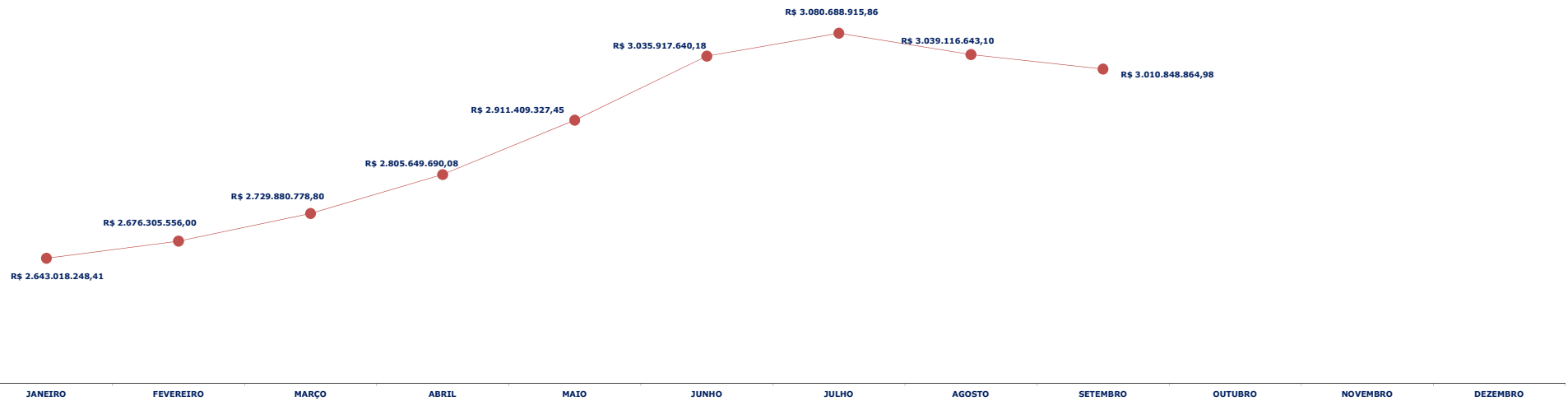
* A partir de 01/01/2019, os títulos públicos do Tesouro Nacional em posse do Fundo Previdenciário RECIPIV: TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS COM VENCIMENTO EM 15/05/2045 (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219; TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220; TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 e TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571, passaram a ser marcados pela "CURVA DE JUROS", de aquisição dos títulos, respectivamente: IPCA+7.002299%; IPCA+7.002655%; IPCA+6.261127% e IPCA+6.269771%, conforme definido na Política de Investimentos de 2019 e em conformidade com as normas da Secretaria de Previdência (Portaria nº 577, de 27 de dezembro de 2017 e Portaria SPREV nº 4, de 05 de fevereiro de 2018). Como os títulos são de longo prazo e com expectativa de se levar ao vencimento final, com a marcação pela curva de juros, evitaremos a volatilidade dos mesmos. O total dos referidos títulos em 31/12/2018, apresentavam "valor de mercado" já que eram "marcados à mercado", o valor de R\$ 187.984.960,92. Com a mudança de metodologia, passando a ser usada marcação pela "curva de juros", o valor dos mesmos no dia 01/01/2019, passou a valer R\$ 150.374.784,14, correspondente ao valor de aquisição atualizados pelas taxas de compra de cada um. Deste modo, apesar da redução do Patrimônio Líquido da carteira, no valor equivalente a diferença do preço à mercado e na curva de juros, reduzimos a volatilidade da carteira e utilizamos o valor real dos ativos até o seu vencimento, nesta data os preços à mercado e pela curva de juros se encontram. A partir de setembro de 2021, iniciamos a compra de NTN-B 2040 e 2045, com todas marcadas pela curva de juros.

| | |
|---|----------------------|
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2040 E 2045) / Marcação à Mercado | R\$ 1.792.456.851,86 |
| Preço da Carteira à Mercado | R\$ 3.010.848.864,98 |
| Provisão para perdas futuras de investimentos | R\$ 5.118.443,07 |

Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos na Curva RECIPREV 2023



Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos à Mercado RECIPREV 2023



RESUMO POR ADMINISTRADOR/GRUPO ECONÔMICO

| ADMINISTRADORES DE RECURSOS | GRUPO ECONÔMICO DO ADMINISTRADOR DE RECURSOS | GESTORES DE RECURSOS | VALOR | % CARTEIRA | |
|---|---|--|----------------------|----------------------|---------|
|  |  | GESTOR | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | R\$ 136.876.488,72 | 4,42% | |
| | | RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 853.390,45 | 0,03% | |
| | | TOTAL | R\$ 137.729.879,17 | 4,45% | |
|  |  | GESTOR | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | CAIXA DTVM S/A | R\$ 127.761.844,61 | 4,13% | |
| | | VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS) | R\$ 79.691.783,81 | 2,57% | |
| | | TOTAL | R\$ 207.453.628,42 | 6,70% | |
|  |  | CUSTODIA | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | TESOURO NACIONAL - Valor na Curva | R\$ 1.877.290.313,31 | 60,64% | |
| | | TESOURO NACIONAL - Valor à Mercado | R\$ 1.792.456.851,86 | 59,53% | |
| | | TOTAL | R\$ 3.669.747.165,17 | 120,18% | |
|  |  | GESTOR | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO) | R\$ 768.474,12 | 0,02% | |
| | | BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | R\$ 298.000.160,44 | 9,63% | |
| | | TOTAL | R\$ 298.768.634,56 | 9,65% | |
|  |  | GESTOR | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO) | R\$ 44.587.461,54 | 1,44% | |
| | | CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 77.735.847,45 | 2,51% | |
| | | SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | R\$ 11.815.082,02 | 0,38% | |
| | | VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS) | R\$ 44.691.613,23 | 1,44% | |
| | | MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 13.426.374,66 | 0,43% | |
| | | AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 56.151.664,42 | 1,81% | |
| | | SOMMA INVESTIMENTOS S/A | R\$ 39.912.698,65 | 1,29% | |
| | | OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA | R\$ 34.616.916,77 | 1,12% | |
| | | FINACAP INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 23.557.870,14 | 0,76% | |
| TOTAL | R\$ 346.495.528,90 | 11,19% | | | |
|  |  | GESTOR | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A. | R\$ 75.483.288,27 | 2,44% | |
| | | XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA | R\$ 27.038.612,37 | 0,87% | |
| | | XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA | R\$ 34.568.075,75 | 1,12% | |
| | | SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT | R\$ 23.965.527,98 | 0,77% | |
| | | TOTAL | R\$ 161.055.504,37 | 5,20% | |
|  |  | GESTOR | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA | R\$ 23.640.009,41 | 0,76% | |
| | | TOTAL | R\$ 23.640.009,41 | 0,76% | |
|  |  | GESTOR | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% | |
| | | TOTAL | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% | |
|  |  | GESTOR | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL (GRUPO BNP) | R\$ 35.427.053,67 | 1,14% | |
| | | TOTAL | R\$ 35.427.053,67 | 1,14% | |
|  |  | GESTOR | VALOR | % CARTEIRA | |
| | | SINGULARE CTVM S.A. | R\$ 1.652.717,65 | 0,05% | |
| | | TOTAL | R\$ 1.652.717,65 | 0,05% | |
|  |  | TOTAL GERAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV | Na Curva | R\$ 3.095.682.324,43 | 100,00% |
| | | | À Mercado | R\$ 3.010.848.862,98 | |

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV - 2023

| PRAZOS DE LIQUIDAÇÃO DA CARTEIRA | | | | | | | | | | | | |
|----------------------------------|------------|-------------------------|----------------|-----------------------|------------|--------------|-------------------------|-------------|---------------------|--------------|-------------------------|----------------|
| CARTEIRA GERAL | RENDA FIXA | | RENDA VARIÁVEL | | EXTERIOR | ESTRUTURADOS | IMOBILIÁRIOS | CONSIGNADOS | TOTAL | | | |
| CURTO PRAZO (Até 60 dias) | R\$ | 211.991.542,74 | R\$ | 591.851.085,93 | R\$ | - | R\$ 6.169.054,97 | R\$ | - | R\$ - | 810.011.683,65 | 26,17% |
| MÉDIO PRAZO (Até 5 anos) | R\$ | 369.570.913,75 | R\$ | - | R\$ | - | R\$ 2.484.295,13 | R\$ | - | R\$ - | 372.055.208,88 | 12,02% |
| LONGO PRAZO (+ de 5 anos) | R\$ | 1.913.615.431,91 | R\$ | - | R\$ | - | R\$ - | R\$ | - | R\$ - | 1.913.615.431,91 | 61,82% |
| TOTAL | R\$ | 2.495.177.888,39 | R\$ | 591.851.085,93 | R\$ | - | R\$ 6.169.054,97 | R\$ | 2.484.295,13 | R\$ - | 3.095.682.324,43 | 100,00% |

| COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DA CARTEIRA - ÍNDICES | | |
|--|-----------------------------|----------------|
| ÍNDICE | VALOR | % |
| IPCA+ACIMA DA META | R\$ 2.235.570.562,96 | 72,22% |
| IBOVESPA | R\$ 351.169.596,38 | 11,34% |
| IMA-B | R\$ 127.881.779,64 | 4,13% |
| IDIV | R\$ 106.730.396,18 | 3,45% |
| CDI | R\$ 91.688.385,91 | 2,96% |
| SMALL CAPS | R\$ 77.548.549,81 | 2,51% |
| IBRX | R\$ 56.402.543,57 | 1,82% |
| IDKA IPCA 2A | R\$ 24.724.982,00 | 0,80% |
| IMA-B 5 | R\$ 23.965.527,98 | 0,77% |
| TOTAL | R\$ 3.095.682.324,43 | 100,00% |

| RENDA FIXA X RENDA VARIÁVEL X EXTERIOR X ESTRUTURADOS X IMOBILIÁRIOS X CONSIGNADOS | | |
|--|-----------------------------|----------------|
| | VALOR | % |
| RENDA FIXA | R\$ 2.495.177.888,39 | 80,60% |
| RENDA VARIÁVEL | R\$ 591.851.085,93 | 19,12% |
| EXTERIOR | R\$ - | 0,00% |
| ESTRUTURADOS | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% |
| IMOBILIÁRIOS | R\$ 2.484.295,13 | 0,08% |
| CONSIGNADOS | R\$ - | 0,00% |
| TOTAL | R\$ 3.095.682.324,43 | 100,00% |

| VOLATILIDADE DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS E TÍTULOS | | |
|--|-----------------------------|----------------|
| | VALOR | % |
| Volatilidade Muito Baixa | R\$ 2.271.134.012,03 | 73,36% |
| Volatilidade Alta | R\$ 442.909.273,59 | 14,31% |
| Volatilidade Muito Alta | R\$ 217.860.906,68 | 7,04% |
| Volatilidade Média | R\$ 135.493.094,98 | 4,38% |
| Volatilidade Baixa | R\$ 28.285.037,15 | 0,91% |
| TOTAL | R\$ 3.095.682.324,43 | 100,00% |

Posição dos Gestores e Administradores da Carteira de Investimentos RECIPREV 2023

| VOLUME DE APLICAÇÕES POR GESTOR | | | | |
|--|-----------------------------|----------------|---|-------|
| GESTOR | VALOR APLICADO | % CARTEIRA | % Máximo Permitido | % |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 56.151.664,42 | 1,81% | Máximo permitido 5,00% do volume de gestão ANBIM1 | 0,27% |
| BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | R\$ 136.876.488,72 | 4,42% | | 0,01% |
| BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A. | R\$ 75.483.288,27 | 2,44% | | 0,67% |
| BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP) | R\$ 35.427.053,67 | 1,14% | | 0,05% |
| BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO) | R\$ 45.355.935,66 | 1,47% | | 0,01% |
| BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | R\$ 298.000.160,44 | 9,63% | | 0,05% |
| CAIXA DTVM S/A | R\$ 127.761.844,61 | 4,13% | | 0,03% |
| CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 77.735.847,45 | 2,51% | | 4,27% |
| FINACAP INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 23.557.870,14 | 0,76% | | 2,34% |
| ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA | R\$ 23.640.009,41 | 0,76% | | 0,00% |
| ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA | R\$ - | 0,00% | | 0,00% |
| MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 13.426.374,66 | 0,43% | | 0,13% |
| OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA | R\$ 34.616.916,77 | 1,12% | | 0,60% |
| QUELZU GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% | | 0,62% |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA | R\$ 853.390,45 | 0,03% | | 0,01% |
| SINGULARE CTVM S.A. | R\$ 1.652.717,65 | 0,05% | | 0,03% |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT | R\$ 23.965.527,98 | 0,77% | | 0,01% |
| SOHMA INVESTIMENTOS S/A | R\$ 39.912.698,65 | 1,29% | | 0,35% |
| SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A. | R\$ 11.815.082,02 | 0,38% | | 0,03% |
| TESOURO NACIONAL | R\$ 1.877.290.313,31 | 60,64% | | 0,00% |
| VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS) | R\$ 124.383.397,05 | 4,02% | 0,25% | |
| XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA | R\$ 34.568.075,75 | 1,12% | 0,02% | |
| XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA | R\$ 27.038.612,37 | 0,87% | 0,02% | |
| TOTAL | R\$ 3.095.682.324,43 | 100,00% | | |

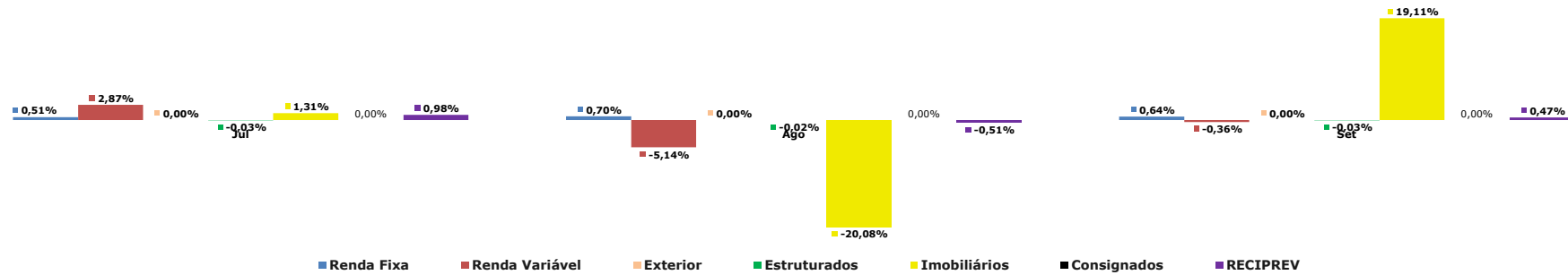
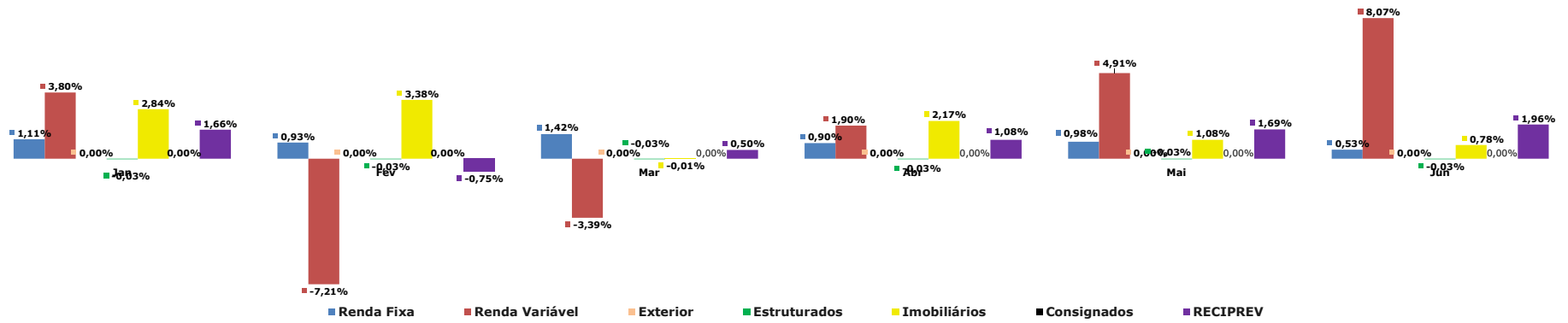
| VOLUME DE APLICAÇÕES POR ADMINISTRADOR | | | | | | |
|---|-----------------------------|----------------|--|--|-------------------------|---------------------|
| ADMINISTRADOR | VALOR APLICADO | % CARTEIRA | % Máximo Permitido | % Máximo Permitido | % do Total administrado | % Recursos com RPPS |
| BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP) | R\$ 35.427.053,67 | 1,14% | Máximo permitido 5,00% do volume de Administração ANBIMA | Máximo permitido de todos os RPPS 50,00% do volume de Administração ANBIMA | 0,04% | 1,50% |
| BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO) | R\$ 645.264.163,45 | 20,84% | | | 0,10% | 1,76% |
| BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | R\$ 137.729.879,17 | 4,45% | | | 0,01% | 5,54% |
| BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% | | | 0,00% | 0,06% |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | R\$ 207.453.628,42 | 6,70% | | | 0,03% | 12,07% |
| SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM | R\$ 137.089.976,39 | 4,43% | | | 0,03% | 0,88% |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. | R\$ 23.965.527,98 | 0,77% | | | 0,02% | 0,88% |
| ITAU UNIBANCO S.A. | R\$ 23.640.009,41 | 0,76% | | | 0,00% | 0,00% |
| SINGULARE CTVM S.A. | R\$ 1.652.717,65 | 0,05% | | | | |
| TESOURO NACIONAL | R\$ 1.877.290.313,31 | 0,05% | | | | |
| TOTAL | R\$ 3.095.682.324,43 | 100,00% | | | | |

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

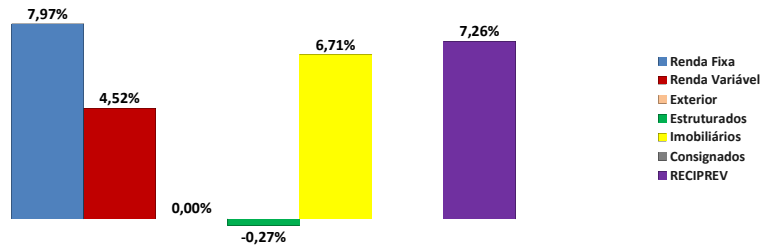
| SEGMENTO | Tipo de Ativo | Limite da Resolução CMN (%) | Posição Atual da Carteira (R\$) | Posição Atual da Carteira (%) | Estratégia de Alocação - Política de Investimento de 2023 | | | Meta de rentabilidade para o Exercício por tipo de Ativo |
|----------------------------|---|-----------------------------|---------------------------------|-------------------------------|---|---------------------|---------------------|--|
| | | | | | Limite Inferior (%) | Estratégia Alvo (%) | Limite Superior (%) | |
| Renda Fixa | Títulos Públicos de emissão do TN - Art. 7º, I, a | 100,00% | R\$ 1.877.290.313,31 | 60,64% | 50,00% | 52,32% | 100,00% | 10,86% |
| Renda Fixa | FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | 100,00% | R\$ 253.758.074,45 | 8,20% | 7,96% | 15,92% | 15,00% | 12,35% |
| Renda Fixa | ETF - 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, c | 100,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 11,91% |
| Renda Fixa | Operações compromissadas - Art. 7º, II | 5,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 12,47% |
| Renda Fixa | Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7, III, a | 60,00% | R\$ 58.976.559,27 | 1,91% | 0,73% | 1,45% | 3,00% | 11,00% |
| Renda Fixa | ETF - Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, b | 60,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 11,00% |
| Renda Fixa | Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras - Art. 7º, IV | 20,00% | R\$ 298.000.160,44 | 9,63% | 4,68% | 9,36% | 18,00% | 12,33% |
| Renda Fixa | Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior - Art. 7º, V, "a" | 5,00% | R\$ 21.812,97 | 0,00% | 0,05% | 0,10% | 15,00% | 11,00% |
| Renda Fixa | Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V, "b" | 5,00% | R\$ 7.130.967,96 | 0,23% | 0,00% | 1,17% | 0,00% | 11,00% |
| Renda Fixa | Fundos de debêntures de infraestrutura - Art. 7º, V, "c" | 5,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 11,00% |
| Renda Variável | Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, "a" | 30,00% | R\$ 591.851.085,93 | 19,12% | 9,68% | 19,36% | 25,00% | 11,00% |
| Renda Variável | Fundos de Investimento em Índices de Mercado (ETF) - Renda Variável - Art. 8º, I, "b" | 30,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 11,00% |
| Exterior | Fundos de Investimento em Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I | 10,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 6,12% |
| Exterior | Fundos de Investimento - Investimento no Exterior - Art. 9º, II | 10,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 6,12% |
| Exterior | Fundos de Investimento em Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III | 10,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,61% |
| Investimentos Estruturados | Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I | 10,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 11,00% |
| Investimentos Estruturados | Fundos de Investimento em Participações (FIP) - Art. 10, II | 5,00% | R\$ 6.169.054,97 | 0,20% | 0,11% | 0,21% | 1,00% | 11,00% |
| Investimentos Estruturados | Fundo de Investimento em Ações - Mercado de Acesso - Art. 10, III | 5,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 11,00% |
| Fundos Imobiliários | Fundos de Investimento Imobiliário (FII) - Art. 11 | 5,00% | R\$ 2.484.295,13 | 0,08% | 0,05% | 0,11% | 1,00% | 11,00% |
| Empréstimos Consignados | Empréstimos Consignados - sem certificação Pró-Gestão - Art. 12, I | 5,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Empréstimos Consignados | Empréstimos Consignados - com certificação Pró-Gestão - Art. 12, II | 10,00% | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 18,47% |
| Saldo Conta Corrente | | | R\$ 2,00 | 0,00% | | | | |
| TOTAL | | | R\$ 3.095.682.324,43 | 100,00% | | 100,00% | | |

| POLITICA 2023 | | | | | | | | | |
|--|--------------------------------|-----------------------------|---|-----------|---|---------------------|---------------------|----------------------------------|------------------------------|
| TIPOS DE ATIVOS | Artigo da Resolução 4.963/2021 | Limite da Resolução CMN (%) | Limites da Política Carteira RECIPEV 2023 | | Limites da Política Carteira RECIPEV 2023 | | | Carteira RECIPEV - Posição Atual | Diferença da Estratégia Alvo |
| | | | Política | Nível III | Limite Inferior (%) | Estratégia Alvo (%) | Limite Superior (%) | | |
| RENDA FIXA | | Limites 4.963/2021 | | | | | | | |
| Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional | Art. 7º, I, "a" | 100,00% | 100,00% | 100,00% | 50,00% | 52,32% | 100,00% | 60,64% | -8,32% |
| Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC | Art. 7º, I, "b" | 100,00% | 15,00% | 100,00% | 3,00% | 15,92% | 15,00% | 8,20% | 7,72% |
| Fundos de Investimento em Índices de Mercado (ETF) - 100% Títulos Públicos | Art. 7º, I, "c" | 100,00% | 0,00% | 100,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Operações compromissadas - 100% Títulos Públicos SELIC | Art. 7º, II | 5,00% | 0,00% | 15,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral | Art. 7º, III, "a" | 60,00% | 3,00% | 75,00% | 0,00% | 1,45% | 3,00% | 1,91% | -0,45% |
| Fundos de Investimentos em Índices de Mercado (ETF) | Art. 7º, III, "b" | 60,00% | 0,00% | 75,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras | Art. 7º, IV, "a" | 20,00% | 18,00% | 35,00% | 0,00% | 9,36% | 18,00% | 9,63% | -0,26% |
| Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior | Art. 7º, V, "a" | 5,00% | 0,10% | 15,00% | 0,00% | 0,10% | 0,10% | 0,00% | 0,10% |
| Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado | Art. 7º, V, "b" | 5,00% | 3,00% | 15,00% | 0,00% | 1,17% | 3,00% | 0,23% | 0,94% |
| Fundos de debêntures de infraestrutura | Art. 7º, V, "c" | 5,00% | 0,00% | 15,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| TOTAL RENDA FIXA | | | | | | 80,32% | | 80,60% | -0,28% |
| RENDA VARIÁVEL | Artigo da Resolução 4.963/2021 | Limites 4.963/2021 | Política | Nível III | | | | | |
| Fundos de Investimento em Ações | Art. 8º, I, "a" | 30,00% | 25,00% | 45,00% | 0,00% | 19,36% | 25,00% | 19,12% | 0,24% |
| Fundos de Investimento em Índices de Mercado (ETF) | Art. 8º, I, "b" | 30,00% | 25,00% | 45,00% | 0,00% | 0,00% | 25,00% | 0,00% | 0,00% |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | | | | | | 19,36% | | 19,12% | 0,24% |
| EXTERIOR | Artigo da Resolução 4.963/2021 | Limites 4.963/2021 | Política | Nível III | | | | | |
| FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa | Art. 9º, I | 10,00% | 10,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% |
| Fundos de Investimento - Investimento no Exterior | Art. 9º, II | 10,00% | 10,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% |
| Fundos de Investimento em Ações - BDR Nível I | Art. 9º, III | 10,00% | 10,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% |
| TOTAL EXTERIOR | | | | | | 0,00% | | 0,00% | 0,00% |
| FUNDOS ESTRUTURADOS | Artigo da Resolução 4.963/2021 | Limites 4.963/2021 | Política | Nível III | | | | | |
| Fundos de Investimento Multimercado (FIM) | Art. 8º, I, "a" | 45,00% | 25,00% | 45,00% | 0,00% | 0,00% | 25,00% | 0,00% | 0,00% |
| Fundos de Investimento em Participações (FIP) | Art. 8º, I, "b" | 45,00% | 25,00% | 45,00% | 0,00% | 0,21% | 25,00% | 0,20% | 0,01% |
| Fundo de Investimento em Ações - Mercado de Acesso | Art. 8º, II, "a" | 35,00% | 0,00% | 35,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS | | | | | | 0,21% | | 0,20% | 0,01% |
| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | Artigo da Resolução 4.963/2021 | Limites 4.963/2021 | Política | Nível III | | | | | |
| Fundos de Investimento Imobiliário (FII) | Art. 11 | 5,00% | 1,00% | 15,00% | 0,00% | 0,11% | 1,00% | 0,08% | 0,03% |
| TOTAL FUNDOS IMOBILIÁRIOS | | | | | | 0,11% | | 0,08% | 0,03% |
| EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS | Artigo da Resolução 4.963/2021 | Limites 4.963/2021 | Política | Nível III | | | | | |
| Empréstimos Consignados - sem certificação Pró-Gestão | Art. 12, I | 5,00% | 10,00% | 5,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% |
| Empréstimos Consignados - com certificação Pró-Gestão | Art. 12, II | 10,00% | 10,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% |
| TOTAL EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS | | | | | | 0,00% | | 0,00% | 0,00% |
| | | | | | | 100,00% | | 100,00% | |

Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2023



Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2023

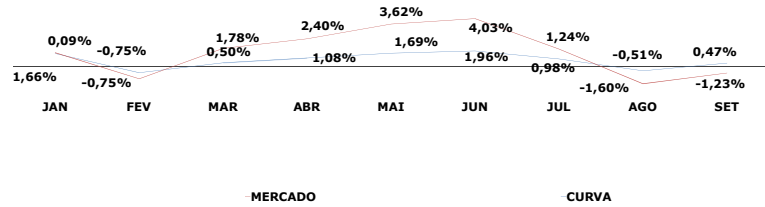


Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2023

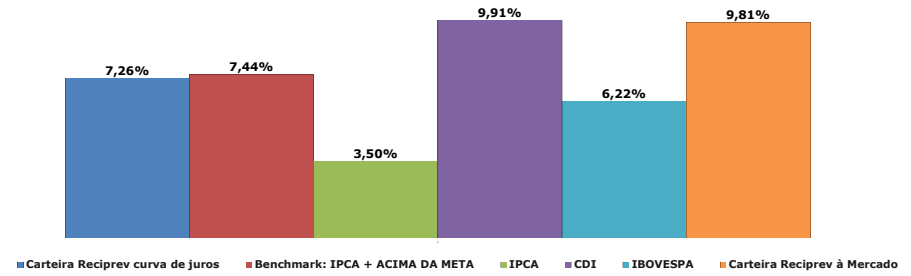
| | |
|---|--------|
| % Atingimento acumulado anual da meta na Curva | -0,18% |
| % Atingimento acumulado anual da meta à Mercado | 2,37% |

Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPEV - 2023

Rentabilidade Anual Acumulada no Período



ACUMULADO DE JANEIRO A DEZEMBRO 2023 - RENTABILIDADE DA CARTEIRA X ÍNDICES



RELATÓRIOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIFIN

Data da Posição: 29/09/2023

| 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\$ 51.570,84 | R\$ 1.215,30 |
| 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\$ 24.348,07 | R\$ 869.519,05 |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | CAIXA DTVM S/A | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | R\$ 4.334,57 | R\$ 3.744,47 |
| Saldo Conta Corrente | | | | R\$ 1,00 |
| Total Carteira RECIFIN | | | R\$ 80.253,48 | R\$ 874.479,82 |

RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

ANO 2023

| FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV - VALOR PELA CURVA DE JUROS | | | | |
|---|----------------------|-----------------------|--------------------------------|--|
| DATA | SALDO R\$ | RENDIMENTO R\$ | % RENDIMENTO CARTEIRA NA CURVA | |
| 31/01/2023 | R\$ 2.830.045.483,78 | R\$ 46.377.811,30 | 1,66% | |
| 28/02/2023 | R\$ 2.862.086.464,45 | R\$ 21.000.368,45 | -0,75% | |
| 31/03/2023 | R\$ 2.882.206.179,91 | R\$ 14.248.805,85 | 0,50% | |
| 30/04/2023 | R\$ 2.923.784.469,42 | R\$ 31.258.752,34 | 1,08% | |
| 31/05/2023 | R\$ 2.977.381.339,17 | R\$ 49.447.894,68 | 1,69% | |
| 30/06/2023 | R\$ 3.043.051.635,76 | R\$ 58.391.704,77 | 1,96% | |
| 31/07/2023 | R\$ 3.080.262.221,73 | R\$ 29.968.706,99 | 0,98% | |
| 31/08/2023 | R\$ 3.072.359.413,26 | R\$ 15.494.315,31 | -0,51% | |
| 30/09/2023 | R\$ 3.095.682.326,43 | R\$ 14.241.219,45 | 0,46% | |
| 31/10/2023 | R\$ - | R\$ - | 0,00% | |
| 30/11/2023 | R\$ - | R\$ - | 0,00% | |
| 31/12/2023 | R\$ - | R\$ - | 0,00% | |
| TOTAL | R\$ | 207.440.211,61 | 7,26% | |

| FUNDO FINANCEIRO RECIFIN | | | |
|--------------------------|----------------|---------------------|--|
| SALDO R\$ | RENDIMENTO R\$ | | |
| R\$ 792.564,70 | R\$ 16.230,60 | | |
| R\$ 20.234.580,88 | R\$ 127.051,65 | | |
| R\$ 20.155.709,71 | R\$ 293.072,46 | | |
| R\$ 10.476.898,10 | R\$ 218.253,31 | | |
| R\$ 2.975.173,05 | R\$ 188.025,13 | | |
| R\$ 165.409,44 | R\$ 63.387,55 | | |
| R\$ 532.326,92 | R\$ 83.163,38 | | |
| R\$ 839.751,48 | R\$ 99.456,46 | | |
| R\$ 874.478,82 | R\$ 80.253,48 | | |
| R\$ - | R\$ - | | |
| R\$ - | R\$ - | | |
| R\$ - | R\$ - | | |
| R\$ - | R\$ - | | |
| TOTAL | R\$ | 1.168.894,02 | |

| TOTAL FUNDOS: RECIPREV E RECIFIN | | | |
|----------------------------------|-------------------|-----------------------|--|
| SALDO R\$ | RENDIMENTO R\$ | | |
| R\$ 2.830.838.048,48 | R\$ 46.394.041,90 | | |
| R\$ 2.882.321.045,33 | R\$ 20.873.316,80 | | |
| R\$ 2.902.361.889,62 | R\$ 14.541.878,31 | | |
| R\$ 2.934.261.367,52 | R\$ 31.477.005,65 | | |
| R\$ 2.980.356.512,22 | R\$ 49.635.919,81 | | |
| R\$ 3.043.217.045,20 | R\$ 58.455.092,32 | | |
| R\$ 3.080.794.548,65 | R\$ 30.051.870,37 | | |
| R\$ 3.073.199.164,74 | R\$ 15.394.858,85 | | |
| R\$ 3.096.556.805,25 | R\$ 14.321.472,93 | | |
| R\$ - | R\$ - | | |
| R\$ - | R\$ - | | |
| R\$ - | R\$ - | | |
| R\$ - | R\$ - | | |
| TOTAL | R\$ | 208.609.105,63 | |

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 |
|---------------|--|----------------------------------|---|---------------------------|-----------------------------|--------------------------------|
| 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\$ 129.774.770,08 | R\$ 40.998.812,81 | R\$ 9.863.277,77 | 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\$ 257.800.116,83 | -R\$ 123.601.864,82 | R\$ 3.841.241,79 | R\$ 130.357.010,22 | R\$ 1.134.744,80 | R\$ 2.590.996.758,04 |
| 2022 | R\$ 264.939.322,77 | -R\$ 192.008.793,32 | R\$ 3.116.160,17 | R\$ 69.814.369,28 | R\$ 118.896.033,09 | R\$ 2.795.799.867,50 |
| 2023 | R\$ 242.917.433,94 | -R\$ 103.658.328,42 | R\$ 1.304.840,01 | R\$ 137.954.265,51 | R\$ 207.440.211,61 | R\$ 3.080.262.221,73 |
| TOTAIS | R\$ 1.923.789.354,86 | -R\$ 958.132.188,78 | R\$ 117.657.661,53 | R\$ 847.999.504,55 | R\$ 1.301.217.474,94 | |

GRÁFICO COMPARATIVO DA CARTEIRA RECIPREV

| DATA | % RENDIMENTO CARTEIRA NA CURVA | % RENDIMENTO CARTEIRA À MERCADO | IPCA | META | CDI | IMA-B | IBOVESPA | % CRESCIMENTO CARTEIRA NA CURVA | % CRESCIMENTO CARTEIRA À MERCADO |
|--------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 31/01/2023 | 1,66% | 0,09% | 0,53% | 0,95% | 1,12% | 0,60% | 3,37% | 1,22% | -0,37% |
| 28/02/2023 | -0,75% | -0,75% | 0,84% | 1,26% | 0,92% | 1,28% | 7,49% | 1,13% | 1,26% |
| 31/03/2023 | 0,50% | 1,78% | 0,71% | 1,13% | 1,12% | 2,66% | -2,91% | 0,70% | 2,00% |
| 30/04/2023 | 1,08% | 2,40% | 0,61% | 1,03% | 0,92% | 2,02% | 2,50% | 1,44% | 2,78% |
| 31/05/2023 | 1,69% | 3,62% | 0,23% | 0,65% | 1,12% | 2,53% | 3,74% | 1,83% | 3,72% |
| 30/06/2023 | 1,96% | 4,03% | -0,08% | 0,34% | 1,02% | 2,39% | 9,00% | 2,21% | 4,28% |
| 31/07/2023 | 0,98% | 1,24% | -0,12% | 0,54% | 1,07% | 0,81% | 3,22% | 1,22% | 1,47% |
| 31/08/2023 | -0,51% | -1,60% | 0,23% | 0,65% | 1,14% | -0,38% | -5,09% | -0,26% | -1,33% |
| 30/09/2023 | 0,46% | -1,23% | 0,26% | 0,66% | 0,92% | -0,95% | 0,71% | 0,76% | -0,95% |
| 31/10/2023 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| 30/11/2023 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| 31/12/2023 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| TOTAL | 7,26% | 9,81% | 3,50% | 7,44% | 9,81% | 10,77% | 23,42% | 10,73% | - |

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



FLUXO MENSAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

ANO 2023

| MÊS | SETEMBRO | | | | |
|--|----------|---------------|------------|----------------------|---------------------------|
| RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO | | COMPETÊNCIA | | VALOR | ACUMULADO ANUAL |
| PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL) | | Agosto/2023 | R\$ | 11.649.042,20 | R\$ 106.133.301,24 |
| PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL INATIVOS/PENSIONISTAS) | | Agosto/2024 | R\$ | 2.651.096,46 | R\$ 25.279.223,85 |
| PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR) | | Agosto/2025 | R\$ | 10.135.904,17 | R\$ 94.757.950,25 |
| PARCELAMENTO | | Parcela 33/60 | R\$ | 1.484.171,83 | R\$ 11.656.579,62 |
| COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA | | 09/2023 | R\$ | 828.288,16 | R\$ 3.787.149,11 |
| CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL) | | Agosto/2025 | R\$ | 81.604,83 | R\$ 635.814,40 |
| CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR) | | Agosto/2026 | R\$ | 71.672,99 | R\$ 576.781,81 |
| EMLURBE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL) | | Agosto/2027 | R\$ | 7.811,43 | R\$ 41.081,43 |
| EMLURBE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR) | | Agosto/2028 | R\$ | 6.860,74 | R\$ 49.552,23 |
| TOTAL | | | R\$ | 26.916.452,81 | R\$ 242.917.433,94 |

| RECEBIMENTOS DE TÍTULOS E ALGUNS FUNDOS DE INVESTIMENTOS | | | | VALOR | ACUMULADO ANUAL |
|--|--|--|------------|-----------------|---------------------------|
| BB RECEBIVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS) | | | R\$ | 5.000,00 | R\$ 70.500,00 |
| SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS) | | | R\$ | - | R\$ 193.350,23 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSECTORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES) - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - | R\$ - |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - | R\$ 27.827.038,36 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - | R\$ 982.658,12 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - | R\$ 639.856,85 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS) | | | R\$ | - | R\$ - |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219 | | | R\$ | - | R\$ 1.217.585,07 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220 | | | R\$ | - | R\$ 2.617.807,90 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 | | | R\$ | - | R\$ 1.217.585,07 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571 | | | R\$ | - | R\$ 1.217.585,07 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759224) | | | R\$ | - | R\$ 1.217.585,07 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759225) | | | R\$ | - | R\$ 1.217.585,07 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759226) | | | R\$ | - | R\$ 1.217.585,07 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786865) | | | R\$ | - | R\$ 3.652.755,21 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786866) | | | R\$ | - | R\$ 2.435.170,13 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836499) | | | R\$ | - | R\$ 7.237.596,54 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836500) | | | R\$ | - | R\$ 2.412.532,18 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860600) | | | R\$ | - | R\$ 2.412.532,18 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860602) | | | R\$ | - | R\$ 1.206.266,09 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860603) | | | R\$ | - | R\$ 9.650.128,72 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15917043) | | | R\$ | - | R\$ 2.798.537,33 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223138) | | | R\$ | - | R\$ 2.412.532,18 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223139) | | | R\$ | - | R\$ 7.237.596,54 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223140) | | | R\$ | - | R\$ 9.650.128,72 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223141) | | | R\$ | - | R\$ 2.412.532,18 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 19447309) | | | R\$ | - | R\$ 3.139.177,83 |
| TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 37517319) | | | R\$ | - | R\$ 7.680.503,48 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO) | | | R\$ | - | R\$ 1.496.353,97 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO) | | | R\$ | - | R\$ 1.816.204,74 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO) | | | R\$ | - | R\$ 415.697,46 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO) | | | R\$ | - | R\$ 621.222,12 |
| TOTAL | | | R\$ | 5.000,00 | R\$ 108.324.189,48 |

| FOLHA DE PAGAMENTO E CONSIGNAÇÕES | | | | VALOR | ACUMULADO ANUAL |
|---|--|--|------------|----------------------|----------------------------|
| FOLHA DE PAGAMENTO | | | R\$ | 13.486.812,39 | -R\$ 92.747.063,62 |
| CONSIGNAÇÕES | | | R\$ | 3.523.641,18 | -R\$ 12.052.461,00 |
| DEVOLUÇÕES DE FOLHA NÃO PROCESSADAS E DE CONSIGNAÇÕES | | | R\$ | 228.565,54 | R\$ 1.141.196,20 |
| TOTAL | | | R\$ | 17.239.019,11 | -R\$ 103.658.328,42 |

| PAGAMENTOS DIVERSOS | | | | VALOR | ACUMULADO ANUAL |
|---|--|--|------------|---------------------|--------------------------|
| TARIFA DE CORRETAGEM DE FUNDOS IMOLIÁRIOS | | | R\$ | - | R\$ - |
| SISTEMA QUANTUM | | | R\$ | 1.900,00 | -R\$ 13.300,00 |
| TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPREV | | | R\$ | 1.318.581,75 | -R\$ 1.291.540,01 |
| TOTAL | | | R\$ | 1.320.481,75 | -R\$ 1.304.840,01 |

CONCEITOS

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

**Período de análise: A partir de janeiro de 2011 até o mês deste relatório, ou considerando 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 RECIPIREV 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 BVM&F/Bovespa. Pelas características dos fundos imobiliários, alguns indicadores demonstrados nesta planilha podem não cumprir de forma correta sua função conceitual

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

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

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

»Benchmark: Indicador de retorno do fundo

»Retorno médio mensal: 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;

»Meta: Trata-se do comparativo do retorno do ativo em todo o período avaliado em relação ao retorno das metas de cada ano;

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

»Information Ration: Dado pela fórmula: (Retorno médio anual do ativo - Retorno médio anual do Benchmark) / Treck Erro. Portanto, quanto maior, melhor;

»Treck Error: Trata-se do desvio padrão das diferenças entre os retornos do ativo e o retorno do benchmark do referido ativo. Portanto, quanto mais próximo de zero, melhor;

»VAR 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 movimentou 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;

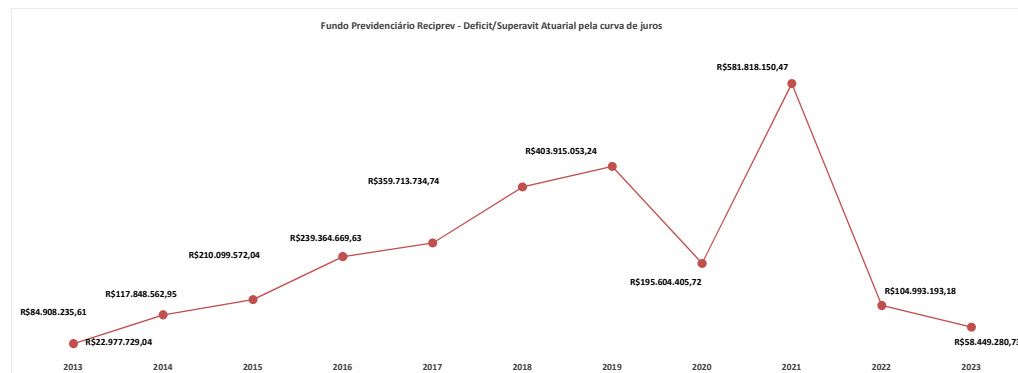
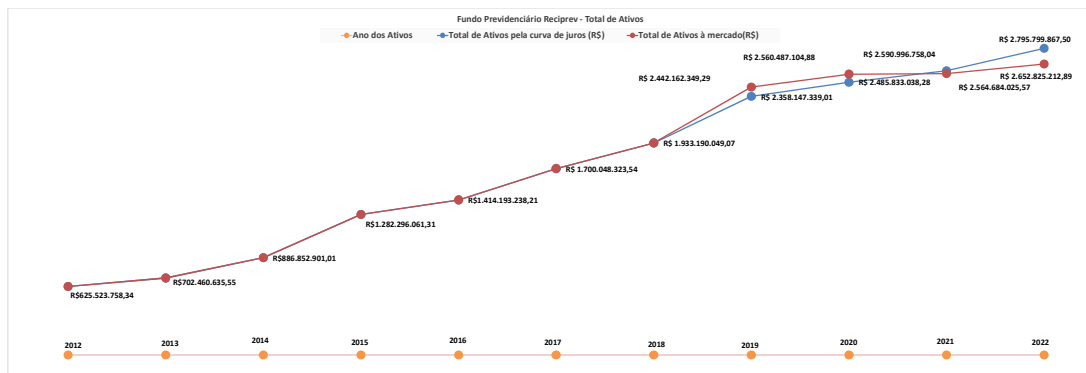
»Correlação Ibovespa: Correlação do ativo com o Ibovespa, ou seja, como o ativo se movimentou em relação ao comportamento do Ibovespa. Se igual ou próximo de zero, não há correlação. Se positiva, próxima de +1, têm mesmo sentido de movimento. Se negativa, próxima de -1, têm sentidos opostos de movimentos;

»Sharpe Modificado: Dado pela fórmula: (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;

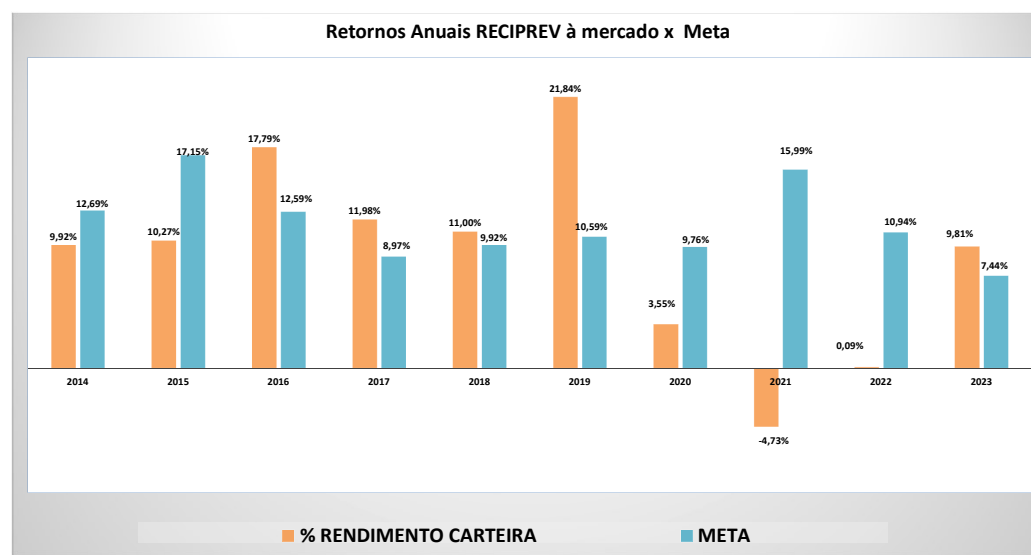
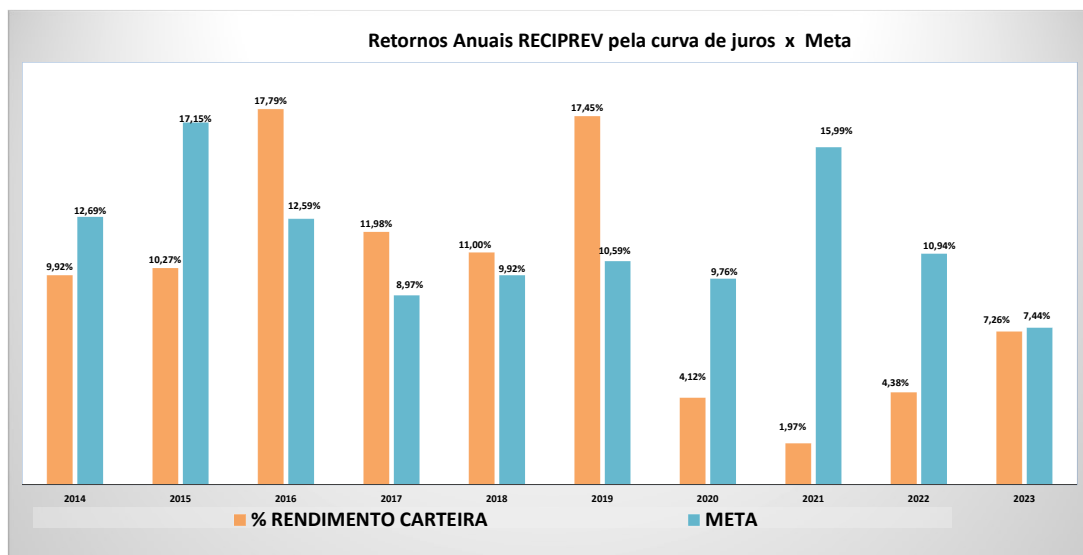
»Índice Beta: Indicador que mede a sensibilidade do ativo em relação a uma carteira, no caso foi considerado o benchmark de cada ativo. Ativos financeiros de Beta elevado são considerados mais agressivos, enquanto os de Beta mais baixo são mais conservadores;

»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



RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV: 2014 À 2023



RESUMOS OPERACIONAIS - QUANTIDADES APROXIMADAS: 2014 À 2023

| 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 | 12 | 202 | 5 | 263 |
| 2022 | 12 | 259 | 3 | 324 |
| 2023 | 8 | 139 | 1 | 177 |
| TOTAIS | 134 | 2.163 | 49 | 3.312 |

| DATA SOLICITAÇÃO DA OPERAÇÃO | DATA COTIZAÇÃO DA OPERAÇÃO | DATA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO | TIPO DE OPERAÇÃO | VALOR | APR | FUNDO | CNPJ |
|------------------------------|----------------------------|-----------------------------|------------------|-------------------|-------|---|--------------------|
| 11/08/2023 | 11/08/2023 | 09/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 5.189.211,52 | 142 A | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 11/08/2023 | 11/08/2023 | 10/08/2023 | RESGATE | R\$ 292.276,31 | 143 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 14/08/2023 | 14/08/2023 | 11/08/2023 | RESGATE | R\$ 10.000.000,00 | 144 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 14/08/2023 | 14/08/2023 | 11/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 10.310.387,28 | 145 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 15/08/2023 | 15/08/2023 | 14/08/2023 | RESGATE | R\$ 5.000,00 | 146 | BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO_FII | 20.716.161/0001-93 |
| 15/08/2023 | 15/08/2023 | 14/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 13.425.282,34 | 146 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 15/08/2023 | 15/08/2023 | 15/08/2023 | RESGATE | R\$ 497.277,41 | 147 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO | 19.303.795/0001-35 |
| 15/08/2023 | 15/08/2023 | 15/08/2023 | RESGATE | R\$ 323.802,14 | 147 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO | 19.523.306/0001-50 |
| 15/08/2023 | 15/08/2023 | 15/08/2023 | RESGATE | R\$ 31.682.839,92 | 147 | CUPONS DO TESOURO | |
| 16/08/2023 | 16/08/2023 | 15/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 32.659.889,78 | 147 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 16/08/2023 | 16/08/2023 | 15/08/2023 | RESGATE | R\$ 87.796,83 | 148 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 16/08/2023 | 16/08/2023 | 16/08/2023 | RESGATE | R\$ 708.326,60 | 149 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | 18.598.288/0001-03 |
| 16/08/2023 | 16/08/2023 | 16/08/2023 | RESGATE | R\$ 864.304,57 | 149 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | 20.139.595/0001-78 |
| 16/08/2023 | 16/08/2023 | 16/08/2023 | RESGATE | R\$ 193.473,54 | 149 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | 19.769.046/0001-06 |
| 16/08/2023 | 16/08/2023 | 16/08/2023 | RESGATE | R\$ 292.637,64 | 149 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | 20.139.534/0001-00 |
| 18/08/2023 | 18/08/2023 | 16/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 2.058.742,35 | 149 | CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 14.568.643/0001-55 |
| 21/08/2023 | 21/08/2023 | 18/08/2023 | RESGATE | R\$ 2.058.000,00 | 150 A | CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 14.568.643/0001-55 |
| 23/08/2023 | 23/08/2023 | 18/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 2.058.000,00 | 150 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 23/08/2023 | 23/08/2023 | 21/08/2023 | RESGATE | R\$ 1.331.249,00 | 151 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 23/08/2023 | 23/08/2023 | 23/08/2023 | RESGATE | R\$ 30.000.000,00 | 152 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 29/08/2023 | 29/08/2023 | 23/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 15.000.000,00 | 153 | ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 05.073.656/0001-58 |
| 29/08/2023 | 29/08/2023 | 23/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 15.000.000,00 | 154 | SANTANDER IMA-B S PREMIUM FIC RENDA FIXA | 13.455.117/0001-01 |
| 30/08/2023 | 30/08/2023 | 29/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 633.626,69 | 155 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 30/08/2023 | 30/08/2023 | 29/08/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 836.000,00 | 156 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 01/09/2023 | 01/09/2023 | 30/08/2023 | RESGATE | R\$ 6.375,76 | 157 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 01/09/2023 | 01/09/2023 | 30/08/2023 | RESGATE | R\$ 12.554.638,18 | 158 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 04/09/2023 | 04/09/2023 | 01/09/2023 | RESGATE | R\$ 2.996.614,59 | 159 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 05/09/2023 | 05/09/2023 | 01/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 1.917,97 | 159 A | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 06/09/2023 | 06/09/2023 | 04/09/2023 | RESGATE | R\$ 167.629,46 | 160 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 06/09/2023 | 06/09/2023 | 05/09/2023 | RESGATE | R\$ 16.191,74 | 161 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 06/09/2023 | 06/09/2023 | 06/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 6.866,74 | 162 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 06/09/2023 | 06/09/2023 | 06/09/2023 | RESGATE | R\$ 134.672,03 | 163 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 12/09/2023 | 12/09/2023 | 08/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 5.228.947,59 | 164 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 13/09/2023 | 13/09/2023 | 08/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 1.760,00 | 165 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 14/09/2023 | 14/09/2023 | 12/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 4.510.119,29 | 166 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 15/09/2023 | 15/09/2023 | 13/09/2023 | RESGATE | R\$ 87.270,84 | 167 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 15/09/2023 | 15/09/2023 | 14/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 14.685.950,58 | 168 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 19/09/2023 | 19/09/2023 | 15/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 159.730,85 | 169 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 19/09/2023 | 19/09/2023 | 15/09/2023 | RESGATE | R\$ 153.698,29 | 170 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 20/09/2023 | 20/09/2023 | 19/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 828.288,16 | 171 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 22/09/2023 | 22/09/2023 | 19/09/2023 | RESGATE | R\$ 1.319.678,97 | 172 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 25/09/2023 | 25/09/2023 | 20/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 1.318.581,75 | 173 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 25/09/2023 | 25/09/2023 | 22/09/2023 | RESGATE | R\$ 1.318.581,75 | 174 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 25/09/2023 | 25/09/2023 | 25/09/2023 | RESGATE | R\$ 18.000.000,00 | 175 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 26/09/2023 | 26/09/2023 | 25/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 9.000.000,00 | 176 | ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 05.073.656/0001-58 |
| 26/09/2023 | 26/09/2023 | 25/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 9.000.000,00 | 177 | SANTANDER IMA-B S PREMIUM FIC RENDA FIXA | 13.455.117/0001-01 |
| 27/09/2023 | 27/09/2023 | 26/09/2023 | RESGATE | R\$ 12.800.000,00 | 178 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |
| 28/09/2023 | 28/09/2023 | 26/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 12.800.000,00 | 179 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO | 13.397.466/0001-14 |
| 28/09/2023 | 28/09/2023 | 27/09/2023 | APLICAÇÃO | R\$ 618.501,20 | 180 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 |

PANORAMA MACROECONÔMICO

No mês de setembro, as curvas de juros continuaram o movimento de abertura, prejudicando o desempenho dos fundos de títulos públicos, principalmente os de vencimentos mais longos. Apesar da continuidade do ritmo de queda da taxa Selic, os desafios fiscais internos e, principalmente, a abertura da curva de juros longa nos EUA, continuam afetando os preços dos ativos no Brasil. O mercado de renda variável não foge à regra, o ajuste de qualquer fluxo de caixa a uma taxa mais elevada acaba influenciando bastante a decisão do investidor pelo ativo de risco. Com isso, apesar de um consenso de bolsa barata no Brasil, o Ibovespa não consegue deslanchar. Em setembro, o Índice teve retorno positivo, porém modesto, 0,71%.

DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

| Índice | Período | Resultado | Sendo | Meta Atuarial para o Ano de 2023 | | | IPCA + 5,1% ao ano | | |
|--|----------|-----------|-------|--|----------------|----------------|--------------------|-------------|-------|
| | | | | Renda Fixa | Renda Variável | Exterior | Consignados | Outros | |
| IPCA do mês de | SETEMBRO | 0,26% | | Meta Atuarial acumulada no ano de 2023 | | | 7,44% | | |
| Meta Atuarial para o mês de | SETEMBRO | 0,66% | | | | | | | |
| Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em | SETEMBRO | 0,46% | | | | | | | |
| Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2023 | | 7,26% | | | | | | | |
| Percentual de atingimento da meta atuarial acumulada no ano de 2023 | | 0,79% | | | | | | | |
| | | | | Renda Fixa | 0,64% | Renda Variável | -0,36% | Exterior | 0,00% |
| | | | | Estruturados | -0,03% | Imobiliários | 19,76% | Consignados | 0,00% |

A Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário Reciprev possui a maior parte de seus recursos aplicados em TPF e Letras Financeiras marcados pela curva de juros. Possui, ainda, valores significativos aplicados em Renda Variável.

Este é o relatório mensal da Carteira de Investimentos do Fundo Previdência Reciprev em conformidade com a Portaria MPS Nº 1.467/2022, 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.

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Gerente Geral 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.

Marconi Muzzio Pires de Paiva Filho
Diretor Presidente

Francisco Canindé Antunes Furtado Junior
Diretor Vice-Presidente

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Gerente Geral de Investimentos

Marco Aurélio Correia Pinheiro
Chefe de Divisão de Investimentos

Gustavo Lins Dourado
Equipe Investimentos

José Ricardo Wanderlei Dantas de Oliveira
Representante da Controladoria Geral do Município de Recife

Roberto Wagner Martins Mateus
Secretaria de Planejamento, Gestão e Transformação Digital da Prefeitura do Recife

Originais assinados e arquivados na Reciprev

Recife (PE), 25 de outubro de 2023

ASSINATURAS