

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: 28/06/2024

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores)			
Renda Fixa			
TESOURO NACIONAL	MARCADO NA CURVA	R\$ 1.950.040.507,08	57,27%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	LETRAS FINANCEIRAS - MARCADO NA CURVA	R\$ 323.818.016,41	9,51%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.		R\$ 123.850.537,98	3,64%
CAIXA DTVM S/A		R\$ 114.966.648,39	3,38%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		R\$ 68.397.737,05	2,01%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA		R\$ 36.398.162,85	1,07%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT		R\$ 25.450.079,09	0,75%
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA		R\$ 23.688.337,83	0,70%
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA		R\$ 20.098.289,32	0,59%
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)		R\$ 15.308.819,22	0,45%
INTER ASSET GESTÃO DE RECURSOS LTDA		R\$ 15.005.946,93	0,44%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA		R\$ 13.826.572,27	0,41%
SOMMA INVESTIMENTOS S/A		R\$ 7.815.965,92	0,23%
SINGULARE CTVM S.A.		R\$ 4.396,32	0,00%
TOTAL RF		R\$ 2.738.670.016,64	80,44%
Renda Variável			
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)		R\$ 133.814.958,06	3,93%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA		R\$ 90.982.033,79	2,67%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		R\$ 82.971.334,99	2,44%
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA		R\$ 57.740.637,52	1,70%
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)		R\$ 42.869.689,32	1,26%
CAIXA DTVM S/A		R\$ 41.833.871,17	1,23%
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA		R\$ 37.479.621,36	1,10%
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA		R\$ 36.187.454,63	1,06%
SOMMA INVESTIMENTOS S/A		R\$ 34.100.926,34	1,00%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL (GRUPO BNP)		R\$ 33.811.701,22	0,99%
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA		R\$ 25.271.983,91	0,74%
BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVESTIMENTOS LTDA		R\$ 15.491.633,89	0,46%
TOTAL RV		R\$ 632.555.846,19	18,58%
Fundos Estruturados			
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA		R\$ 25.083.453,05	0,74%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA		R\$ 6.152.278,63	0,18%
TOTAL ESTRUTURADOS		R\$ 31.235.731,69	0,92%
Fundos Imobiliários			
SINGULARE CTVM S.A.		R\$ 1.643.186,39	0,05%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA		R\$ 602.271,26	0,02%
TOTAL IMOBILIÁRIO		R\$ 2.245.457,65	0,07%
SALDO CONTA CORRENTE		R\$ 2,00	0,00%
PATRIMÔNIO		R\$ 3.404.707.054,17	100,00%

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores)			
Renda Fixa			
TESOURO NACIONAL		R\$ 1.950.040.507,08	57,27%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)		R\$ 339.126.835,63	9,96%
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM		R\$ 160.248.700,83	4,71%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL		R\$ 114.966.648,39	3,38%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		R\$ 68.397.737,05	2,01%
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.		R\$ 25.450.079,09	0,75%
ITAU UNIBANCO S.A.		R\$ 23.688.337,83	0,70%
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)		R\$ 21.642.538,19	0,64%
XP INVESTIMENTOS CORRETORA DE CÂMBIO TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.		R\$ 20.098.289,32	0,59%
INTER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA		R\$ 15.005.946,93	0,44%
SINGULARE CTVM S.A.		R\$ 4.396,32	0,00%
TOTAL RF		R\$ 2.738.670.016,64	80,44%
Renda Variável			
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)		R\$ 349.718.070,49	10,27%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL		R\$ 128.575.118,13	3,78%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		R\$ 82.971.334,99	2,44%
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM		R\$ 37.479.621,36	1,10%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)		R\$ 33.811.701,22	0,99%
TOTAL RV		R\$ 632.555.846,19	18,58%
Fundos Estruturados			
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)		R\$ 25.083.453,05	0,74%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.		R\$ 6.152.278,63	0,18%
TOTAL ESTRUTURADOS		R\$ 31.235.731,69	0,92%
Fundos Imobiliários			
SINGULARE CTVM S.A.		R\$ 1.643.186,39	0,05%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		R\$ 602.271,26	0,02%
TOTAL IMOBILIÁRIO		R\$ 2.245.457,65	0,07%
SALDO CONTA CORRENTE		R\$ 2,00	0,00%
PATRIMÔNIO		R\$ 3.404.707.054,17	100,00%
RESUMO GERAL POR ADMINISTRADOR DE RECURSOS			
TESOURO NACIONAL		R\$ 1.950.040.507,08	57,27%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)		R\$ 735.570.897,36	21,60%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL		R\$ 243.541.766,52	7,15%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		R\$ 151.971.343,30	4,46%
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM		R\$ 197.728.322,19	5,81%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)		R\$ 33.811.701,22	0,99%
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.		R\$ 25.450.079,09	0,75%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.		R\$ 6.152.278,63	0,18%
ITAU UNIBANCO S.A.		R\$ 23.688.337,83	0,70%
XP INVESTIMENTOS CORRETORA DE CÂMBIO TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.		R\$ 20.098.289,32	0,59%
INTER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA		R\$ 15.005.946,93	0,44%
SINGULARE CTVM S.A.		R\$ 1.647.582,71	0,05%
TOTAL		R\$ 3.404.707.052,17	100,00%

ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPEV

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 4.963/21	Classificação do 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	0,01%	0,01%	R\$	482.187,13	13.077.415/0001-05	0,71%	4,71%	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 DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IPCA + 6,00%	Não possui	0,53%	9,05%	R\$	17.891.858,43	19.303.795/0001-35	1,16%	5,70%	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 DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IMA-B	Não possui	0,34%	10,61%	R\$	11.642.011,58	19.523.306/0001-50	1,15%	5,70%	Curto 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 DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IDKA IPCA 2A	Não possui	0,54%	0,33%	R\$	18.363.680,26	13.322.205/0001-35	0,26%	3,11%	Curto Prazo	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b"	Risco Muito Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IRF-M	Não possui	0,59%	0,33%	R\$	20.017.999,66	07.111.384/0001-69	-0,32%	0,26%	Curto Prazo	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b"	Risco Médio
BNB SOBERANO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM	0,20%	CDI	Não possui	3,64%	3,49%	R\$	123.850.537,98	30.568.193/0001-42	0,79%	5,19%	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 - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,50%	CDI	Não possui	0,23%	3,21%	R\$	7.815.965,92	28.206.220/0001-95	0,98%	6,10%	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 - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	1,50%	CDI	Não possui	0,01%	0,02%	R\$	328.339,30	13.397.466/0001-14	0,63%	4,17%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, "a"	Risco Muito Baixo
BRADESCO INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	0,35%	IMA-B 5	0,2	0,44%	21,40%	R\$	14.980.479,91	44.315.854/0001-32	0,46%	2,44%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V, "b"	Risco 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	6,65%	-	R\$	226.446.372,18	00.066.670/0001-00	0,93%	6,13%	Médio Prazo	Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras - Art. 7º, IV	Risco Muito Baixo
LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO LF002200LEI (1288237000000003145)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	0,00%	IPCA+6,60%	Não possui	2,86%	-	R\$	97.371.644,23	00.066.670/0001-00	0,91%	6,04%	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 DTVM S/A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,85%	5,61%	R\$	28.793.774,70	18.598.288/0001-03	1,16%	5,71%	Curto 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 DTVM S/A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	1,02%	0,86%	R\$	34.677.232,20	20.139.595/0001-78	1,16%	5,72%	Curto 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 DTVM S/A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,22%	0,74%	R\$	7.510.866,28	19.769.046/0001-06	-0,71%	-0,83%	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 DTVM S/A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,35%	5,06%	R\$	11.860.766,33	20.139.534/0001-00	-0,72%	-0,84%	Longo Prazo	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b"	Risco Médio
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CAIXA DTVM S/A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B5+	Não possui	0,89%	2,66%	R\$	30.462.193,57	10.577.503/0001-88	-2,25%	-4,15%	Curto Prazo	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b"	Risco Médio

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 4.963/21	Classificação do Risco do Fundo
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	CAIXA DTVM S/A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,80%	Não Possui	Não possui	0,05%	0,17%	R\$	1.661.815,31	14.508.643/0001-55	0,71%	4,70%	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 DTVM	0,50%	IPCA	Não possui	1,07%	14,15%	R\$	36.398.162,85	14.146.491/0001-98	-0,21%	1,22%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, "a"	Risco Alto
TREND PÓS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	XP INVESTIMENTOS CORRETORA DE CÂMBIO TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	0,15%	CDI	Não possui	0,59%	0,21%	R\$	20.098.289,32	26.559.284/0001-44	0,79%	5,20%	Curto Prazo	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b"	Risco Muito Baixo
INTER CORPORATE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	INTER ASSET GESTÃO DE RECURSOS LTDA	INTER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	0,25%	CDI	Não possui	0,44%	0,88%	R\$	15.005.946,93	36.443.522/0001-05	0,81%	3,50%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V, "b"	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSECTORIAL 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\$	4.396,32	13.633.964/0001-19	-18,87%	207,45%	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	0,41%	7,41%	R\$	13.826.572,27	14.115.118/0001-70	-1,11%	-1,59%	Curto Prazo	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b"	Risco Baixo
ITAU IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA	ITAU UNIBANCO S.A.	0,18%	IMA-B5+	Não possui	0,70%	5,71%	R\$	23.688.337,83	14.437.684/0001-06	-2,26%	-4,17%	Curto Prazo	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, "b"	Risco Alto
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	0,10%	IMA-B5	Não possui	0,75%	1,94%	R\$	25.450.079,09	13.455.117/0001-01	0,37%	3,19%	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	1,14%	-	R\$	38.842.021,83		0,93%	6,19%	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 RECIPIEV	% 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 (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220 (7608)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+7.002655%	Não possui	2,45%	-	R\$ 83.506.652,61		0,93%	6,20%	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	1,24%	-	R\$ 42.160.998,75		0,87%	5,83%	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	1,24%	-	R\$ 42.119.630,75		0,87%	5,84%	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	1,46%	-	R\$ 49.672.019,39		0,76%	5,15%	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	1,46%	-	R\$ 49.672.019,39		0,76%	5,15%	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	1,46%	-	R\$ 49.672.019,39		0,76%	5,15%	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	5,75%	-	R\$ 195.725.045,88		0,77%	5,18%	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	0,72%	-	R\$ 24.465.630,74		0,77%	5,18%	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	1,44%	-	R\$ 48.931.261,47		0,77%	5,18%	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	1,66%	-	R\$ 56.415.236,11		0,77%	5,21%	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 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
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223138)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+5,265%	Não possui	1,39%	-	R\$ 47.349.611,87		0,80%	5,34%	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	4,17%	-	R\$ 142.048.835,61		0,80%	5,34%	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	5,56%	-	R\$ 189.398.447,48		0,80%	5,34%	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	1,39%	R\$	47.325.856,42		0,80%	5,35%	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	3,39%	R\$	115.508.239,63		0,83%	5,58%	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	8,32%	R\$	283.142.910,87		0,83%	5,59%	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: 15836500)	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	0,00%	IPCA+4,94%	Não possui	1,44%	-	R\$ 48.931.261,47		0,77%	5,18%	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	4,32%	-	R\$ 146.943.276,27		0,77%	5,18%	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	2,92%	-	R\$ 99.283.812,46		0,76%	5,15%	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	4,37%	-	R\$ 148.925.718,69		0,76%	5,15%	Longo Prazo	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	Risco Muito Baixo
Renda Fixa						80,44%		R\$ 2.738.670.016,64			0,71%			
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	2,67%	6,52%	R\$ 90.982.033,79	11.182.064/0001-77	0,26%	-9,75%	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%	1,00%	11,78%	R\$ 34.100.926,34	14.550.994/0001-24	1,36%	-8,52%	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%	1,70%	7,88%	R\$ 57.740.637,52	11.392.165/0001-72	0,61%	-5,58%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	Risco Alto
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES - FIA	BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	Ibovespa	20,00%	0,46%	7,25%	R\$ 15.491.633,89	37.569.846/0001-57	-0,15%	-9,45%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	Risco Alto
FINACAP MAURITSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	0,74%	5,50%	R\$ 25.271.983,91	05.964.067/0001-60	1,36%	-6,68%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	Risco Alto

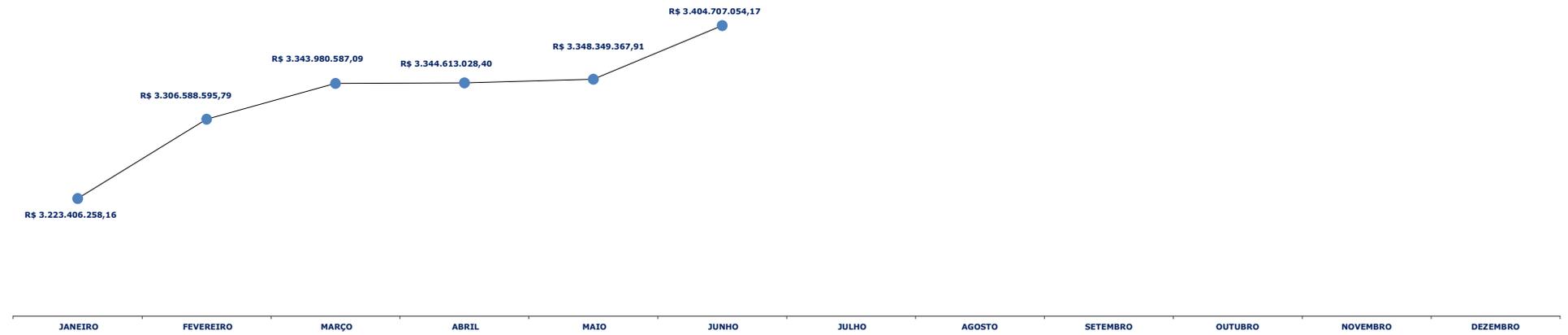
Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (Índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 4.963/21	Classificação do Risco do Fundo
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%	0,40%	14,52%	R\$ 13.746.422,54	12.239.939/0001-92	2,26%	-10,97%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, "a"	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%	0,59%	12,39%	R\$ 20.065.278,68	11.108.013/0001-03	-0,31%	-14,48%	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%	2,44%	7,49%	R\$ 82.971.334,99	07.882.792/0001-14	1,90%	-11,11%	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	1,10%	11,79%	R\$ 37.479.621,36	16.575.255/0001-12	2,18%	-8,04%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, "a"	Risco Alto
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES MID SMALL CAPS	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	1,50%	IBRX	Não possui	1,26%	7,49%	R\$ 42.869.689,32	06.988.623/0001-09	-0,04%	-12,82%	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	1,06%	4,38%	R\$ 36.187.454,63	11.628.883/0001.03	2,08%	-7,75%	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 AÇÕES MULTIGESTOR	CAIXA DTVM S/A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,50%	IBOVESPA	Não possui	1,23%	7,64%	R\$ 41.833.871,17	30.068.224/0001-04	1,00%	-9,38%	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%	2,55%	8,56%	R\$ 86.741.246,95	15.154.441/0001-15	1,78%	-3,39%	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%	0,00%	0,00%	R\$ 0,00	34.525.068/0001-06	1,13%	-10,80%	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%	1,38%	10,97%	R\$ 47.073.711,10	07.488.106/0001-25	1,51%	-7,65%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, "a"	Risco Muito Alto
Renda Variável						18,58%		R\$ 632.555.846,19			1,22%			
Exterior						0,00%		R\$ -			0,00%			
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	0,18%	4,55%	R\$ 6.152.278,63	12.312.767/0001-35	-0,03%	-0,18%	Curto Prazo	Fundos de Investimento em Participações (FIP) - Art. 10, II	Risco Muito Alto
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IMA-B 5	20,00%	0,74%	5,22%	R\$ 25.083.453,05	35.637.151/0001-30	1,25%	-0,03%	Curto Prazo	Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I	Risco Alto
Fundos Estruturados						0,92%		R\$ 31.235.731,69			1,00%			
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	SINGULARE CTVM S.A.	SINGULARE CTVM S.A.	1,36%	IPCA+7,50%	20,00%	0,05%	21,88%	R\$ 1.643.186,39	16.841.067/0001-99	-0,43%	3,42%	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%	0,02%	4,83%	R\$ 602.271,26	20.716.161/0001-93	-1,35%	2,17%	Curto Prazo	Fundos de Investimento Imobiliário (FII) - Art. 11	Risco Médio
Fundos Imobiliários						0,07%		R\$ 2.245.457,65			-0,68%			
Empréstimos Consignados						0,00%		R\$ -			0,00%			
Saldo Conta Corrente						0,00%		R\$ 2,00						
Total Geral						100,00%		R\$ 3.404.707.054,17			Rentabilidade Reciprev 0,83%			

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

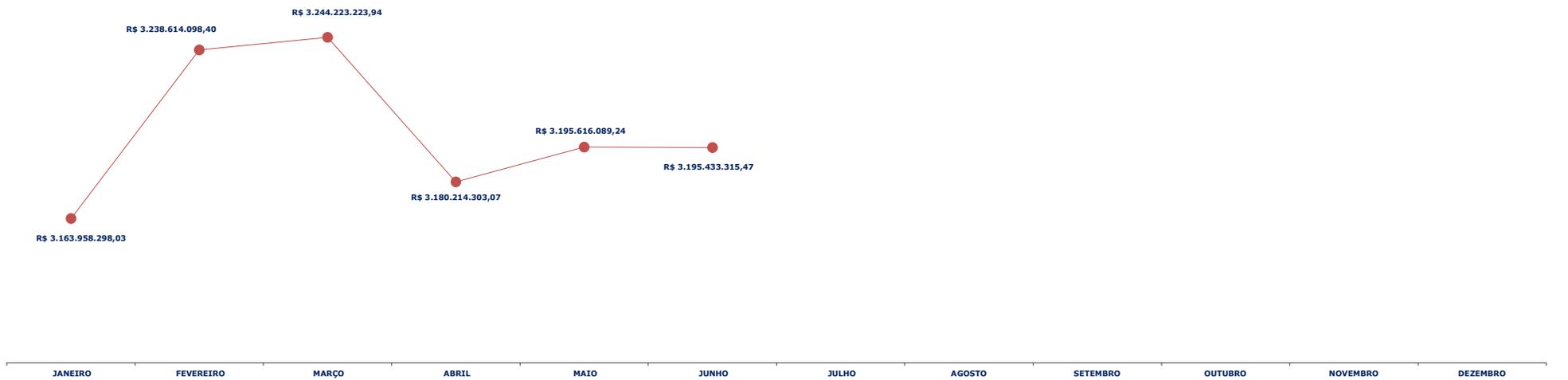
* A partir de 01/01/2019, os títulos públicos do Tesouro Nacional em posse do Fundo Previdenciário RECIPREV: TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS COM VENCIMENTO EM 15/05/2045 (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219; TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 e TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571, passaram a ser marcados pela "CURVA DE JUROS", de aquisição dos títulos, respectivamente: IPCA+7.0022999%; 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\$	1.740.766.768,38
Preço da Carteira à Mercado	R\$	3.195.433.315,47
Provisão para perdas futuras de investimentos	R\$	5.432.236,64

Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos na Curva RECIPREV 2024



Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos à Mercado RECIPREV 2024



ADMINISTRADORES DE RECURSOS	GRUPO ECONÔMICO DO ADMINISTRADOR DE RECURSOS	GESTORES DE RECURSOS	VALOR	% CARTEIRA
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 151.369.072,04	4,45%
		RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 602.271,26	0,02%
		TOTAL	R\$ 151.971.343,30	4,46%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		CAIXA DTVM S/A	R\$ 156.800.519,56	4,61%
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 86.741.246,95	2,55%
		TOTAL	R\$ 243.541.766,52	7,15%
		CUSTODIA	VALOR	% CARTEIRA
		TESOURO NACIONAL - Valor na Curva	R\$ 1.950.040.507,08	57,27%
		TESOURO NACIONAL - Valor à Mercado	R\$ 1.740.766.768,38	54,48%
TOTAL	R\$ 3.690.807.275,45	111,75%		
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 15.308.819,22	0,45%
		BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$ 323.818.016,41	9,51%
		TOTAL	R\$ 339.126.835,63	9,96%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 42.869.689,32	1,26%
		CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 90.982.033,79	2,67%
		BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 15.491.633,89	0,46%
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 47.073.711,10	1,38%
		ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 25.083.453,05	0,74%
		MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 13.826.572,27	0,41%
		AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 57.740.637,52	1,70%
		SOMMA INVESTIMENTOS S/A	R\$ 41.916.892,26	1,23%
		OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 36.187.454,63	1,06%
		FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 25.271.983,91	0,74%
		TOTAL	R\$ 396.444.061,73	11,64%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	R\$ 123.850.537,98	3,64%
		XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 37.479.621,36	1,10%
		XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 36.398.162,85	1,07%
		SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	R\$ 25.450.079,09	0,75%
TOTAL	R\$ 223.178.401,27	6,55%		
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 23.688.337,83	0,70%
		TOTAL	R\$ 23.688.337,83	0,70%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 6.152.278,63	0,18%
		TOTAL	R\$ 6.152.278,63	0,18%
		GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
		INTER ASSET GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 15.005.946,93	0,44%
TOTAL	R\$ 15.005.946,93	0,44%		

RESUMO POR ADMINISTRADOR/GRUPO ECONÔMICO

GESTOR	VALOR	% CARTEIRA
TOTAL	R\$ 33.811.701,22	0,99%
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 20.098.289,32	0,59%
TOTAL	R\$ 20.098.289,32	0,59%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 1.647.582,71	0,05%
TOTAL	R\$ 1.647.582,71	0,05%
TOTAL GERAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV	R\$ 3.404.707.052,17	100,00%
Na Curva	R\$ 3.404.707.052,17	
À Mercado	R\$ 3.195.433.313,47	

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV - 2024

PRAZOS DE LIQUIDAÇÃO DA CARTEIRA										
CARTEIRA GERAL	RENDA FIXA	RENDA VARIÁVEL	EXTERIOR	ESTRUTURADOS	IMOBILIÁRIOS	CONSIGNADOS	TOTAL			
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R\$ 427.543.605,79	R\$ 632.555.846,19	R\$ -	R\$ 31.235.731,69	R\$ 602.271,26	R\$ -	R\$ 1.091.937.454,93			32,07%
MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)	R\$ 323.822.412,73	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.643.186,39	R\$ -	R\$ 325.465.599,12			9,56%
LONGO PRAZO (+ de 5 anos)	R\$ 1.987.303.998,11	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.987.303.998,11			58,37%
TOTAL	R\$ 2.738.670.016,64	R\$ 632.555.846,19	R\$ -	R\$ 31.235.731,69	R\$ 2.245.457,65	R\$ -	R\$ 3.404.707.052,17			100,00%
							R\$ 0,00			

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS DA CARTEIRA - INDICES			
ÍNDICE	VALOR	%	
IPCA+ACIMA DA META	R\$ 2.336.546.281,04	68,63%	
IBOVESPA	R\$ 387.659.372,37	11,39%	
IMA-B	R\$ 108.311.223,36	3,18%	
IDIV	R\$ 124.220.868,31	3,65%	
CDI	R\$ 169.247.478,20	4,97%	
SMALL CAPS	R\$ 77.805.916,19	2,29%	
IBRX	R\$ 42.869.689,32	1,26%	
IDKA IPCA 2A	R\$ 18.363.680,26	0,54%	
IMA-B 5	R\$ 65.514.012,05	1,92%	
IMA-B 5+	R\$ 54.150.531,40	1,59%	
IRF-M	R\$ 20.017.999,66	0,59%	
TOTAL	R\$ 3.404.707.052,17	100,00%	

RENDA FIXA X RENDA VARIÁVEL X EXTERIOR X ESTRUTURADOS X IMOBILIÁRIOS X CONSIGNADOS		
	VALOR	%
RENDA FIXA	R\$ 2.738.670.016,64	80,44%
RENDA VARIÁVEL	R\$ 632.555.846,19	18,58%
EXTERIOR	R\$ -	0,00%
ESTRUTURADOS	R\$ 31.235.731,69	0,92%
IMOBILIÁRIOS	R\$ 2.245.457,65	0,07%
CONSIGNADOS	R\$ -	0,00%
TOTAL	R\$ 3.404.707.052,17	100,00%

VOLATILIDADE DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS E TÍTULOS		
	VALOR	%
Volatilidade Muito Baixa	R\$ 2.438.161.185,65	71,61%
Volatilidade Alta	R\$ 541.582.127,88	15,91%
Volatilidade Muito Alta	R\$ 211.834.217,00	6,22%
Volatilidade Média	R\$ 176.024.316,41	5,17%
Volatilidade Baixa	R\$ 37.105.205,23	1,09%
TOTAL	R\$ 3.404.707.052,17	100,00%

Posição dos Gestores e Administradores da Carteira de Investimentos RECIPREV 2024

VOLUME DE APLICAÇÕES POR GESTOR				
GESTOR	VALOR APLICADO	% CARTEIRA	% Máximo Permitido	%
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 57.740.637,52	1,70%	Máximo permitido 5,00% do volume de gestão ANBIM1	0,27%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 151.369.072,04	4,45%		0,01%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	R\$ 123.850.537,98	3,64%		1,05%
BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	R\$ 33.811.701,22	0,99%		0,05%
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$ 58.178.508,53	1,71%		0,01%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$ 323.818.016,41	9,51%		0,05%
CAIXA DTVM S/A	R\$ 156.800.519,56	4,61%		0,03%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 90.982.033,79	2,67%		5,16%
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 25.271.983,91	0,74%		2,51%
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 23.688.337,83	0,70%		0,00%
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 25.083.453,05	0,74%		0,06%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 13.826.572,27	0,41%		0,13%
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 36.187.454,63	1,06%		0,72%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 6.152.278,63	0,18%		0,62%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 602.271,26	0,02%		0,01%
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 1.647.582,71	0,05%		0,03%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	R\$ 25.450.079,09	0,75%		0,01%
INTER ASSET GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 15.005.946,93	0,44%		0,21%
SOMMA INVESTIMENTOS S/A	R\$ 41.916.892,26	1,23%		0,37%
BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 15.491.633,89	0,46%		0,00%
TESOURO NACIONAL	R\$ 1.950.040.507,08	57,27%		0,00%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$ 133.814.958,06	3,93%		0,27%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 36.398.162,85	1,07%		0,02%
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	R\$ 20.098.289,32	0,59%		0,01%
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 37.479.621,36	1,10%		0,02%
TOTAL	R\$ 3.404.707.052,17	100,00%		

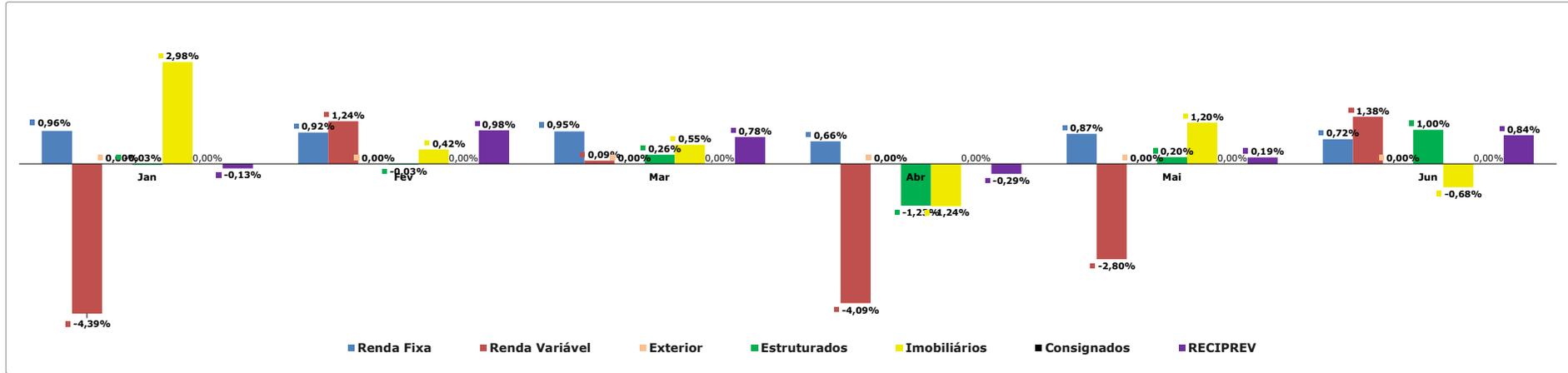
VOLUME DE APLICAÇÕES POR ADMINISTRADOR						
ADMINISTRADOR	VALOR APLICADO	% CARTEIRA	% Máximo Permitido	% Máximo Permitido	% do Total administrado	% Recursos com RPPS
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	R\$ 33.811.701,22	1,12%	Máximo permitido 5,00% do volume de Administração ANBIMA	Máximo permitido de todos os RPPS 50,00% do volume de Administração ANBIMA	0,04%	1,44%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$ 339.126.835,63	11,27%			0,05%	1,72%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 151.971.343,30	5,05%			0,01%	5,51%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$ 6.152.278,63	0,20%			0,00%	0,06%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 243.541.766,52	8,10%			0,04%	11,74%
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM	R\$ 197.728.322,19	6,57%			0,05%	0,83%
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	R\$ 25.450.079,09	0,85%			0,00%	0,83%
ITAU UNIBANCO S.A.	R\$ 23.688.337,83	0,79%			0,00%	0,00%
XP INVESTIMENTOS CORRETORA DE CÂMBIO TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	R\$ 20.098.289,32	0,67%				
SINGULARE CTVM S.A.	R\$ 1.647.582,71	0,05%				
TESOURO NACIONAL	R\$ 1.950.040.507,08	0,05%				
INTER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	R\$ 15.005.946,93	0,50%				
TOTAL	R\$ 3.008.262.990,43	100,00%				

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

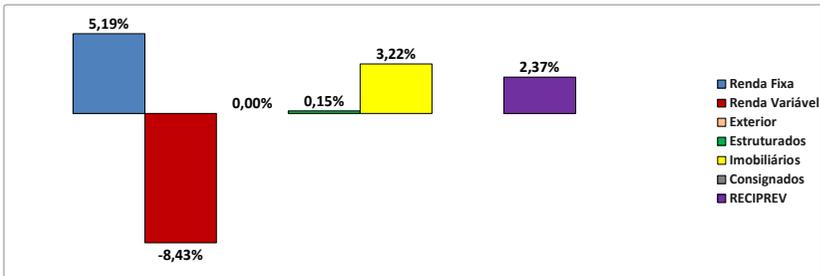
SEGMENTO	Tipo de Ativo	Limite da Resolução CMN (%)	Posição Atual da Carteira (R\$)	Posição Atual da Carteira (%)	Estratégia de Alocação - Política de Investimento de 2023			Meta de rentabilidade para o Exercício por tipo de Ativo
					Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)	
Renda Fixa	Títulos Públicos de emissão do TN - Art. 7º, I, a	100,00%	R\$ 1.950.040.507,08	57,27%	50,00%	58,00%	65,00%	9,44%
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	100,00%	R\$ 390.278.201,92	11,46%	3,00%	5,00%	30,00%	9,14%
Renda Fixa	ETF - 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, c	100,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	9,08%
Renda Fixa	Operações compromissadas - Art. 7º, II	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Renda Fixa	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7, III, a	60,00%	R\$ 36.726.502,15	1,08%	5,00%	2,00%	30,00%	10,15%
Renda Fixa	ETF - Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, b	60,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,91%	15,00%	9,08%
Renda Fixa	Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras - Art. 7º, IV	20,00%	R\$ 323.818.016,41	9,51%	3,00%	9,00%	20,00%	12,04%
Renda Fixa	Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior - Art. 7º, V, a	5,00%	R\$ 4.396,32	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	10,00%
Renda Fixa	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V, b	5,00%	R\$ 37.802.392,76	1,11%	0,00%	1,00%	4,00%	10,50%
Renda Fixa	Fundos de debêntures de infraestrutura - Art. 7º, V, c	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	11,15%
Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I, a	30,00%	R\$ 632.555.846,19	18,58%	2,00%	18,00%	30,00%	25,21%
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%	22,61%
Exterior	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I	10,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	7,00%	5,90%
Exterior	Fundos de Investimento - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	10,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	7,00%	12,48%
Exterior	Fundos de Investimento em Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III	10,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	8,00%	9,90%
Investimentos Estruturados	Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I	10,00%	R\$ 25.083.453,05	0,74%	0,00%	0,82%	10,00%	11,00%
Investimentos Estruturados	Fundos de Investimento em Participações (FIP) - Art. 10, II	5,00%	R\$ 6.152.278,63	0,18%	0,11%	0,20%	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%	2,00%	36,60%
Fundos Imobiliários	Fundos de Investimento Imobiliário (FII) - Art. 11	5,00%	R\$ 2.245.457,65	0,07%	0,00%	0,07%	1,00%	6,96%
Empréstimos Consignados	Empréstimos Consignados - sem certificação Pró-Gestão - Art. 12, I	5,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	0,00%
Empréstimos Consignados	Empréstimos Consignados - com certificação Pró-Gestão - Art. 12, II	10,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	18,47%
Saldo Conta Corrente								
TOTAL			R\$ 3.404.707.052,17	0,00%		100,00%		

POLÍTICA 2023									
TIPOS DE ATIVOS	Artigo da Resolução 4.963/2021	Limites 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%	65,00%	100,00%	50,00%	58,00%	65,00%	57,27%	0,73%
Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC	Art. 7º, I, "b"	100,00%	30,00%	100,00%	3,00%	5,00%	30,00%	11,46%	-6,46%
Fundos de Investimento em Índices de Mercado (ETF) - 100% Títulos Públicos	Art. 7º, I, "c"	100,00%	15,00%	100,00%	0,00%	1,00%	15,00%	0,00%	1,00%
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%	30,00%	75,00%	0,00%	2,00%	30,00%	1,08%	0,92%
Fundos de Investimentos em Índices de Mercado (ETF)	Art. 7º, III, "b"	60,00%	15,00%	75,00%	0,00%	0,91%	15,00%	0,00%	0,91%
Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras	Art. 7º, IV, "a"	20,00%	20,00%	35,00%	0,00%	9,00%	20,00%	9,51%	-0,51%
Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior	Art. 7º, V, "a"	5,00%	0,01%	15,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,00%	0,00%
Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado	Art. 7º, V, "b"	5,00%	4,00%	15,00%	0,00%	1,00%	4,00%	1,11%	-0,11%
Fundos de debêntures de infraestrutura	Art. 7º, V, "c"	5,00%	2,00%	15,00%	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	0,00%
TOTAL RENDA FIXA						76,91%		80,44%	-3,53%
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%	30,00%	45,00%	0,00%	18,00%	30,00%	18,58%	-0,58%
Fundos de Investimento em Índices de Mercado (ETF)	Art. 8º, I, "b"	30,00%	0,00%	45,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL						18,00%		18,58%	-0,58%
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%	7,00%	10,00%	0,00%	0,00%	7,00%	0,00%	0,00%
Fundos de Investimento - Investimento no Exterior	Art. 9º, II	10,00%	7,00%	10,00%	0,00%	1,00%	7,00%	0,00%	1,00%
Fundos de Investimento em Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III	10,00%	7,00%	10,00%	0,00%	1,00%	7,00%	0,00%	1,00%
TOTAL EXTERIOR						2,00%		0,00%	2,00%
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%	30,00%	45,00%	0,00%	0,82%	30,00%	0,74%	0,08%
Fundos de Investimento em Participações (FIP)	Art. 8º, I, "b"	45,00%	0,00%	45,00%	0,00%	0,20%	0,00%	0,18%	0,02%
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						1,02%		0,92%	0,10%
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%	0,07%	1,00%	0,07%	0,00%
TOTAL FUNDOS IMOBILIÁRIOS						0,07%		0,07%	0,00%
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%	2,00%	10,00%	0,00%	2,00%
Empréstimos Consignados - com certificação Pró-Gestão	Art. 12,II	10,00%	10,00%	10,00%	0,00%	2,00%	10,00%	0,00%	2,00%
TOTAL EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS						2,00%		0,00%	2,00%
						100,00%		100,00%	

Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2024



Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2024



Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV -2024

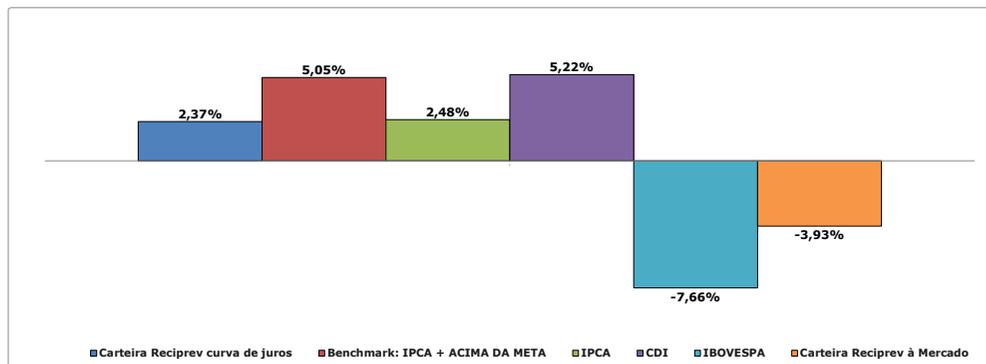
% Atingimento acumulado anual da meta na Curva	-2,67%
% Atingimento acumulado anual da meta à Mercado	-8,98%

Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2024

Rentabilidade Anual Acumulada no Período



ACUMULADO DE JANEIRO A DEZEMBRO 2024 - RENTABILIDADE DA CARTEIRA X ÍNDICES



RELATÓRIOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIFIN

Data da Posição: 28/06/2024

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\$ 474,56	R\$ 67.660,82
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\$ 28.307,37	R\$ 155.239,02
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	CAIXA DTVM S/A	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 45.402,13	R\$ 726.012,84
Saldo Conta Corrente				R\$ 1,00
Total Carteira RECIFIN			R\$ 74.184,06	R\$ 948.913,68

RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

ANO 2024

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV - VALOR PELA CURVA DE JUROS

DATA	SALDO R\$	RENDIMENTO R\$	% RENDIMENTO CARTEIRA NA CURVA
31/01/2024	R\$ 3.223.406.258,16 -R\$	4.337.351,06	-0,13%
29/02/2024	R\$ 3.306.588.595,79 R\$	32.243.593,25	0,98%
29/03/2024	R\$ 3.343.980.588,09 R\$	25.916.589,92	0,78%
30/04/2024	R\$ 3.341.341.116,70 -R\$	11.156.494,31	-0,29%
31/05/2024	R\$ 3.348.349.367,91 R\$	6.264.103,01	0,19%
28/06/2024	R\$ 3.404.707.052,17 R\$	28.046.543,91	0,83%
31/07/2024			
30/08/2024			
30/09/2024			
31/10/2024			
30/11/2024			
31/12/2024			
TOTAL	R\$	76.976.984,82	2,36%

FUNDO FINANCEIRO RECIFIN

SALDO R\$	RENDIMENTO R\$
R\$ 950.410,71 R\$	60.205,08
R\$ 23.440.979,97 R\$	98.158,55
R\$ 11.725.543,29 R\$	218.710,83
R\$ 255.516,22 R\$	146.228,32
R\$ 225.792,94 R\$	83.888,69
R\$ 948.912,68 R\$	74.184,06
TOTAL	R\$ 681.375,53

TOTAL FUNDOS: RECIPREV E RECIFIN

SALDO R\$	RENDIMENTO R\$
R\$ 3.224.356.668,87 -R\$	4.277.145,98
R\$ 3.330.029.575,76 R\$	32.341.751,90
R\$ 3.355.706.131,38 R\$	26.135.300,75
R\$ 3.341.596.632,92 -R\$	11.010.265,99
R\$ 3.348.575.160,85 R\$	6.347.991,70
R\$ 3.405.655.964,85 R\$	28.120.727,97
TOTAL	R\$ 77.658.360,35

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\$ 170.846.149,56 -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\$ 327.749.159,62 -R\$	36.836.127,55 -R\$	10.548.166,29	R\$ 280.364.865,78	R\$ 339.435.259,47 R\$	3.080.262.221,73
2024	R\$ 195.002.844,04 -R\$	86.439.829,60 -R\$	7.681.797,05	R\$ 100.881.217,39	R\$ 76.976.984,82 R\$	3.319.564.976,57
TOTAIS	R\$ 2.203.623.924,58	-R\$ 977.749.817,51	134.582.784,86	R\$ 1.091.291.322,21	R\$ 1.717.629.719,23	

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
31/01/2024	-0,13%	-2,03%	0,42%	0,86%	0,97%	-0,45%	-4,79%	-0,45%	-1,99%
28/02/2024	0,58%	0,75%	0,83%	1,21%	0,80%	0,55%	0,99%	2,58%	2,36%
31/03/2024	-0,18%	-0,18%	0,16%	0,56%	0,83%	0,08%	-0,71%	1,13%	0,17%
30/04/2024	-0,29%	-2,17%	0,38%	0,82%	0,89%	-1,61%	-1,70%	-0,08%	-1,97%
31/05/2024	0,19%	0,56%	0,46%	0,88%	0,83%	1,33%	-3,04%	0,21%	0,48%
30/06/2024	0,83%	-0,89%	0,21%	0,61%	0,79%	-0,97%	1,48%	1,68%	-0,01%
31/07/2024									
31/08/2024									
30/09/2024									
31/10/2024									
30/11/2024									
31/12/2024									
TOTAL	2,36%	-3,93%	2,48%	5,05%	5,22%	-1,10%	-7,66%	5,15%	-0,57%

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



FLUXO MENSAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPEV

ANO 2024

MÊS	JUNHO	COMPETÊNCIA	VALOR	ACUMULADO ANUAL
RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO				
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		01/05/2024	R\$ 13.073,024,02	R\$ 78.642.420,63
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL INATIVOS/PENSIONISTAS)		01/05/2024	R\$ 2.712.905,40	R\$ 18.433.868,57
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		01/05/2024	R\$ 11.602.877,08	R\$ 76.954.381,22
PARCELAMENTO		Parcela 42/60	R\$ 1.642.363,68	R\$ 9.579.979,03
COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA		01/06/2024	R\$ 2.747.024,23	R\$ 10.596.835,89
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		01/05/2024	R\$ 85.903,67	R\$ 327.408,03
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		01/05/2024	R\$ 75.448,77	R\$ 372.658,26
EMLURB (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		01/06/2024	R\$ -	R\$ 47.863,16
EMLURB (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		01/05/2024	R\$ 7.160,68	R\$ 34.612,63
TOTAL			R\$ 31.949.543,04	R\$ 195.002.844,04
RECEBIMENTOS DE TÍTULOS E ALGUNS FUNDOS DE INVESTIMENTOS				
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)			R\$ 1.500,00	R\$ 38.000,00
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)			R\$ -	R\$ 47.166,40
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES) - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ -	R\$ -
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ -	R\$ 507.253,73
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$ -	R\$ 330.298,64
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219			R\$ -	R\$ 1.262.489,49
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220			R\$ -	R\$ 2.714.352,39
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570			R\$ -	R\$ 1.262.489,49
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571			R\$ -	R\$ 1.262.489,49
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759224)			R\$ -	R\$ 1.262.489,49
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759225)			R\$ -	R\$ 1.262.489,49
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759226)			R\$ -	R\$ 1.262.489,49
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786865)			R\$ -	R\$ 3.787.468,46
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786866)			R\$ -	R\$ 2.524.978,97
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836499)			R\$ -	R\$ 3.736.098,57
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836500)			R\$ -	R\$ 1.245.366,19
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860600)			R\$ -	R\$ 1.245.366,19
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860602)			R\$ -	R\$ 622.683,09
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860603)			R\$ -	R\$ 4.981.464,76
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15917043)			R\$ -	R\$ 1.444.624,78
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223138)			R\$ -	R\$ 1.245.366,19
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223139)			R\$ -	R\$ 3.736.098,57
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223140)			R\$ -	R\$ 4.981.464,76
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223141)			R\$ -	R\$ 1.245.366,19
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 19447309)			R\$ -	R\$ 3.254.950,39
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 37517319)			R\$ -	R\$ -
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			R\$ -	R\$ -
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			R\$ -	R\$ -
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			R\$ -	R\$ -
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)			R\$ -	R\$ -
TOTAL			R\$ 1.500,00	R\$ 53.097.903,89

FOLHA DE PAGAMENTO E CONSIGNAÇÕES		VALOR		ACUMULADO ANUAL
FOLHA DE PAGAMENTO	-R\$	13.880.614,48	-R\$	76.384.776,57
CONSIGNAÇÕES	-R\$	3.231.982,29	-R\$	9.513.066,71
DEVOLUÇÕES DE FOLHA NÃO PROCESSADAS E DE CONSIGNAÇÕES	-R\$	182.441,45	-R\$	541.986,32
TOTAL	-R\$	17.295.038,22	-R\$	86.439.829,60

PAGAMENTOS DIVERSOS		VALOR		ACUMULADO ANUAL
TARIFA DE CORRETAGEM DE FUNDOS IMOLIÁRIOS	R\$	-	R\$	-
SISTEMA QUANTUM	R\$	-	-R\$	9.745,16
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPIEV	-R\$	1.058.911,69	-R\$	7.672.051,89
TOTAL	-R\$	1.058.911,69	-R\$	7.681.797,05

RESUMO GERAL		VALOR		ACUMULADO ANUAL
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO	R\$	31.949.543,04	R\$	195.002.844,04
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMOTRIZAÇÕES ESPECÍFICAS	R\$	1.500,00	R\$	53.097.903,89
TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS E CONSIGNAÇÕES	-R\$	17.295.038,22	-R\$	86.439.829,60
TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS	-R\$	1.058.911,69	-R\$	7.681.797,05
TOTAL	R\$	13.597.093,13	R\$	153.979.121,28

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\$	-	R\$	7.308,87
Contrato com a Corretora. Destinado a venda do fundo Singulare 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 Custodia 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\$	-
TOTAL	R\$	-	R\$	7.308,87

		VALOR	ACUMULADO ANUAL
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO	R\$	31.949.543,04	R\$ 195.002.844,04
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMOTRIZAÇÕES ESPECÍFICAS	R\$	16.627,76	R\$ 53.113.031,65
TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS E CONSIGNAÇÕES	R\$	17.295.038,22	R\$ 70.603.851,81
TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS	R\$	1.058.911,69	R\$ 7.681.797,05
TOTAL	R\$	50.320.120,71	R\$ 326.401.524,55

CONTRATOS DE PRESTAÇÃO DE SERVIÇOS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS

		VALOR	ACUMULADO ANUAL
CONTRATO DE PRESTAÇÃO DE SERVIÇOS DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS			
Contrato de Sistema de Banco de Dados - Paramita Tecnologia Consultoria Financeira Ltda (QUANTUM)	R\$	-	R\$ 7.308,87
Contrato com a Corretora. Destinado a venda do fundo Singulare 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 Custodia 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\$ -
TOTAL	R\$	-	R\$ 7.308,87

ESTATÍSTICA DA CARTERIA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

FUNDO	Benchmark	Retorno Médio Mensal	Retorno Médio Anual	Retorno Total	Maior Retorno	Menor Retorno	Qtde. mês Positivo	Qtde. mês Negativo	Qtde. mês acima do Benchmark	Qtde. mês abaixo do Benchmark	Risco Mensal Período	Risco Mensal 12 MESES	Risco Anual do Período	Em 68% dos dados o retorno ficou entre	Em 95% dos dados o retorno ficou entre
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Índice Small Cap	0,98%	12,38%	383,13%	14,87%	-37,75%	102	60	107	62	5,81%	5,07%	0,20	-4,84% e 6,79%	-10,65% e 12,61%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,66%	8,23%	183,14%	1,74%	-6,50%	156	2	9	156	0,32%	0,11%	0,01	0,34% e 0,99%	0,01% e 1,31%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + 6,00%	0,89%	11,21%	202,45%	5,90%	-1,71%	115	10	66	66	0,78%	0,20%	0,03	0,11% e 1,67%	-0,68% e 2,45%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	0,90%	11,29%	202,03%	4,77%	-2,78%	105	19	74	74	1,23%	0,20%	0,04	-0,34% e 2,13%	-1,57% e 3,36%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IBOVESPA	0,46%	5,64%	109,73%	16,82%	-32,23%	88	74	86	83	6,30%	4,88%	0,22	-5,84% e 6,76%	-12,14% e -13,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDK24 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IXR IPCA 2A	0,92%	10,32%	264,25%	3,50%	-1,66%	139	19	64	101	0,78%	0,63%	0,03	0,04% e 1,60%	-0,74% e 2,38%
BRAS SORREIA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	CDI	0,63%	7,29%	41,94%	1,17%	-0,16%	55	1	29	34	0,30%	0,11%	0,01	0,24% e 1,02%	-0,15% e 1,40%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	SMLL	0,59%	7,34%	160,12%	15,39%	-39,40%	71	92	77	92	6,48%	5,83%	0,22	-5,89% e 7,07%	-12,36% e -13,50%
BNP PARIBAS ACTION FIC FI AÇÕES	IBOVESPA	0,92%	11,63%	306,62%	14,68%	-29,79%	99	54	86	74	4,93%	4,51%	0,17	-0,01% e 5,85%	-8,93% e 10,77%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO PÚBLICO	CDI	0,40%	4,88%	79,95%	0,99%	-11,78%	144	4	148	4	1,08%	1,01%	0,04	-0,68% e 1,48%	-1,76% e 2,56%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES MID SMALL CAPS	IBRX	0,57%	7,06%	151,21%	14,55%	-31,64%	95	67	92	77	5,79%	6,62%	0,20	-5,22% e 6,36%	-11,01% e -12,11%
LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO LP002009HS (12882370000000003068)	IPCA+7,1%			27,69%	1,59%	-0,05%	28	1	22	13	0,09%	0,19%	0,01	0,46% e 1,23%	0,08% e 1,62%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,88%	11,03%	200,04%	6,15%	-3,32%	91	35	68	65	1,55%	0,20%	0,05	-0,67% e 2,43%	-2,23% e 3,98%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,83%	10,36%	151,01%	6,15%	-3,32%	81	31	61	61	1,44%	0,20%	0,05	0,61% e 2,26%	-2,05% e 3,70%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,81%	10,18%	172,22%	9,10%	-6,82%	79	45	66	65	2,39%	1,37%	0,08	-1,58% e 3,20%	-3,96% e 5,59%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,65%	8,02%	105,51%	9,10%	-8,79%	69	43	60	59	2,41%	1,37%	0,08	-1,77% e 3,06%	-4,18% e 5,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTISECTOR	IBOVESPA	0,20%	2,41%	12,84%	-12,84%	-31,94%	34	27	33	36	3,70%	4,80%	0,24	-6,82% e 7,21%	-14,33% e 14,33%
CAIXA BRASIL OPORIONBIBSADES FIC RENDA FIXA	CDI	0,63%	8,07%	150,45%	1,14%	-0,07%	142	0	8	141	0,20%	0,12%	0,01	0,16% e 0,94%	0,07% e 2,12%
CONSTRUTORA FUNDAMENTO FIA	IBOVESPA	0,67%	8,32%	196,16%	16,19%	-31,56%	96	66	96	73	5,87%	6,46%	0,20	-5,20% e 6,54%	-11,08% e -12,41%
FINACAP MULTIRESTATID FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,64%	8,02%	183,16%	25,04%	-27,33%	93	69	93	76	7,14%	5,21%	0,25	-6,50% e 7,79%	-18,93% e 18,93%
MAC INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,68%	8,43%	174,97%	2,68%	-1,74%	144	6	92	85	0,00%	1,37%	0,02	0,00% e 1,16%	-0,29% e 1,64%
OCCAM FIC FIA	IBOVESPA	0,77%	9,67%	207,42%	13,55%	-27,02%	87	59	84	69	5,49%	4,51%	0,19	-4,72% e 6,27%	-10,23% e 14,28%
BRASIL FUNDAMENTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATEGIA	IPCA+9,00%	-0,19%	-2,27%	-24,36%	33,60%	-54,62%	15	131	55	95	5,74%	0,01%	0,20	-5,93% e 5,55%	-11,07% e -11,07%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO FII	IPCA + 6,9506%	0,91%	11,49%	191,51%	58,23%	-27,49%	93	25	67	58	8,07%	18,36%	0,28	-7,15% e 8,98%	-15,22% e -17,68%
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	IPCA+7,50%	1,60%	20,91%	646,15%	47,64%	-10,42%	102	35	65	69	6,13%	1,19%	0,21	-4,53% e 7,72%	-10,66% e -18,80%
SOMMA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,49%	6,05%	108,32%	14,01%	-31,14%	89	61	72	85	5,72%	4,58%	0,20	-5,23% e 6,21%	-10,95% e -10,95%
SOMMA TORONTO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	CDI	0,66%	8,26%	56,79%	1,56%	-2,64%	65	3	63	12	0,39%	0,25%	0,02	0,08% e 1,25%	-0,51% e 1,84%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISECTORIAL INVEST DULIAS LP (COTAS SENIORES)	125% do CDI	-5,19%	-47,26%	-99,87%	740,83%	-100,00%	100	25	85	47	97,23%	53,51%	3,37	-102,42% e 92,03%	-199,64% e -189,26%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359218/26041	IPCA+7,0022999%	0,75%	9,41%	236,83%	11,73%	-22,16%	121	41	89	80	3,56%	0,18%	0,12	-2,81% e 4,31%	-6,36% e 7,87%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359202/21081	IPCA+7,0022655%	0,75%	9,40%	236,38%	11,73%	-22,16%	121	41	89	80	3,56%	0,18%	0,12	-2,81% e 4,31%	-6,36% e 7,87%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 4659321/28471	IPCA+6,261127%	0,70%	9,70%	249,11%	11,73%	-14,83%	120	42	94	75	3,31%	0,18%	0,11	-2,22% e 4,08%	-5,84% e 7,39%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 4659321/28471	IPCA+6,269771%	0,70%	9,66%	247,22%	11,73%	-14,92%	120	42	93	76	3,31%	0,18%	0,11	-2,54% e 4,08%	-5,85% e 7,39%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759224)	IPCA+4,86%	0,76%	9,47%	29,21%	1,68%	-1,64%	31	2	24	16	0,59%	0,14%	0,02	0,17% e 1,35%	-0,42% e 1,94%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759225)	IPCA+4,86%	0,76%	9,47%	29,21%	1,68%	-1,64%	31	2	24	16	0,59%	0,14%	0,02	0,17% e 1,35%	-0,42% e 1,94%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759226)	IPCA+4,86%	0,76%	9,47%	29,22%	1,68%	-1,64%	31	2	24	16	0,59%	0,14%	0,02	0,17% e 1,35%	-0,42% e 1,94%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15788665)	IPCA+4,86%	0,76%	9,47%	29,23%	1,68%	-1,65%	31	2	22	18	0,59%	0,14%	0,02	0,17% e 1,35%	-0,42% e 1,94%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15788666)	IPCA+4,86%	0,76%	9,48%	29,26%	1,68%	-1,65%	31	2	24	16	0,59%	0,14%	0,02	0,17% e 1,35%	-0,42% e 1,94%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836499)	IPCA+4,93%	0,84%	10,52%	32,75%	1,69%	-0,11%	32	1	24	16	0,40%	0,14%	0,01	0,44% e 1,24%	0,04% e 1,64%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836500)	IPCA+4,94%	0,84%	10,52%	32,78%	1,69%	-0,11%	32	1	24	16	0,40%	0,14%	0,01	0,44% e 1,24%	0,04% e 1,64%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860602)	IPCA+4,94%	0,84%	10,52%	32,78%	1,69%	-0,11%	32	1	24	16	0,40%	0,14%	0,01	0,44% e 1,24%	0,04% e 1,64%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860603)	IPCA+4,94%	0,84%	10,52%	32,78%	1,69%	-0,11%	32	1	24	16	0,40%	0,14%	0,01	0,44% e 1,24%	0,04% e 1,64%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15917043)	IPCA+5,50%	0,48%	5,96%	16,68%	1,69%	-2,68%	28	4	23	15	1,01%	0,83%	0,03	-0,53% e 1,49%	-1,54% e 2,50%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223138)	IPCA+5,265%	0,49%	6,09%	17,08%	1,72%	-2,73%	28	4	21	17	1,03%	0,82%	0,04	-0,54% e 1,53%	-1,57% e 2,56%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223139)	IPCA+5,265%	0,49%	6,09%	17,08%	1,72%	-2,73%	28	4	21	17	1,03%	0,82%	0,04	-0,54% e 1,53%	-1,57% e 2,56%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223140)	IPCA+5,265%	0,49%	6,09%	17,08%	1,72%	-2,73%	28	4	21	17	1,03%	0,82%	0,04	-0,54% e 1,53%	-1,57% e 2,56%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223141)	IPCA+5,270%	0,44%	1,65%	4,59%	1,72%	-6,61%	27	6	22	16	1,77%	0,82%	0,06	-1,63% e 1,90%	-2,40% e 3,67%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 19447309)	IPCA+5,730%	0,44%	5,43%	14,12%	1,75%	-1,89%	24	5	21	15	1,04%	0,15%	0,03	-0,50% e 1,38%	-1,48% e 2,33%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 37517719)	IPCA+5,775%	0,54%	6,71%	17,87%	1,03%	-0,08%	13	1	14	7	0,79%	0,88%	0,03	-0,25% e 1,34%	-1,04% e 2,13%
SUI AMERICA SELECTION FIC FIA	IBVX-2	-0,37%	-4,40%	-18,34%	15,51%	-42,67%	31	23	23	27	9,87%	6,40%	0,34	-10,24% e 9,49%	-19,38% e 19,38%
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,79%	9,96%	260,32%	14,05%	-26,37%	104	58	93	76	4,71%	4,61%	0,16	-3,92% e 5,50%	-8,62% e 10,21%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALORES DIVIDENDOS IIPV	IDV	0,62%	7,69%	140,41%	14,26%	-27,40%	83	59	74	75	4,99%	3,95%	0,17	-4,37% e 5,61%	-9,37% e 10,61%
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	IPCA	0,84%	10,04%	225,47%	3,11%	-1,12%	118	30	96	94	0,98%	1,04%	0,03	-0,18% e 1,78%	-1,16% e 2,76%
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Sam benchmark	0,86%	10,86%	230,29%	15,80%	-30,88%	85	55	82	67	5,64%	4,99%	0,20	-4,78% e 6,49%	-10,41% e -12,11%
SANTANDER IMA-B S PREMIUM FIC RENDA FIXA	IMA-B S	0,55%	6,88%	6,27%	1,78%	-0,33%	8	8	8	10	0,84%	0,80%	0,03	-0,26% e 1,39%	-1,12% e 2,23%
CAIXA BRASIL IMA-B S+ TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	IMA-B S+	-0,37%	-0,66%	-3,57%	1,56%	-2,03%	3	2	10	1	1,95%	0,00%	0,07	-2,47% e 1,43%	-3,27% e 3,29%
ITAU IMA-B S+ FIC RENDA FIXA	IMA-B S+	-0,75%	-8,65%	-3,70%	1,97%	-2,92%	2	3	3	3	1,87%	0,00%			

FUNDO	Retorno Relativo ao Benchmark	Retorno Relativo ao CDI	Retorno Relativo ao IBOVESPA	Retorno Relativo ao IMA B	META	Sharpe	Information Ratio	Tracking Error	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	Correlação CDI	Correlação IBOVESPA	Sharpe Modificado	Beta (12 meses)	Erro Quadrático Médio (EQM)
ICATU VANGUARDA IGBARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1M4-B 5	-0,07%	-0,83%	-0,28%	1,32%	-1,51%	2	2	8	3	1,87%	0,00%	0,04	-1,25%	2,22%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	1M4-B	0,68%	8,43%	174,97%	2,68%	-1,74%	144	6	72	85	0,00%	1,37%	0,02	0,19%	1,16%
TRENO FOS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES	CDI	0,62%	7,67%	74,04%	1,17%	-0,32%	89	1	46	51	0,48%	0,37%	0,01	0,62%	0,62%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		-9,28%	105,54%	56,98%	25,19%	0,23	-0,08	10,44%	10,72%	9,62%	-0,067	0,284	0,24	2,87	3,07%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		-11,73%	28,86%	-28,86%	-34,13%	-0,55	-0,92	0,15%	1,20%	1,38%	0,00%	-0,343	0,10	0,00	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		-11,39%	4,89%	28,67%	-1,73%	0,41	-0,48	2,73%	2,18%	2,18%	0,202	-0,130	-0,14	-0,01	1,79%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		70,70%	4,74%	28,49%	-21,74%	0,26	1,36	4,11%	2,93%	2,92%	0,153	-0,128	1,48	-0,01	1,88%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		97,71%	51,95%	97,71%	74,84%	0,15	0,52	9,92%	11,02%	10,51%	-0,091	0,100	0,25	2,64	2,86%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDMA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		204,92%	181,84%	193,49%	214,55%	3,12	7,94	1,13%	2,11%	1,94%	0,183	0,844	12,83	0,33	0,33%
BNB-SOBERANO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA		9,83%	9,83%	14,37%	22,58%	2,07	5,00	0,43%	1,27%	1,56%	0,941	0,801	-0,27	0,00	0,13%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		217,87%	86,93%	123,54%	117,47%	0,22	1,00	8,82%	11,47%	9,78%	-0,066	-0,160	0,25	3,50	2,56%
BNP PARIBAS ACTION FIC FI AÇÕES		249,45%	192,22%	249,45%	306,62%	0,53	0,82	12,70%	9,15%	7,81%	-0,027	0,112	0,58	2,55	3,68%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO BRASILEIRO DIVERSO		-38,52%	-18,50%	-18,50%	-54,21%	-1,01	-1,22	3,47%	2,18%	2,53%	0,332	0,113	1,48	0,00	1,04%
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES MID SMALL CAPS		96,21%	85,70%	94,19%	101,69%	0,24	0,49	10,63%	10,37%	8,53%	-0,066	-0,293	0,42	3,58	3,06%
LETRA FINANCEIRA DO BRASESCO LF002200988 (1288237000000003688)		0,00%	-2,91%	7,90%	6,11%	0,60	0,00	1,16%	1,48%	1,50%	0,065	0,284	-0,06	-0,03	0,36%
FUNDO DE INVESTIMENTO CADIA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		-70,66%	4,05%	27,65%	-2,51%	0,19	-3,52	3,91%	3,44%	3,45%	0,107	-0,323	2,76	-0,01	1,13%
FUNDO DE INVESTIMENTO CADIA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		-90,21%	-12,95%	6,78%	-18,44%	-0,18	-7,58	4,12%	3,20%	3,27%	0,125	-0,295	0,05	-0,01	1,18%
FUNDO DE INVESTIMENTO CADIA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		7,16%	-5,60%	15,81%	-11,55%	-0,46	0,23	3,19%	4,77%	4,15%	0,125	-0,310	0,00	0,79	9,92%
FUNDO DE INVESTIMENTO CADIA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		-11,50%	-28,73%	-12,57%	-33,23%	-0,39	-0,45	3,17%	4,64%	4,19%	0,155	-0,349	0,41	0,79	9,92%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTISECTORIAL		-18,23%	-23,70%	-18,23%	-34,03%	-0,19	-0,41	10,18%	12,00%	11,49%	-0,007	-0,229	-0,20	2,76	2,93%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA		-11,81%	-9,19%	-5,19%	-13,53%	-0,49	-8,11	0,14%	1,13%	1,32%	0,992	0,832	1,31	0,00	0,09%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA		74,31%	90,93%	74,31%	72,53%	0,26	0,44	9,97%	10,51%	9,52%	-0,046	0,100	0,32	2,83	2,88%
FINCAP MAJORITY FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		118,90%	109,32%	118,90%	116,60%	0,24	0,52	11,77%	12,65%	12,36%	-0,010	0,784	-0,09	3,00	3,39%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO		-12,70%	15,49%	174,97%	-0,87%	0,19	-0,17	6,80%	0,00%	1,06%	0,519	0,884	1,10	0,81	1,96%
OCCAM FIC FIA		147,70%	137,87%	147,70%	165,49%	0,40	0,78	10,04%	9,96%	9,30%	-0,054	0,060	1,17	2,42	2,89%
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGICA		-75,42%	-73,77%	-67,82%	-80,40%	-0,55	-0,56	21,23%	9,47%	9,41%	-0,041	-0,108	-0,58	0,00	6,16%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO FII		86,51%	1,10%	24,02%	-5,28%	0,03	-0,93	27,16%	14,44%	16,86%	0,030	-0,329	0,03	-2,01	7,81%
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO		31,84%	158,76%	217,43%	93,35%	0,52	0,15	20,47%	11,83%	10,42%	-0,163	0,330	0,56	-0,10	5,92%
SOMMA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		-18,64%	-29,08%	-18,64%	-48,01%	-0,13	-0,20	10,07%	9,64%	9,64%	-0,037	-0,108	-0,16	2,57	2,59%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		21,32%	26,33%	30,28%	2,06	2,00	2,17	1,68%	1,63%	2,08%	0,503	0,826	-296,15	0,01	2,48%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM CRÉDITOS CREDITÍCIOS MULTISECTORIAL INVEST DANAS LP (COTAS SENIÓRIS)		-99,95%	-99,95%	-99,95%	-99,96%	-0,17	-0,17	328,21%	180,65%	188,58%	-0,153	0,112	-0,17	-0,43	96,27%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTISA NTN-B 2045) -C5000: 10159243 (72641)		23,05%	16,81%	43,29%	-13,72%	0,13	0,14	12,07%	6,77%	6,77%	0,077	-0,400	-0,18	0,01	3,48%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTISA NTN-B 2045) -C5000: 10159240 (72681)		1,87%	16,66%	43,11%	-12,83%	0,13	0,01	12,07%	6,67%	6,77%	0,077	-0,369	-0,17	0,01	3,48%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTISA NTN-B 2045) -C5000: 6650576 (72647)		125,23%	21,07%	48,52%	-9,54%	0,17	0,57	11,23%	6,27%	6,29%	0,075	-0,116	-0,17	0,01	3,23%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTISA NTN-B 2045) -C5000: 6650571 (72631)		60,34%	20,42%	47,72%	-10,03%	0,16	0,34	11,24%	6,27%	6,30%	0,076	-0,115	-0,21	0,01	3,24%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045 - CÓDIGO: 15759224)		-2,14%	-4,94%	7,10%	6,45%	-0,09	-0,42	2,00%	1,75%	1,74%	-0,227	-0,200	0,02	0,06	0,57%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045 - CÓDIGO: 15759225)		-2,14%	-4,94%	7,10%	6,45%	-0,09	-0,42	2,00%	1,75%	1,74%	-0,227	-0,200	0,01	0,06	0,57%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045 - CÓDIGO: 15759226)		-2,14%	-4,94%	7,11%	6,45%	-0,09	-0,42	2,00%	1,75%	1,74%	-0,227	-0,061	-0,25	0,06	0,57%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045 - CÓDIGO: 15788865)		-2,15%	-4,93%	7,12%	6,46%	-0,08	-0,42	2,00%	1,75%	1,74%	-0,227	0,907	-0,24	0,06	0,57%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045 - CÓDIGO: 15788866)		-2,12%	-4,90%	7,15%	6,49%	-0,08	-0,42	2,00%	1,76%	1,75%	-0,230	0,907	-0,23	0,06	0,57%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 15838499)		0,36%	-2,34%	10,03%	9,36%	-0,12%	0,63	0,16	0,89%	1,52%	-0,458	0,001	12,42	0,05	0,25%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 15838500)		0,39%	-2,31%	10,06%	9,39%	-0,09%	0,63	0,17	0,91%	1,52%	-0,457	0,334	16,86	0,05	0,26%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 15860600)		0,39%	-2,31%	10,06%	9,39%	-0,09%	0,63	0,17	0,91%	1,52%	-0,457	0,334	-2,50	0,05	0,26%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 15860602)		0,39%	-2,31%	10,06%	9,39%	-0,09%	0,63	0,17	0,91%	1,52%	-0,457	0,334	10,16	0,05	0,26%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 15860603)		-0,28%	-2,97%	9,32%	8,66%	-0,76%	0,46	-0,11	1,04%	1,48%	-0,323	0,485	12,28	0,05	0,30%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 15917043)		-10,28%	-13,75%	-9,80%	-6,32%	-1,16	-1,32	3,09%	2,15%	2,21%	-0,156	0,036	-1,85	-0,03	0,92%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 17223138)		-9,50%	-12,95%	-10,88%	-2,74%	-1,04	-1,28	3,16%	2,20%	2,25%	-0,153	0,472	-1,63	0,07	0,94%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 17223139)		-9,50%	-12,95%	-10,88%	-2,74%	-1,04	-1,28	3,16%	2,20%	2,25%	-0,153	0,502	-1,83	0,07	0,94%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 17223140)		-9,50%	-12,95%	-10,88%	-2,74%	-1,04	-1,28	3,16%	2,20%	2,25%	-0,153	0,589	-1,84	0,07	0,94%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 17223141)		-21,80%	-23,05%	-13,83%	-11,31%	-1,39	-1,00	3,16%	3,06%	3,46%	0,424	0,611	-1,88	0,07	0,94%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 19447309)		-9,65%	-13,22%	-3,56%	-5,17%	-1,27	-1,35	3,24%	2,01%	2,40%	-0,140	-0,012	-2,46	0,06	0,96%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040 - CÓDIGO: 37517319)		-2,63%	-17,08%	-8,84%	-10,36%	-3,73	-1,13	2,19%	1,85%	1,88%	-0,625	-0,414	-8,00	0,07	0,63%
SUL AMERICA SELECTION FIC FIA		-29,66%	-42,08%	-29,47%	-35,29%	-0,37	-0,52	15,00%	16,40%	15,79%	-0,091	-0,015	-0,58	3,33	4,31%
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		0,00%	166,08%	198,68%	-20,29%	0,48	0,00	11,99%	8,65%	8,17%	-0,006	0,112	0,53	2,65	3,46%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA MAIOR DIVIDENDOS (FPI)		-16,87%	-14,32%	-5,60%	-16,99%	-0,06	-0,13	13,11%	8,96%	8,97%	-0,004	-0,230	0,39	2,27	3,78%
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO		14,45%	17,33%	36,70%	225,47%	0,43	0,35	3,38%	2,42%	2,10%	0,112	0,899	0,73	0,63	1,01%
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		38,73%	19,07%	38,73%	230,29%	0,11	0,30	10,39%	10,39%	9,52%	0,044	0,832	0,13	2,70	2,99%
SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA		-0,79%	-3,20%	-3,69%	5,66%	0,03	6,95	0,91%	1,93%	1,97%	0,184	0,884	0,05	0,35	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		-9,50%	-11,71%	-11,26%	-13,13%	-1,04	-0,75	4,18%	2,71%	0,00%	0,410	0,840	-3,21	0,30	1,21%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA		1,58%	-12,73%	-12,29%	-16,22%	-3,09	0,82	4,13%	2,34%	0,00%	0,167	0,874	-6,71	0,23	1,17%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA BPF-III TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		-5,15%	-8,74%	-8,28%	-12,39%	-0,17	-13,21	1,04%	1,03%	0,00%	0,484	0,882	5,62	0,09	0,29%
ICATU VANGUARDA IGBARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO		-4,73%	-9,63%	-9,17%	-13,24%	-2,97	-7,06	2,20%	1,88%	0,00%	0,782	0,788	6,01	0,00	0,64%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO		-12,70%	-0,87%	15,49%	174,97%	0,19	-0,17	6,80%	0,00%	1,06%	0,519	0,884	1,10	0,81	1,96%
TREND FOS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES		-33,10%	-37,26%	-26,90%	74,04%	-5,07	-2,07	2,87%	1,47%	1,47%	0,933	0,891	23,65	0,05	0,80%
TOTAL GENERAL		-53,77%													

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 consideramos para os cálculos o mês de início das atividades de captações dos ativos (Início do Fundo) quando posterior e 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 BVMF/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;

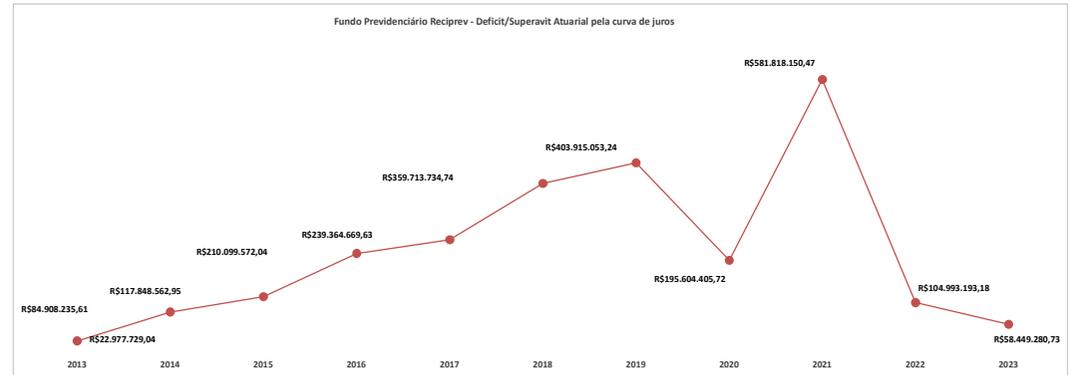
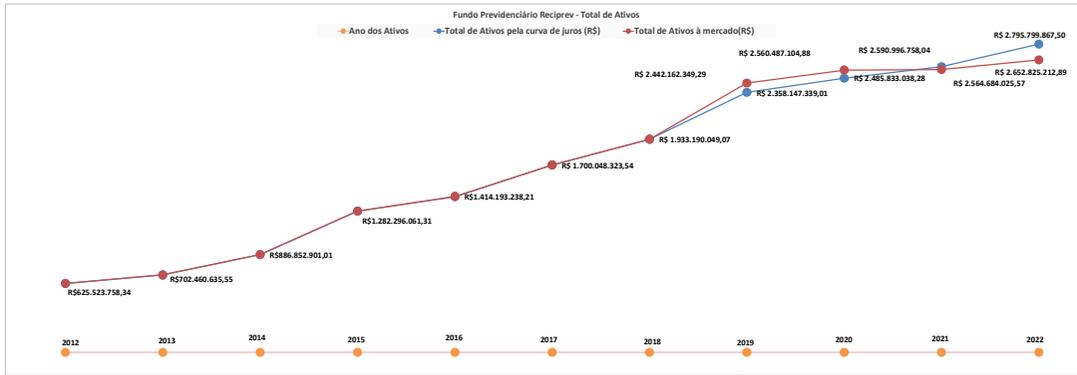
➤Correlação Ibovespa: Correlação do ativo com o Ibovespa, ou seja, como o ativo se movimentou em relação ao comportamento do Ibovespa.Se igual ou próximo de zero, não há correlação. Se positiva, próxima de +1, têm mesmo sentido de movimento. Se negativa, próxima de -1, têm sentidos opostos de movimentos;

➤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;

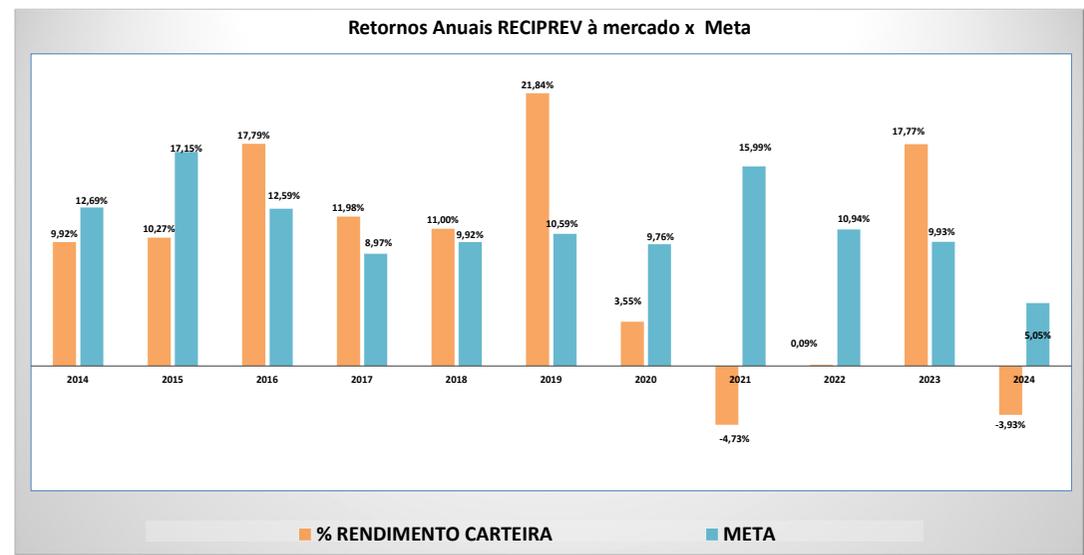
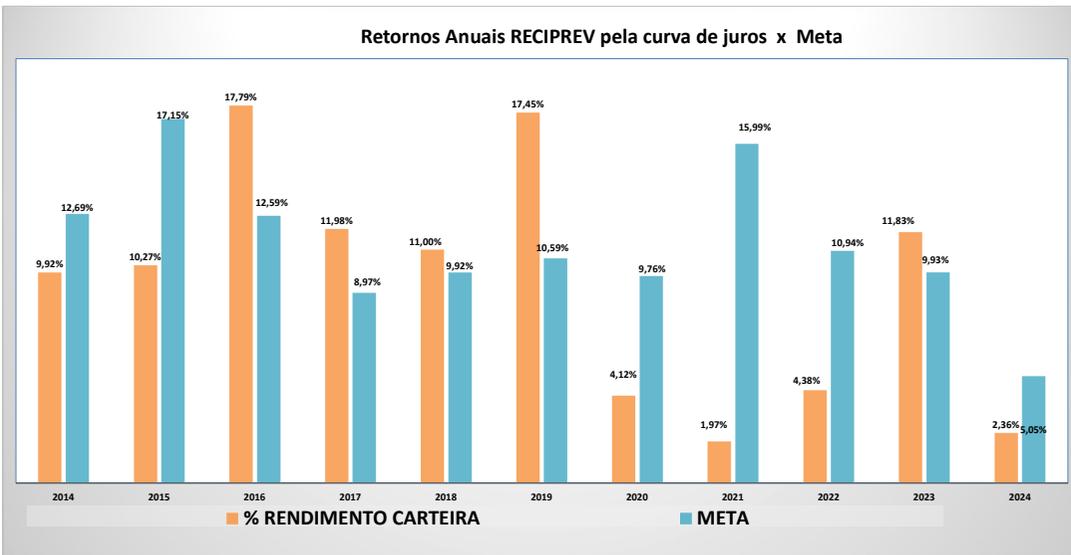
➤Índice Beta: Indicador que mede a sensibilidade do ativo em relação a uma carteira, no caso foi considerado o benchmark de cada ativo. Ativos financeiros de Beta elevado são considerados mais agressivos, enquanto os de Beta mais baixo são mais conservadores;

➤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	12	248	1	315
2024	6	142	0	179
TOTAIS	144	2.414	49	3.629

DATA SOLICITAÇÃO DA OPERAÇÃO	DATA COTIZAÇÃO DA OPERAÇÃO	DATA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	VALOR	APR	FUNDO	CNPJ	
07/03/2024	07/03/2024	07/03/2024	RESGATE	RS	137.534,93	43	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
08/03/2024	08/03/2024	08/03/2024	APLICAÇÃO	RS	4.008.154,40	44	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
12/03/2024	12/03/2024	12/03/2024	APLICAÇÃO	RS	5.015.541,49	45	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
13/03/2024	13/03/2024	13/03/2024	APLICAÇÃO	RS	1.432.125,44	46	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
14/03/2024	14/03/2024	14/03/2024	RESGATE	RS	71.230,69	47	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
14/03/2024	14/03/2024	14/03/2024	RESGATE	RS	1.000,00	48	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO_FII	20.716.161/0001-93
14/03/2024	14/03/2024	14/03/2024	APLICAÇÃO	RS	1.000,00	48	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
14/03/2024	14/03/2024	14/03/2024	APLICAÇÃO	RS	15.870.641,83	49	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
15/03/2024	15/03/2024	15/03/2024	RESGATE	RS	1.174.646,20	50	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
15/03/2024	15/03/2024	15/03/2024	RESGATE	RS	20.000.000,00	51	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
15/03/2024	15/03/2024	15/03/2024	APLICAÇÃO	RS	20.000.000,00	52	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRE-FH TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	07.111.384/0001-69
18/03/2024	18/03/2024	18/03/2024	RESGATE	RS	9.998.546,97	53	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
18/03/2024	18/03/2024	18/03/2024	APLICAÇÃO	RS	10.000.000,00	54	VF DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	16.375.255/0001-12
18/03/2024	18/03/2024	18/03/2024	RESGATE	RS	24.545.293,02	55	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	05.073.656/0001-58
18/03/2024	18/03/2024	18/03/2024	RESGATE	RS	5.940.767,31	56	CAIXA BRASIL IDMA-PCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.386.926/0001-71
18/03/2024	18/03/2024	18/03/2024	APLICAÇÃO	RS	5.347.521,52	57	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.503/0001-88
18/03/2024	18/03/2024	18/03/2024	APLICAÇÃO	RS	593.245,79	58	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
18/03/2024	18/03/2024	18/03/2024	APLICAÇÃO	RS	24.545.293,02	59	ITAU IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	14.437.684/0001-06
19/03/2024	19/03/2024	19/03/2024	RESGATE	RS	20.000.000,00	60	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDMA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35
19/03/2024	19/03/2024	19/03/2024	APLICAÇÃO	RS	20.000.000,00	61	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
19/03/2024	19/03/2024	19/03/2024	RESGATE	RS	593.245,79	62	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
19/03/2024	19/03/2024	19/03/2024	APLICAÇÃO	RS	593.245,79	63	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.503/0001-88
20/03/2024	20/03/2024	20/03/2024	RESGATE	RS	25.000.000,00	64	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
20/03/2024	21/03/2024	21/03/2024	APLICAÇÃO	RS	20.000.000,00	65	ICATU VANGUARDIA ISABATE LONG BIASED FI MULTIMERCADO	35.637.151/0001-30
20/03/2024	20/03/2024	20/03/2024	RESGATE	RS	1.215.884,81	66	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
21/03/2023	21/03/2023	21/03/2023	RESGATE	RS	31.483,60	67	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
21/03/2023	21/03/2023	21/03/2023	APLICAÇÃO	RS	916.114,17	68	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
22/03/2023	22/03/2023	22/03/2023	RESGATE	RS	14.000.000,00	69	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
22/03/2023	22/03/2023	22/03/2023	APLICAÇÃO	RS	14.000.000,00	70	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
21/03/2024	21/03/2024	21/03/2024	RESGATE	RS	31.483,60	67	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
21/03/2024	21/03/2024	21/03/2024	APLICAÇÃO	RS	916.114,17	68	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
22/03/2024	22/03/2024	22/03/2024	RESGATE	RS	14.000.000,00	69	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
22/03/2024	22/03/2024	22/03/2024	APLICAÇÃO	RS	14.000.000,00	70	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
26/03/2024	26/03/2024	26/03/2024	RESGATE	RS	13.830.807,19	71	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
28/03/2024	28/03/2024	28/03/2024	APLICAÇÃO	RS	675.634,20	72	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
01/04/2024	01/04/2024	01/04/2024	APLICAÇÃO	RS	4.556,37	73	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
02/04/2024	02/04/2024	02/04/2024	APLICAÇÃO	RS	43.115,47	74	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
02/04/2024	02/04/2024	02/04/2024	RESGATE	RS	2.657,93	75	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
02/04/2024	02/04/2024	02/04/2024	APLICAÇÃO	RS	2.316,72	76	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
03/04/2024	03/04/2024	03/04/2024	RESGATE	RS	830.070,78	77	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
04/04/2024	04/04/2024	04/04/2024	APLICAÇÃO	RS	15.238,18	78	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
04/04/2024	04/04/2024	04/04/2024	RESGATE	RS	2.147.173,48	79	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
05/04/2024	05/04/2024	05/04/2024	RESGATE	RS	27.930.873,34	80	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
05/04/2024	05/04/2024	05/04/2024	APLICAÇÃO	RS	33.000.000,00	81	BNB SOBERANO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	30.568.193/0001-42
08/04/2024	08/04/2024	08/04/2024	APLICAÇÃO	RS	5.925,84	82	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
08/04/2024	08/04/2024	08/04/2024	APLICAÇÃO	RS	10.318.966,99	83	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
09/04/2024	09/04/2024	09/04/2024	RESGATE	RS	1.759,16	84	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
11/04/2024	11/04/2024	11/04/2024	RESGATE	RS	12.638,68	85	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
12/04/2024	12/04/2024	12/04/2024	RESGATE	RS	59.452,01	86	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
12/04/2024	12/04/2024	12/04/2024	APLICAÇÃO	RS	1.500,00	87	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
15/04/2024	15/04/2024	15/04/2024	APLICAÇÃO	RS	1.453,03	88	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
15/04/2024	15/04/2024	15/04/2024	APLICAÇÃO	RS	11.344.269,80	89	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
15/04/2024	15/04/2024	15/04/2024	APLICAÇÃO	RS	948.474,60	90	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
19/04/2024	19/04/2024	19/04/2024	RESGATE	RS	52.952,88	91	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
19/04/2024	19/04/2024	19/04/2024	APLICAÇÃO	RS	101.434,94	92	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
22/04/2024	22/04/2024	22/04/2024	RESGATE	RS	20.392,77	93	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
23/04/2024	23/04/2024	23/04/2024	RESGATE	RS	7.937,76	94	SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	16.841.067/0001-99
23/04/2024	23/04/2024	23/04/2024	APLICAÇÃO	RS	7.937,76	95	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
24/04/2024	24/04/2024	24/04/2024	RESGATE	RS	12.000.000,00	96	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
24/04/2024	24/04/2024	24/04/2024	APLICAÇÃO	RS	12.000.000,00	97	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
25/04/2024	25/04/2024	25/04/2024	APLICAÇÃO	RS	1.605.764,92	98	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
29/04/2024	29/04/2024	29/04/2024	RESGATE	RS	14.543.954,74	99	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
30/04/2024	30/04/2024	30/04/2024	APLICAÇÃO	RS	1.316,72	101	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
02/05/2024	02/05/2024	02/05/2024	APLICAÇÃO	RS	1.518,79	102	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
06/05/2024	06/05/2024	06/05/2024	RESGATE	RS	72.365,74	103	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
06/05/2024	06/05/2024	06/05/2024	RESGATE	RS	27.077.038,48	100	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
06/05/2024	06/05/2024	06/05/2024	APLICAÇÃO	RS	25.000.000,00	100	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.503/0001-88
07/05/2024	07/05/2024	07/05/2024	RESGATE	RS	1.308.984,74	104	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
08/05/2024	08/05/2024	08/05/2024	APLICAÇÃO	RS	2.072.150,96	105	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
09/05/2024	09/05/2024	09/05/2024	RESGATE	RS	218,89	106	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
10/05/2024	10/05/2024	10/05/2024	APLICAÇÃO	RS	3.657,93	108	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
10/05/2024	10/05/2024	10/05/2024	APLICAÇÃO	RS	60.500,00	107	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
10/05/2024	10/05/2024	10/05/2024	APLICAÇÃO	RS	750.509,66	108	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
13/05/2024	13/05/2024	13/05/2024	APLICAÇÃO	RS	11.112.746,53	109	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
14/05/2024	14/05/2024	14/05/2024	APLICAÇÃO	RS	1.453,03	110	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
14/05/2024	14/05/2024	14/05/2024	APLICAÇÃO	RS	14.363.202,39	111	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	500,00	112	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO_FII	20.716.161/0001-93
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	APLICAÇÃO	RS	500,00	112	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	APLICAÇÃO	RS	158.318,89	113	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	1.262.489,49	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219 (7604)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	2.714.352,39	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220 (7608)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	1.262.489,49	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 (7647)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	1.262.489,49	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571 (7632)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	1.262.489,49	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759226)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	1.262.489,49	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759225)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	1.262.489,49	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759224)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	3.254.950,39	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 19447309)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	2.524.978,97	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786866)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	RESGATE	RS	3.787.468,46	113-A	TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786865)	-
15/05/2024	15/05/2024	15/05/2024	APLICAÇÃO	RS	19.854.684,36	113-A	TRE	

DATA SOLICITAÇÃO DA OPERAÇÃO	DATA COTIZAÇÃO DA OPERAÇÃO	DATA LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	VALOR	APR	FUNDO	CNPJ
27/05/2024	27/05/2024	27/05/2024	RESGATE	R\$ 12.409.128,03	115	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
27/05/2024	27/05/2024	27/05/2024	APLICAÇÃO	R\$ 12.409.128,03	116	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
28/05/2024	28/05/2024	28/05/2024	APLICAÇÃO	R\$ 1.123.434,93	117	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
28/05/2024	28/05/2024	28/05/2024	RESGATE	R\$ 13.252.489,47	118	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
29/05/2024	29/05/2024	29/05/2024	RESGATE	R\$ 11.208.525,00	119	SUA AMERICA SELECTION FIC FIA	34.525.068/0001-06
29/05/2024	29/05/2024	29/05/2024	RESGATE	R\$ 3.107.610,18	120	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
31/05/2024	31/05/2024	31/05/2024	RESGATE	R\$ 66.500,96	121	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
03/06/2024	03/06/2024	03/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 11.210.043,79	122	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
04/06/2024	04/06/2024	04/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 3.296.296,87	123	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
04/06/2024	04/06/2024	04/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 1.316,72	124	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
05/06/2024	05/06/2024	05/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 2.007.160,68	125	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
06/06/2024	06/06/2024	06/06/2024	RESGATE	R\$ 22.119,17	126	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
10/06/2024	10/06/2024	10/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 2.747.024,23	127	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
12/06/2024	12/06/2024	12/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 10.486.753,64	128	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
13/06/2024	13/06/2024	13/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 1.453,03	129	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
13/06/2024	13/06/2024	13/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 11.603.204,33	130	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
14/06/2024	14/06/2024	14/06/2024	RESGATE	R\$ 11.998.500,00	131	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05
14/06/2024	14/06/2024	14/06/2024	RESGATE	R\$ 15.897.559,25	132	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
14/06/2024	17/06/2024	17/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 15.000.000,00	133	AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FIA	37.569.846/0001-57
18/06/2024	18/06/2024	18/06/2024	RESGATE	R\$ 7.916,89	133.A	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
19/06/2024	19/06/2024	19/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 70.120,57	134	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
20/06/2024	20/06/2024	20/06/2024	RESGATE	R\$ 13.880.614,48	135	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
20/06/2024	20/06/2024	20/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 13.880.614,48	136	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
21/06/2024	21/06/2024	21/06/2024	RESGATE	R\$ 2.405,17	137	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
27/06/2024	27/06/2024	27/06/2024	RESGATE	R\$ 28.358.006,77	138	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55
27/06/2024	27/06/2024	27/06/2024	RESGATE	R\$ 13.824.000,44	139	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14
27/06/2024	27/06/2024	27/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 15.000.000,00	140	BRADESCO INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	44.315.854/0001-32
27/06/2024	27/06/2024	27/06/2024	APLICAÇÃO	R\$ 15.000.000,00	141	INTER CORPORATE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	36.443.522/0001-05
28/06/2024	28/06/2024	28/06/2024	RESGATE	R\$ 225,92	142	CAIXA BRASIL DESPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55

PANORAMA MACROECONÔMICO

No mês de junho podemos observar uma melhora em relação a perspectiva de juros nos Estados Unidos. Os dados do mercado de trabalho no país norte-americano mostraram convergência ao cenário contracionista, indicando um certo otimismo dos analistas em relação ao corte de juros no ano corrente. A perspectiva é de dois cortes de juros, começando em setembro. O movimento teve reflexo nos ativos brasileiros, que mostraram melhora na segunda metade do mês de junho. Tivemos o fechamento razoável nas taxas de juros, que estimularam os preços dos títulos marcados à mercado a subirem, além de uma leve recuperação do Ibovespa, que fechou o mês com 1,48% positivo, após sequência de três meses negativo. A carteira de investimentos fechou o mês com a rentabilidade de 0,84% ante a meta atuarial de 0,61%, influenciada principalmente pela inflação projetada, que ainda não alcançou níveis satisfatórios.

DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

IPCA do mês de	JUNHO	0,21%	Meta Atuarial para o Ano de 2023				IPCA + 5,15% ao ano	
Meta Atuarial para o mês de	JUNHO	0,61%	Meta Atuarial acumulada no ano de 2023				5,05%	
Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em	JUNHO	0,83%	Renda Fixa	0,71%	Renda Variável	1,22%	Exterior	0,00%
Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2023 em		2,26%	Estruturados	1,00%	Imobiliários	-0,68%	Consignados	0,00%
Diferença de retorno em relação a meta atuarial acumulada no ano de 2023		0,00%						

Sendo

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

Gutemberg Peixoto Calazans Filho

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

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), 15 de julho de 2024

ASSINATURAS