RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE

RECIPREV

AUTARQUIA MUNCIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDORES

RELATÓRIO DE RISCOS MENSAL E ACUMULADO ANUAL DOS INVESTIMENTOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV (CONTEMPLA OS RELATÓRIOS TRIMESTRAIS)

DATA	30/08/2024

1. RISCOS DE MERCADO

FUNDO	CNPJ	Gestor	Tipo	Enquadramento Resl. 4.963/21	Benchmark	Saldo	Prazo de Duração do Fundo	Prazo de Resgate	Liquidez	Volatilidade Atribuida ao Fundo pelo Administrador	Conceito da Volatilidade representada	Risco Mensal Período	Risco Mensal 12 MESES	Risco Anual do Período	Retorno Relativo ao Benchmark	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	11.392.165/0001-72	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	Índice Small Cap	R$ 63.789.416,41	Indeterminado	D +29	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	5,80%	4,91%	20,08%	-0,80%	10,74%	10,62%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Renda Fixa	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III,"a"	CDI	R$ 21.926.509,92	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	2	Risco Baixo	0,32%	0,06%	1,12%	-12,10%	1,19%	1,34%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	19.303.795/0001-35	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IPCA + 6,00%	R$ -	Indeterminado	D+0	Longo Prazo	5	Risco Muito Alto	0,78%	0,20%	2,69%	-11,46%	2,17%	2,18%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	19.523.306/0001-50	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IMA-B	R$ 11.861.437,58	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	4	Risco Alto	1,22%	0,20%	4,23%	36,58%	2,91%	2,90%
BNP PARIBAS ACTION FIC FI AÇÕES	12.239.939/0001-92	BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 15.095.712,40	Indeterminado	D+29	Curto Prazo	4	Risco Alto	4,91%	4,67%	17,02%	202,16%	9,18%	8,73%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	11.108.013/0001-03	BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	SMLL	R$ 21.245.494,05	Indeterminado	D+7	Curto Prazo	4	Risco Alto	6,44%	5,89%	22,33%	174,73%	11,44%	10,43%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	Renda Fixa	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III,"a"	CDI	R$ 247.489,12	Indeterminado	D +0	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,07%	0,06%	3,72%	-38,90%	2,18%	2,49%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES MID SMALL CAPS	06.988.623/0001-09	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBRX	R$ 44.474.586,25	Indeterminado	D+3	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,76%	5,99%	19,96%	60,21%	10,24%	9,41%
LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO LF00220095R (12882370000000002688)	00.066.670/0001-00	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	Renda Fixa	Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras - Art. 7º, IV	IPCA+6,71%	R$ 230.340.623,45	5 anos (1.826 dias). Vence 23/03/2027	23/03/2027	Médio Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,37%	0,15%	1,29%	0,00%	1,46%	1,51%
LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO LF002200LEI (12882370000000003145)	00.066.670/0001-00	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	Renda Fixa	Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras - Art. 7º, IV	IPCA+6,60%	R$ 98.974.407,25	5 anos (1.826 dias). Vence 17/08/2027	23/03/2027	Médio Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,31%	0,20%	1,06%	0,00%	1,36%	1,36%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	18.598.288/0001-03	CAIXA DTVM S/A	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IMA-B	R$ -	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	3	Risco Médio	1,54%	0,22%	5,33%	-66,97%	3,42%	3,39%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	20.139.595/0001-78	CAIXA DTVM S/A	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IMA-B	R$ -	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	3	Risco Médio	1,43%	0,22%	4,94%	-86,67%	3,18%	3,21%

FUNDO	CNPJ	Gestor	Tipo	Enquadramento Resl. 4.963/21	Benchmark	Saldo	Prazo de Duração do Fundo	Prazo de Resgate	Liquidez	Volatilidade Atribuida ao Fundo pelo Administrador	Conceito da Volatilidade representada	Risco Mensal Período	Risco Mensal 12 MESES	Risco Anual do Período	Retorno Relativo ao Benchmark	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	19.769.046/0001-06	CAIXA DTVM S/A	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IMA-B	R$ 7.475.395,32	Indeterminado	D+2143	Longo Prazo	3	Risco Médio	2,37%	1,43%	8,21%	-13,56%	4,74%	4,28%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	20.139.534/0001-00	CAIXA DTVM S/A	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IMA-B	R$ 11.816.349,30	Indeterminado	D+2153	Longo Prazo	3	Risco Médio	2,39%	1,43%	8,29%	-28,29%	4,62%	4,32%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	30.068.224/0001-04	CAIXA DTVM S/A	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 44.965.885,34	Indeterminado	D+25	Curto Prazo	4	Risco Alto	6,92%	4,71%	23,99%	-30,79%	11,96%	12,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	CAIXA DTVM S/A	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC Art. 7º, I, b	CDI	R$ 13.463.794,98	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,29%	0,07%	1,00%	-16,51%	1,13%	1,28%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	13.455.117/0001-01	SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC Art. 7º, I, b	IMA-B 5	R$ 25.825.117,33	Indeterminado	D+1	Curto Prazo	3	Risco Médio	0,83%	0,62%	2,88%	-1,41%	1,95%	2,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.503/0001-88	CAIXA DTVM S/A	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC Art. 7º, I, b	IMA-B 5+	R$ 31.675.229,02	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	3	Risco Médio	3,07%	2,33%	10,63%	-6,96%	5,21%	5,33%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CAIXA DTVM S/A	Renda Fixa	Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, a	CDI	R$ 42.232.735,35	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,30%	1,92%	1,03%	202,51%	1,24%	1,53%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	14.437.684/0001-06	ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC Art. 7º, I, b	IMA-B 5+	R$ 24.632.751,67	Indeterminado	D+1	Curto Prazo	4	Risco Alto	3,10%	2,34%	10,75%	-35,69%	5,25%	5,37%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M TITULOS PUBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	07.111.384/0001-69	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC Art. 7º, I, b	IRF-M	R$ 20.414.391,42	Indeterminado	D+1	Curto Prazo	3	Risco Médio	0,99%	0,81%	3,44%	-2,40%	2,28%	2,28%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	35.637.151/0001-30	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	Fundos Estruturados	Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I	IMA GERAL	R$ 26.202.725,83	Indeterminado	D+32	Curto Prazo	4	Risco Alto	4,59%	0,08%	15,90%	0,64%	8,44%	8,47%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	11.182.064/0001-77	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 99.095.358,12	Indeterminado	D +15	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,85%	4,86%	20,26%	48,17%	10,50%	10,32%
FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	05.964.067/0001-60	FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 27.257.574,89	Indeterminado	D +3	Curto Prazo	4	Risco Alto	7,11%	5,17%	24,64%	85,90%	12,64%	13,05%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.115.118/0001-70	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IMA-B	R$ 14.153.878,18	Indeterminado	D+3	Curto Prazo	2	Risco Baixo	0,51%	1,49%	1,76%	-13,17%	0,00%	1,21%
OCCAM FIC FIA	11.628.883/0001.03	OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 38.864.061,23	Indeterminado	D+15	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,47%	4,25%	18,94%	109,46%	9,96%	10,11%
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	12.312.767/0001-35	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	Fundos Estruturados	Fundos de Investimento em Participações (FIP) - Art. 10, II	IPCA+9,00%	R$ 6.148.308,75	6 anos (2.190 Dias)	D+0	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	5,70%	0,01%	19,75%	-77,11%	9,40%	9,34%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	20.716.161/0001-93	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	Fundos Imobiliários	Fundos de Investimento Imobiliário (FII) - Art. 11	IPCA + 6,9506%	R$ 446.922,20	10 anos (3.650 Dias)	D+0	Curto Prazo	3	Risco Médio	8,37%	20,25%	29,00%	-85,68%	14,75%	15,25%
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	16.841.067/0001-99	SINGULARE CTVM S.A.	Fundos Imobiliários	Fundos de Investimento Imobiliário (FII) - Art. 11	IPCA+7,50%	R$ 1.638.797,92	30/11/2028	D +3	Médio Prazo	3	Risco Médio	6,08%	1,15%	21,08%	30,03%	11,73%	10,32%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	13.633.964/0001-19	SINGULARE CTVM S.A.	Fundos Estruturados	Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior - Art. 7º, V,"a"	125% do DI	R$ 5.255,16	10 anos (3.650 Dias)	D +1080	Médio Prazo	5	Risco Muito Alto	96,46%	52,43%	334,15%	-99,94%	179,21%	189,30%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219 (7604)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+7.002299%	R$ 39.497.070,66	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	3,54%	0,15%	12,25%	0,11%	6,63%	6,75%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220 (7608)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+7.002655%	R$ 84.915.083,19	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	3,54%	0,15%	12,25%	-3,48%	6,63%	6,75%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 (7647)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+6.261127%	R$ 42.818.832,68	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	3,29%	0,14%	11,38%	86,72%	6,23%	6,28%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571 (7632)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+6.269771%	R$ 42.777.488,14	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	3,29%	0,14%	11,39%	63,38%	6,23%	6,29%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759224)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,86%	R$ 50.327.657,42	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,57%	0,14%	1,99%	-1,50%	1,72%	1,72%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759225)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,86%	R$ 50.327.657,42	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,57%	0,14%	1,99%	-1,50%	1,72%	1,72%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759226)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,86%	R$ 50.327.657,42	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,57%	0,14%	1,99%	-1,50%	1,72%	1,72%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786865)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,865%	R$ 150.892.730,67	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,57%	0,14%	1,99%	-1,50%	1,72%	1,72%

FUNDO	CNPJ	Gestor	Tipo	Enquadramento Resl. 4.963/21	Benchmark	Saldo	Prazo de Duração do Fundo	Prazo de Resgate	Liquidez	Volatilidade Atribuida ao Fundo pelo Administrador	Conceito da Volatilidade representada	Risco Mensal Período	Risco Mensal 12 MESES	Risco Anual do Período	Retorno Relativo ao Benchmark	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786866)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,865%	R$ 100.595.153,78	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,57%	0,14%	1,99%	-1,48%	1,72%	1,72%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836499)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,93%	R$ 145.064.833,44	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,39%	0,14%	1,35%	1,04%	1,49%	1,42%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15836500)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,94%	R$ 48.305.313,77	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,39%	0,14%	1,35%	1,08%	1,50%	1,42%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860600)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,94%	R$ 48.305.313,77	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,39%	0,14%	1,35%	1,08%	1,50%	1,42%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860602)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,94%	R$ 24.152.656,89	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,39%	0,14%	1,35%	1,08%	1,50%	1,42%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15860603)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+4,94%	R$ 193.221.255,08	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,38%	0,14%	1,31%	0,40%	1,46%	1,40%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 15917043)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+5,00%	R$ 55.690.336,20	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,98%	0,14%	3,39%	-9,68%	2,11%	2,40%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223138)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+5,265%	R$ 46.728.912,86	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,00%	0,14%	3,47%	-8,90%	2,16%	2,44%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223139)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+5,265%	R$ 140.186.738,58	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,00%	0,14%	3,47%	-8,90%	2,16%	2,44%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223140)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+5,265%	R$ 186.915.651,44	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,00%	0,14%	3,47%	-8,90%	2,16%	2,44%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 17223141)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+5,265%	R$ 46.705.219,59	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,72%	0,14%	5,95%	-21,28%	3,01%	3,62%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 19447309)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+5,730%	R$ 117.205.656,59	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,91%	0,14%	3,17%	-9,06%	1,98%	2,35%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2040- CÓDIGO: 37517319)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I,"a"	IPCA+5,775%	R$ 279.279.282,97	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,74%	0,14%	2,57%	-1,99%	1,79%	2,05%
SOMMA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	14.550.994/0001-24	SOMMA INVESTIMENTOS S/A	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 37.317.397,42	Indeterminado	D +3	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,70%	4,68%	19,74%	-30,68%	10,08%	10,49%
BNB SOBERANO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	30.568.193/0001-42	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	CDI	R$ 124.040.621,65	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,38%	0,07%	1,33%	9,57%	1,27%	1,52%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	28.206.220/0001-95	SOMMA INVESTIMENTOS S/A	Renda Fixa	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V,"b"	CDI	R$ 7.983.621,76	Indeterminado	D +1	Curto Prazo	2	Risco Baixo	0,58%	0,19%	2,01%	21,45%	1,63%	2,01%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	07.882.792/0001-14	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 88.996.648,90	Indeterminado	D+4	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	6,27%	4,79%	21,72%	66,97%	11,01%	11,14%
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	07.488.106/0001-25	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 51.360.879,57	Indeterminado	D+3	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	4,70%	4,61%	16,28%	0,00%	8,68%	9,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15.154.441/0001-15	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IDIV	R$ 94.428.808,89	Indeterminado	D+3	Curto Prazo	4	Risco Alto	4,98%	3,96%	17,25%	-27,27%	8,99%	9,73%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IDKA IPCA 2A	R$ 18.621.484,52	Indeterminado	D+1	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,78%	0,62%	2,69%	201,13%	2,10%	1,91%
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.146.491/0001-98	XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	IPCA	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III,"a"	IPCA	R$ 37.305.897,00	Indeterminado	D +5	Curto Prazo	4	Risco Alto	0,98%	1,09%	3,38%	12,30%	2,42%	2,21%
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	16.575.255/0001-12	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	Sem benchmark	R$ 42.980.780,64	Indeterminado	D +4	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,64%	5,45%	19,54%	25,26%	10,39%	10,99%

ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	**35.637.151/0001-30**	**BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)**	**Fundos Estruturados**	**Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I**	**IMA GERAL**	**26202725,83**	**Indeterminado**	**D+32**	**Curto Prazo**	**4**	**Risco Alto**	**0,045906426**	**0,000756561**	**0,159024526**	**0,006355268**	**0,084398698**	**0,084706658**
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.115.118/0001-70	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IMA-B	R$ 14.153.878,18	Indeterminado	D+3	Curto Prazo	2	Risco Baixo	0,51%	1,49%	1,76%	-13,17%	0,00%	1,21%
BTG PACTUAL OPORTUNIDADES LISTADAS I FI AÇÕES	46.300.375/0001-78	BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS S.A. DTVM	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	Ibovespa	R$ 14.746.288,92	Indeterminado	D+367	Médio Prazo	4	Risco Alto	4,87%	4,29%	16,88%	-66,83%	0,00%	8,49%
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO	55.771.625/0001-49	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	Fundos Estruturados	Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I	Não possui	R$ 14.989.361,13	Indeterminado	D+721	Médio Prazo	5	Risco Muito Alto	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
TREND PÓS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES	26.559.284/0001-44	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	CDI	R$ 60.592.235,45	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,51%	0,07%	1,08%	-58,67%	1,51%	1,72%
AZ QUEST BAYES SISTEMATICO ACOES FIA	26.559.284/0001-44	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	CDI	R$ 16.713.923,08	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	5,30%	5,11%	18,38%	-13,01%	9,61%	9,61%
BRADESCO INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	44.315.854/0001-32	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	CDI	R$ 15.270.837,45	Indeterminado	D+30	Curto Prazo	2	Risco Baixo	0,63%	0,63%	2,19%	-0,30%	1,84%	1,83%
INTER CORPORATE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	36.443.522/0001-05	INTER ASSET GESTÃO DE RECURSOS LTDA	Renda Fixa	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V,"b"	CDI	R$ 15.284.000,02	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	3	Risco Médio	0,36%	0,07%	1,24%	-3,06%	1,54%	1,51%
TOTAL GERAL	**07.749.668/0001-85**	**RECIPREV**	-	-	**META**	**R$ 3.569.500.101,37**	**Risco Ponderado da Carteira**			**1,85**		**1,79%**	**0,92%**	**6,19%**	**-53,24%**	**3,77%**	**3,76%**

EXPLICAÇÕES DOS DADOS ESTATÍSTICOS

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

***Período de análise: A partir de janeiro de 2011 até o mês deste relatório, ou consideramos para os cálculos o mês de início das atividades de captações dos ativos (Início do Fundo) quando posterior a janeiro de 2011. Não são consideradas as datas exatas em que o RECIPREV efetuou as aplicações ou resgates no ativo. Este fato, altera os cálculos, em particular, no mês do referido evento, para mais ou para menos em todos os indicadores desta planilha, porém, não de forma significativa;*

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

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

➢ ***Benchmark** : Indicador de retorno do fundo;*

➢ ***Prazo de Duração do Fundo** : Prazo do fundo informado pelo Administrador ou Gestor e constante do credenciamento;*

➢ ***Prazo de Resgate** : Prazo que o fundo pago quando da solicitação do resgate ou de seu vencimento;*

➢ ***Liquidez** : Prazos de pagamento dos recursos criado pela Gerência de Investimentos, que compreende: a) Até 60 dias (Curto Prazo); b) Acima de 60 dias até 5 anos (Médio Prazo) e acima de 5 anos (Longo Prazo);*

➢ ***Volatilidade Atribuida ao Fundo pelo Administrador** : Indicador que varia de 1 a 5, com relação a Volatilidade do Fundo. Quem estabelece o indicador é o Administrador do Fundo. 1-Risco Muito baixo; 2- Risco Baixo; 3-Risco Médio; 4- Riscxo Alto e 5-Risco Muito Alto;*

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

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

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

➢ ***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;*

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

➢ ***VAR (95%):** Valor esperado da perda máxima ou da pior perda em um horizonte de tempo em um intervalo de confiança;*

2. RISCO DA CARTEIRA (CONCEITO DE VOLATILIDADE); VAR GERAL DA CARTEIRA; VOLATILIDADE DA CARTEIRA; PRAZOS DA CARTEIRA E RATINGS DE QUALIDADE DE GESTÃO

RISCO DA CARTEIRA COM BASE NA NOTA DO ADMINISTRADOR (CONCEITO DE VOLATILIDADE DA CARTEIRA)		VAR DA CARTEIRA	
DATA	**RISCO**	**VAR HISTÓRICO (95%)**	**VAR 12 MESES (95%)**
JANEIRO	1,82	3,82%	3,84%
FEVEREIRO	1,82	3,81%	3,96%
MARÇO	1,84	3,80%	3,90%
ABRIL	1,80	3,79%	3,72%
MAIO	1,81	3,78%	3,58%
JUNHO	1,83	3,78%	3,58%
JULHO	1,84	3,77%	3,76%
AGOSTO	1,85	3,77%	3,76%
SETEMBRO			
OUTUBRO			
NOVEMBRO			
DEZEMBRO			

VOLATILIDADE DA CARTEIRA				
CONCEITOS	**TIPO VOLATILIDADE**	**VALOR**		**%**
Até 1	Volatilidade Muito Baixa	R$	2.549.467.817,40	71,42%
Acima de 1 até 2	Volatilidade Baixa	R$	73.488.725,48	2,06%
Acima de 2 até 3	Volatilidade Média	R$	114.576.202,53	3,21%
Acima de 3 até 4	Volatilidade Alta	R$	606.677.486,05	17,00%
Acima de 4 até 5	Volatilidade Muito Alta	R$	225.289.869,92	6,31%
TOTAL		R$	3.569.500.101,37	100,00%

PRAZOS DA CARTEIRA			
TIPO	**VALOR**		**%**
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R$	1.245.273.120,36	34,89%
MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)	R$	360.694.733,83	10,10%
LONGO PRAZO (+ de 5 anos)	R$	1.963.532.247,17	55,01%
TOTAL	R$	3.569.500.101,37	100,00%

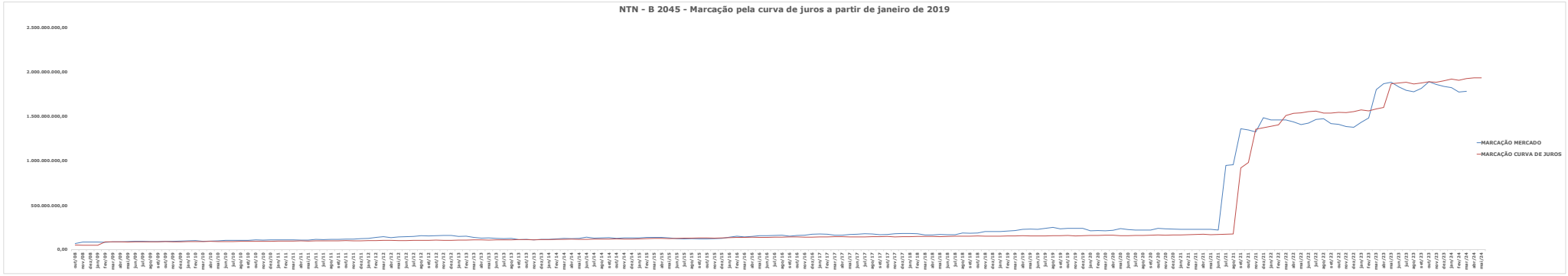
RATINGS DOS GESTORES DE INVESTIMENTOS		
CONCEITOS		
TIPO	**VALOR**	**%**
Muito bom	R$ 146.655.119,94	4,11%
Bom	R$ 45.747.941,37	1,28%
Excelente	R$ 710.279.332,92	19,90%
NTN-B 2045	R$ 2.666.817.707,14	74,71%
TOTAL	R$ 3.569.500.101,37	100,00%

3. FUNDOS E TÍTULOS MARCADOS PELA CURVA DE JUROS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

1- 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: 10359220; TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 e TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571, passaram a ser marcados pela "CURVA DE JUROS", de aquisição dos títulos, respectivamente: IPCA+7.002299%%;IPCA+7.0026555%;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 até o 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", 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, período em que 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 e tsmbém passamos em 2022, a adquirir Letras Financeira marcadas pela curva de juros.

2- O fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 19.303.795/0001-35, também, possui marcação pela curva de juros.

4. GRÁFICO DAS NTN-B 2045 (MARCAÇÃO PELA CURVA DE JUROS X MARCAÇÃO À MERCADO) DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV



5. RISCOS DE ADMINISTRADOR - GRUPO ECONÔMICO

ADMINISTRADORES DE RECURSOS	GRUPO ECONÔNIMICO DO ADMINISTRADOR DE RECURSOS	GESTORES DE RECURSOS			
BB DTVM		**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R$	161.820.472,33	4,59%
		RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R$	446.922,20	0,01%
		TOTAL	**R$**	**162.267.394,53**	**4,60%**
CAIXA	CAIXA	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		CAIXA DTVM S/A	R$	151.629.389,30	4,30%
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R$	94.428.808,89	2,68%
		TOTAL	**R$**	**246.058.198,19**	**6,97%**
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL) Valor na Curva	**R$**	**1.944.240.502,55**	**55,09%**
		TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL) Valor à Mercado	**R$**	**1.787.065.473,05**	**53,00%**
Bradesco	Bradesco	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R$	15.518.326,57	0,44%
		BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R$	329.315.030,70	9,33%
		TOTAL	**R$**	**344.833.357,27**	**9,77%**
bradesco bem dtvm	Bradesco	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R$	44.474.586,25	1,26%
		CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R$	99.095.358,12	2,81%
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R$	51.360.879,57	1,46%
		ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$	26.202.725,83	0,74%
		MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R$	14.153.878,18	0,40%
		AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R$	63.789.416,41	1,81%
		SOMMA INVESTIMENTOS S/A	R$	45.301.019,17	1,28%
		FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	R$	27.257.574,89	0,77%
		BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVESTIMENTOS LTDA	R$	16.713.923,08	0,47%
		OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$	38.864.061,23	1,10%
		RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R$	14.989.361,13	0,42%
		TOTAL	**R$**	**442.202.783,86**	**12,53%**
Santander	Santander	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	R$	124.040.621,65	3,51%
		XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	R$	37.305.897,00	1,06%
		XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$	42.980.780,64	1,22%
		SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	R$	25.825.117,33	0,77%
		TOTAL	**R$**	**230.152.416,62**	**6,56%**
Itaú Asset	Itaú	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA	R$	24.632.751,67	**0,70%**
		TOTAL	**R$**	**24.632.751,67**	**0,70%**
BNY MELLON	BNY MELLON	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R$	6.148.308,75	0,17%
		TOTAL	**R$**	**6.148.308,75**	**0,17%**
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	R$	36.341.206,45	1,03%
		TOTAL	**R$**	**36.341.206,45**	**1,03%**
singulare	singulare	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		SINGULARE CTVM S.A.	R$	1.644.053,08	0,05%
		TOTAL	**R$**	**1.644.053,08**	**0,05%**
xp investimentos	xp investimentos	**GESTOR**		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	R$	60.592.235,45	1,72%
		TOTAL	**R$**	**60.592.235,45**	**1,72%**
inter	inter	INTER ASSET GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$	15.284.000,02	0,43%
		TOTAL	**R$**	**15.284.000,02**	**0,43%**
btg pactual	btg pactual	BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS S.A. DTVM	R$	14.746.288,92	
			R$	**14.746.288,92**	
RECIPREV	RECIFE PREFEITURA DA CIDADE	**TOTAL GERAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV** Valor na Curva	**R$**	**3.529.143.497,37**	**100%**
		Valor à Mercado	**R$**	**3.371.968.467,86**	

6. RISCO DE MERCADO E DE CRÉDITO DOS FUNDOS DE DIREITOS CREDITÓRIOS (FIDIC) E FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÃO (FIP)

6.1 FUNDOS DE DIREITOS CREDITÓRIOS (FIDIC)

FUNDO	GESTOR	ADMINISTRADOR
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	SINGULARE CTVM	SINGULARE CTVM

MOVIMENTAÇÕES JUNTO AO FUNDO DE INVESTIMENTOS DUNAS

DATA	TIPO	VALOR	APR
09/11/2016	APLICAÇÃO	-R$ 5.000.000,00	APR 144 2016
17/01/2017	APLICAÇÃO	-R$ 2.000.000,00	APR 006 2017
10/11/2017	RESGATE	R$ 2.700.000,00	APR 134 e 155 2017
14/11/2017	SOLICITADO RESGATE TOTAL, PORÉM, HOUVE A SUSPENSÃO DE PAGAMENTO PELO ADMINISTRADOR	TOTAL	APR 160 2017
12/12/2017	OFICIO SOLICITANDO EXPLICAÇÕES DO NÃO PAGAMDENTO DO RESGATE SOLICITADO EM 14/11/2017	TOTAL	OFICIO 27A
12/12/2017	RESPOSTA DA SOCOPA INFORMANDO SOBRE A SUSPENSÃO DOS RESGATES	-	E-mail
31/01/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 426.621,02	APR 028 2018
28/02/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 284.414,01	APR 057 2018
29/03/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 101.805,69	APR 077 2018
30/04/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 18.349,96	APR 104 2018
30/05/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 19.176,57	APR 127 2018
03/07/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 38.679,03	APR 155 2018
02/08/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 38.158,86	APR 178 2018
04/09/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 20.085,66	APR 201 2018
05/10/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 24.744,02	APR 226 2018
08/11/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 29.283,72	APR 249 2018
05/12/2018	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 13.355,60	APR 279 2018
09/01/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 17.072,58	APR 003 2019
07/02/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 24.730,98	APR 025 2019
11/03/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 21.719,14	APR 047 2019
05/04/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 3.340,30	APR 090 2019
08/05/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 20.163,03	APR 120 2019
10/06/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 12.601,11	APR 146 2019
05/07/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 4.124,52	APR 162 2019
05/08/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 5.716,27	APR 182 2019
06/09/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 6.138,95	APR 202 2019
07/10/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 6.941,86	APR 228 2019
08/11/2019	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 5.681,57	APR 248 2019
05/02/2021	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 4.600,75	APR 248 2019
07/03/2022	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 11.092,15	APR 33 2022
09/10/2023	AMORTIZAÇÃO/JUROS	R$ 21.274,18	APR 188 2023
	Valor RECEBIDO	R$ 3.879.871,53	
	Valor a RECEBER	-R$ 3.120.128,47	**0,09%** **do total da carteira na curva** **0,09%** **do total da carteira à mercado**

DATA RELTATÓRIO	EMPRESA DE RATING	TIPO RATING	CONCEITO
17/06/2016	Austin Ratings	AA-	**Qualidade de crédito muito alta**
08/09/2016	Liberum Ratings	A	**Qualidade de crédito alta**
01/10/2016	Liberum Ratings	A	**Qualidade de crédito alta**
18/11/2016	Austin Ratings	AA-	**Qualidade de crédito muito alta**
17/02/2017	Austin Ratings	BBB	**Qualidade de crédito boa**
23/02/2017	Liberum Ratings	BBB-	**Qualidade de crédito boa**
23/05/2017	Liberum Ratings	BBB-	**Qualidade de crédito boa**
15/08/2017	Austin Ratings	BBB	**Qualidade de crédito boa**
16/08/2017	Liberum Ratings	BBB-	**Qualidade de crédito boa**
09/11/2017	Liberum Ratings	BB	**Qualidade de crédito regular**
27/11/2017	Austin Ratings	BB-	**Qualidade de crédito regular**
16/01/2018	Liberum Ratings	B	**Baixa capacidade para honrar compromissos**
06/02/2018	Austin Ratings	CCC	**Elevado risco de não honrar compromissos**
26/02/2018	Liberum Ratings	B	**Capacidade de pagamento fraca**
19/06/2018	Austin Ratings	C	**Default iminente**

Acima os ratings de Qualidade de Crédito realizado por 2 empresas de rating: Austin Ratings e Liberum Ratings em que todos os ratings eram considerados bons, iniciando o declínio do rating a partir de 09/11/2017, quando o fundo já havia suspendido os resgates.

O Fundo Previdenciário RECIPREV têm boa experiência de investimentos em Fundos de Direitos Creditórios (FIDC), tendo realizado investimentos em 10 FIDCS, correspondente a um total de R$ 37.800.000,00.Todos foram liquidados sem problemas e com excelentes retornos, restando apenas o FIDC Dunas. Demonsta que o produto é bom. Inclusive, o próprio Dunas possuia bom comportamento e existência superior a 5 anos. No entanto, a empresa contratada pelo Administrador SINGULARE CTVM que foi a Dunas, com base nos documentos demonstrados pelo Administrador do Fundo e nas ações ingressadas na Justiça Cível e Criminal, indicam que ocorreu fraude praticado pela Dunas. Os RPPS, inclusive a RECIPREV, através do advogado que representa os RPPS ingressou com processo administrativo junto a Comissão de Valores Mobiliários em 13/11/2020, protocolo. SCW104347805, Nº do Recebimento 8141180. Também ingressou com ação junto ao TRIBUNAL DE JUSTIÇA DO ESTADO DE SÃO PAULO PODER JUDICIÁRIO em 19/11/2020. Processo: 10109424620208260011, em julho de 2022, houve o protesto das instituições gestora, administradora etc.

6.2 FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÃO (FIP)

A seguir o Fundo de Investimento em Participaçã (FIP). Trata-se de um segmento de investimento muito utilizado nas economias do mundo que apresentam juros baixo e mercado secundário muito efetivo. Trata-se de investimento em empresas de forma geral. Possuem volatilidades decorrentes da liquidez e de mercado, entre outros, e em especial do crescimento econômico do País, que podem indicar ou não o crescimento dos negócios e consequentemente das empresas. O FIP Brasil Florestal está em processo de liquidação, sendo já vendido, e as parcelas de recebimentos irão ocorrer no período de até 10 anos.

NOME DO FUNDO	CNPJ	GESTOR	ADMINISTRADOR	SALDO		
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	12.312.767/0001-35	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R$ 6.148.308,75		
TOTAL				**R$ 6.148.308,75**		
% CARTEIRA				**% Total Carteira pela curva de juros**	**0,18%**	**% Total Carteira à mercado**

7. PROVISÕES PARA PERDAS FUTURAS

Para dar o maior conforto financeiro e atuarial para a carteira de investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV, implantou-se a provisão para perdas futuras de investimentos, em razão da redução dos juros, e a necessidade de maior risco na carteira com vistas ao atingimento da meta de rendimentos. Estando, inclusive, previsto no ***Manual de Contabilidade Aplicada aos Regimes Próprios de Previdência Social do Ministério da Previdência Social – Secretaria de Políticas de Previdência Social – Departamento dos Regimes de Previdência no Serviço Público - 1ª edição, 2009, Pág. 117 a seguir transcrito: " 5.6.3 Provisões para Perdas em Investimentos - Os investimentos podem estar sujeitos a perdas, totais ou parciais, decorrentes de eventos como: falência ou concordata de uma empresa investida; desvalorização permanente de quotas ou ações; abandono de projetos de investimentos já concretizados, entre outros. Com o objetivo de suportar eventuais aplicações ou investimentos malsucedidos, poderá ser constituída pela unidade gestora do RPPS uma provisão para perdas de investimentos. A constituição dessa provisão para perdas em investimentos encontra-se respaldada no Princípio Contábil da Prudência, segundo o qual se devem manter os menores valores para o ativo, ajustando-se, para menos, os valores de transações com o mundo exterior, que trazem em si o risco de um eventual não-recebimento. Na administração pública, a provisão para perdas em investimentos é uma variação passiva, de natureza devedora, afetando, portanto, negativamente o resultado do exercício, no momento de sua constituição. Se a perda prevista for consumada, a provisão será utilizada. Caso contrário, no encerramento do exercício, efetuar-se-á a reversão dos valores não utilizados como variação ativa, o que afetará o resultado positivamente. A recomendação é que a provisão para perdas em investimentos seja constituída uma vez por ano, no mês de encerramento do exercício, e que seja ajustada anualmente, de acordo com a nova necessidade de provisão, complementando-se ou revertendo-se seus valores. O cálculo do montante da provisão para perdas que será constituída deverá considerar o risco envolvido na carteira de investimentos da unidade gestora do RPPS. Segundo a NBC T 4 – Da Avaliação Patrimonial, do Conselho Federal de Contabilidade, as provisões para perdas no valor dos investimentos são constituídas com base em perdas potenciais. Quando efetivada a perda, naqueles casos em que o investimento for considerado irrecuperável, o ordenador de despesa deverá autorizar a baixa da provisão, apresentando os esclarecimentos necessários, em notas explicativas, às demonstrações contábeis dos RPPS."***

Ante o exposto, com base nos cálculos de riscos mensais do Relatório de Riscos definiu-se o percentual de 0,17% sobre o saldo da carteira à marcada à mercado do último dia do ano

Valor da provisão para perdas futuras de investimento **R$ 5.732.346,40**

8.RISCO DE CRÉDITO

Para mensuração e controle do risco de crédito nos utilizamos dos Ratings de Qualidade de Gestão atribuído ao Gestor, bem como do rating de crédito do fundo de investimentos. O gestor dever possuir rating no mínimo B+ e os papéis do fundo rating bom, com acompanhamento trimestral dos relatórios de rating do fundo. Além das medidas citadas, também é feita análise da carteira do fundo.

Adotamos os limites e condições estabelecidos na Resolução CMN Nº 4.963/2021, quanto aos fundos de investimentos e as instituições, com vistas a se evitar risco de crédito.

9.RISCO DE CONTRAPARTE; RISCO OPERACIONAL e LEGAL

Adotamos critério rigoroso, definidos no site da RECIPREV:
a) Quanto ao credenciamento de Instituições Gestoras, Administradores, Distribuidores e Corretoras;
b) Processo de custodiantes;
c) Processo de Corretoras para compra e venda de títulos públicos;
d) Utilização de rating de qualidade de gestão dos gestores de investimentos;
e) Processo de atualização anual de credenciamento das instituições;
f) Limites de investimentos por Gestor, Administrador e fundos de investimentos.

a) Quanto ao credenciamento de Instituições Gestoras, Administradores, Distribuidores e Corretoras; b) Processo de custodiantes;
c) Processo de Corretoras para compra e venda de títulos públicos;
d) Utilização de rating de qualidade de gestão dos gestores de investimentos;
e) Processo de atualização anual de credenciamento das instituições;
f) Limites de investimentos por Gestor, Administrador e fundos de investimentos.

10. FUNDOS DESENQUADRADOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV - RESOLUÇÃO CMN 4.604/2017 (RISCO LEGAL)

Somos notificados de forma automática através de email mensal e no DAIR após a transmissão do mesmo. Respondemos, mensalmente, NO DAIR sendo devidamente acatado pela Secretaria de Previdência, tendo em vista que quando da realização dos referidos investimentos, há época da RESOLUÇÃO CMN 3.922/2010, foram todos realizados em conformidade com a referida resolução.

FUNDO	MOTIVO DO DESENQUADRAMENTO	% Participação
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	Participação % no PL do fundo superior a 5%	**14,22%**
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Participação % no PL do fundo superior a 5%	**21,88%%**

11. FUNDOS DESENQUADRADOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV - RESOLUÇÃO CMN 4.695/2018 (RISCO LEGAL)

FUNDO	GESTOR	ADMINISTRADOR	VALOR	MOTIVO
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R$ 6.148.308,75	Gestor e Administrador sem Comitê de Auditoria e Comitê de Riscos, obrigados, pelo BACEN
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	SINGULARE CTVM	SINGULARE CTVM	R$ 1.638.797,92	Gestor e Administrador sem Comitê de Auditoria e Comitê de Riscos, obrigados, pelo BACEN
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	SINGULARE CTVM	SINGULARE CTVM	R$ 5.255,16	Gestor e Administrador sem Comitê de Auditoria e Comitê de Riscos, obrigados, pelo BACEN
TOTAL			**R$ 7.792.361,83**	

O Ofício Circular Conjunto nº 3/2019/CVM/SIN/SPREV, de 8 de fevereiro de 2019, constante do site: http://sa.previdencia.gov.br/site/2019/02/Oficio-Circular-CVM-SIN-SPREV-03_2019.pdf, explica que apesar dos desenquadramentos, não há a necessidade de se fazer resgates dos fundos. Exceto, se de interesse do RPPS. De outra, também, não podemos efetuar nenhuma aplicação nos mesmos até enquanto perdurar a ocorrência. Caso ocorra alteração do gestor ou administrador dos referidos fundos para novos gestores ou administradores com Comitê de Auditoria e Riscos, obrigatórios pelo BACEN, ai sim, podemos efetuar novas aplicações.

12. IMPACTOS DE LIMITES DO ADMINISTRADOR E GESTOR DE INVESTIMENTOS	
Administrador	Máximo que o RPPS pode possuir por administrador ou grupo econômico de administradores é 5% sob o volume de Administração ANBIMA e o administrador ou grupo econoômico do Administrador não pode possuir superior a 50% sob o volume de administração ANBIMA somente com RPPS.
Getstor	Máximo que o RPPS pode possuir por gestor ou grupo econômico de gestores é 5% sob o volume de Gestão ANBIMA.
Fundos; Máximo por fundo: 20% do PL da Carteira.	Não temos nenhum fundo na carteira de investimentos RECIPREV com 20% do PL da carteir

VOLUME DE APLICAÇÕES POR GESTOR

GESTOR	VALOR APLICADO	% CARTEIRA	% Máximo Permitido	Percentual do Volume de Recursos Reciprev em relação ao Volume ANBIMA de Gestão
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R$ 63.789.416,41	1,81%	Máximo permitido 5,00% do volume de gestão ANBIMA	0,24%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R$ 161.820.472,33	4,59%		0,01%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	R$ 124.040.621,65	3,51%		0,83%
BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	R$ 36.341.206,45	1,03%		0,05%
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R$ 59.992.912,83	1,70%		0,01%
BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVESTIMENTOS LTDA	R$ 16.713.923,08	0,47%		4,58%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R$ 329.315.030,70	9,33%		0,05%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS S.A. DTVM	R$ 14.746.288,92	0,42%		0,00%
CAIXA DTVM S/A	R$ 151.629.389,30	4,30%		0,03%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R$ 99.095.358,12	2,81%		4,30%
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	R$ 27.257.574,89	0,77%		2,38%
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA	R$ 24.632.751,67	0,70%		0,00%
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$ 26.202.725,83	0,74%		0,06%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R$ 14.153.878,18	0,40%		0,09%
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$ 38.864.061,23	1,10%		0,39%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R$ 6.148.308,75	0,17%		12,47%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R$ 15.436.283,33	0,44%		0,15%
SINGULARE CTVM S.A.	R$ 1.644.053,08	0,05%		0,02%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	R$ 25.825.117,33	0,73%		0,01%
INTER ASSET GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$ 15.284.000,02	0,43%		0,17%
SOMMA INVESTIMENTOS S/A	R$ 45.301.019,17	1,28%		0,36%
TESOURO NACIONAL	R$ 1.944.240.502,55	55,09%		0,00%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNER	R$ 145.789.688,46	4,13%		0,28%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	R$ 37.305.897,00	1,06%		0,02%
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	R$ 60.592.235,45	1,72%		0,04%
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$ 42.980.780,64	1,22%		0,02%
TOTAL	R$ 3.529.143.497,37	100,00%		

VOLUME DE APLICAÇÕES POR ADMINISTRADOR

ADMINISTRADOR	VALOR APLICADO	% CARTEIRA	% Máximo Permitido	% Máximo Permitido	Percentual do Volume de Recursos Reciprev em relação ao Volume ANBIMA de ADMINISTRAÇÃO	Percentual do Volume de Recursos Reciprev em relação ao Volume ANBIMA de ADMINISTRAÇÃO
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	R$ 36.341.206,45	1,18%	Máximo permitido 5,00% do volume de Administração ANBIMA	Máximo permitido de todos os RPPS 50,00% do volume de Administração ANBIMA	0,04%	1,63%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R$ 344.833.357,27	11,17%			0,05%	#N/D
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R$ 162.267.394,53	5,26%			0,01%	5,62%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R$ 6.148.308,75	0,20%			0,00%	0,04%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A DTVM	R$ 14.746.288,92	0,48%			0,00%	0,61%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R$ 246.058.198,19	7,97%			0,04%	11,54%
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM	R$ 204.327.299,29	6,62%			0,05%	0,80%
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	R$ 25.825.117,33	0,84%			0,01%	0,80%
ITAU UNIBANCO S.A.	R$ 24.632.751,67	0,80%			0,00%	0,00%
XP INVESTIMENTOS CORRETORA DE CÂMBIO TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	R$ 60.592.235,45	1,96%			0,05%	0,00%
SINGULARE CTVM S.A.	R$ 1.644.053,08	0,05%			0,00%	0,00%
TESOURO NACIONAL	R$ 1.944.240.502,55	62,98%			0,00%	0,00%
INTER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	R$ 15.284.000,02	0,50%			0,18%	0,00%
TOTAL	R$ 3.086.940.713,51	100,00%			0,00%	0,00%

14. DADOS RELATIVOS AO CREDENCIAMENTO DAS INSTITUIÇÕES

CONTROLE DE CREDENCIAMENTOS

GESTOR DE INVESTIMENTOS	CNPJ	DATA CREDENCIAMENTO	DATA RENOVAÇÃO	OBSERVAÇÃO	AÇÃO
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	04.506.394/0001-05	25/07/2023	24/07/2025	0	
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	30.822.936/0001-69	25/07/2023	24/07/2025	0	
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	07.237.373/0001-20	13/04/2024	13/04/2026	0	
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL (GRUPO BNP)	02.562.663/0001-25	04/08/2023	03/08/2025	0	
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	62.375.134/0001-44	10/08/2023	09/08/2025	0	
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	60.746.948/0001-12	10/08/2023	09/08/2025	0	
CAIXA DTVM S/A	42.040.639/0001-40	24/07/2023	23/07/2025	0	
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	10.626.543/0001-72	24/07/2023	23/07/2025	0	
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	01.294.929/0001-33	11/11/2023	10/11/2025	0	
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	68.622.174/0001-20	01/09/2022	31/08/2024	0	
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	16.500.294/0001-50	31/07/2023	30/07/2025	0	
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	11.628.883/0001.03	10/04/2024	10/04/2026	0	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	07.250.864/0001-00	24/07/2023	23/07/2025	0	
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	03.864.607/0001-08	31/07/2023	30/07/2025	0	
SINGULARE CTVM S.A.	62.285.390/0001-40	27/07/2023	26/07/2025	0	
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	21.813.291/0001-07	25/07/2023	24/07/2025	0	
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	10.917.835/0001-64	24/07/2023	23/07/2025	0	
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	16.789.525/0001-98	07/07/2022	06/07/2024	0	
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA (GRUPO XP)	07.625.200/0001-89	27/07/2023	26/07/2025	0	

ADMINISTRADOR DE INVESTIMENTOS	CNPJ	DATA CREDENCIAMENTO	DATA RENOVAÇÃO	OBSERVAÇÃO	AÇÃO
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	01.522.368/0001-82	04/08/2023	03/08/2025	0	
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	60.746.948/0001-12	10/08/2023	09/08/2025	0	
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	30.822.936/0001-69	25/07/2023	24/07/2025	0	
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	00.066.670/0001-00	10/08/2023	09/08/2025	0	
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	02.201.501/0001-61	17/08/2023	16/08/2025	0	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	00.360.305/0001-04	24/07/2023	23/07/2025	0	
iTAU UNIBANCO S.A.	60.701.190/0001-04	24/07/2023	23/07/2025	0	
SINGULARE CTVM S.A.	62.285.390/0001-40	27/07/2023	26/07/2025	0	

DISTRIBUIDOR	CNPJ	DATA CREDENCIAMENTO	DATA RENOVAÇÃO	OBSERVAÇÃO	AÇÃO
BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)	00.000.000/0001-91	25/07/2023	24/07/2025	0	
GRID AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTO LTDA	17.203.539/0001-40	24/03/2024	24/03/2026	0	
MAGNA – AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA	13.426.885/0001-37	27/07/2023	26/07/2025	0	
PERFORME AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS EIRELI	10.819.611/0001-10	25/07/2023	24/07/2025	0	
PRIVATIZA AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTOS LTDA	00.840.515/0001-08	25/07/2023	24/07/2025	0	
SINGULARE CTVM S.A.	62.285.390/0001-40	27/07/2023	26/07/2025	0	

RATINGS

GESTOR DE INVESTIMENTOS	AGÊNCIA DE RATING	NOTA	DATA	VENCIMENTO DO RATING	TIPO DO RATING	AÇÃO	TOTAL
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	Moody's	MQ1	05/08/2024	05/08/2025	Excelente		R$ 63.789.416,41
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Fitch Ratings	Excelente	13/09/2023	12/09/2024	Excelente	COBRAR NOVO RATING	R$ 161.820.472,33
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	Fitch Ratings	AA.br	20/03/2024	20/03/2025	Alta qualidade		R$ 124.040.621,65
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL (GRUPO BNP)	Fitch Ratings	Excelente	22/12/2023	21/12/2024	Excelente		R$ 36.341.206,45
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	Fitch Ratings	Excelente	03/10/2023	02/10/2024	Excelente	COBRAR NOVO RATING	R$ 59.992.912,83
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	Standard&Poor's	brAAA	15/12/2023	14/12/2024	Capacidade extremamente forte para cumprir os		R$ -
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	Fitch Ratings	Forte	02/04/2024	02/04/2025	Forte		R$ -
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS S.A. DTVM	Fitch Ratings	Excelente	14/06/2024	14/06/2025	Excelente		R$ 14.746.288,92
CAIXA DTVM S/A	Fitch Ratings	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	Excelente		R$ 151.629.389,30
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	Austing Rating	QG 2-	12/09/2023	11/09/2024	Muito bom	COBRAR NOVO RATING	R$ 99.095.358,12
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	SR Ratings	G2-Sr	30/11/2023	29/11/2024	Muito bom		R$ 27.257.574,89
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	Moody's	MQ1	23/11/2023	22/11/2024	Excelente		R$ -
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	SR Ratings	G2-Sr	30/11/2023	29/11/2024	Muito bom		R$ 14.153.878,18
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	Moody's	MQ1	14/02/2024	13/02/2025	Excelente		R$ 38.864.061,23
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	Fitch Ratings	Forte	09/05/2024	09/05/2025	Muito bom		R$ 6.148.308,75
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	Austing Rating	QG 3+	03/03/2022	31/01/2023	Bom	COBRAR NOVO RATING	R$ 446.922,20
SINGULARE CTVM S.A.	Standard&Poor's	AMP-2	13/11/2023	12/11/2024	Forte		R$ 1.644.053,08
SOMMA INVESTIMENTOS S/A	Austing Rating	QG 3	20/10/2020	20/10/2021	Bom		R$ 45.301.019,17
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	Austing Rating	QG 3+	31/05/2024	31/05/2025	Bom	COBRAR NOVO RATING	R$ -
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	Standard&Poor's	AMP-1	12/08/2024	12/08/2025	Excelente		R$ 145.789.688,46
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	Moody's	MQ1	14/11/2023	13/11/2024	Excelente		R$ 37.305.897,00
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA (GRUPO XP)	Moody's	MQ1	07/03/2024	07/03/2025	Excelente		R$ -

16.RISCO DE IMAGEM

Através da gestão dos diversos riscos já mencionados, utilizamos o site da RECIPREV para disponibilização do máximo de informações dos investimentos. Buscamos, o máximo de transparência dos dados, com vistas a melhor compreensão da sociedade das ações e procedimentos que estão sendo tomados pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores – RECIPREV

PARECER GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS

Este é o relatório mensal de Riscos Mensais da Carteira de Investimentos do Fundo Previdêncio Reciprev em conformidade com a Portaria RECIPREV N. 203 de 13/02/2019 e Política de Riscos . A carteira de investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV não possui nenhum desenquadramento quanto:

a) ao percentual máximo que devemos ter em cada fundo de investimentos, exceto os 3 casos apontados neste relatório, mas que foram realizados em conformidade com a legislação da época;

b) ao percentual máximo de cada fundo em relação ao total de investimentos da carteira, que não possuimos nenhum fundo nesta condição;

c) totalmente atendimento da Política de Investimentos;

d) totalmente atendimento dos percentuais de Gestores e Administradores;

e) totalmente atendimento de Gestores e Administradores com relação a Resolução 4.695/2018, exceto os 4 casos apontados neste relatório, mas que foram realizados em conformidade com a legislação da época;

Adotamos os limites e condições estabelecidos na Resolução CMN Nº 4.963/2021, quanto aos fundos de investimentos e as instituições, com vistas a se evitar risco de imagem. Submetemos o relatório ao Comitê de Riscos de Investimentos da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Gerente de Investimentos

Gutemberg Peixoto Calazans Filho
Chefe de Divisão de Investimentos

Gustavo Lins Dourado
Equipe Investimentos

PARECER DO COMITÊ DE RISCOS 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

Rodrigo Chagas de Sá
Chefe da Área de Controles Internos

Originais assinados e arquivados na Reciprev

Recife (PE), 15 de setembro de 2024

ASSINATURAS