

Relatório Mensal de Investimentos
Portaria MPS N° 519, de 24 de agosto de 2011, Art 3º, V



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

Data da Posição: **31/07/2019**

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores)		
Renda Fixa		
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	558.247.425,06
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	419.901.396,38
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$	165.599.194,03
TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	R\$	154.914.823,20
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	98.086.312,80
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$	51.321.999,86
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	42.884.814,58
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$	38.945.920,84
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	5.717.082,28
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$	4.051.220,30
TERCON INVESTIMENTOS LTDA	R\$	21.118,54
TOTAL RF	R\$	1.539.691.307,86
Renda Variável		
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	130.485.240,09
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$	70.814.053,79
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$	69.509.859,40
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	58.004.841,79
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$	57.373.564,23
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$	57.271.233,97
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	56.949.372,77
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	27.888.799,57
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$	26.337.031,38
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$	22.989.383,77
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$	16.308.035,25
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$	8.364.345,27
SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	R\$	7.993.428,86
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	6.504.754,51
LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	6.386.573,89
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$	4.659.923,97
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$	1.546.790,69
TOTAL RV	R\$	629.387.233,20
SALDO CONTA CORRENTE	R\$	1,00
PATRIMÔNIO	R\$	2.169.078.542,06

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores)		
Renda Fixa		
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	558.247.425,06
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	419.901.396,38
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R\$	165.599.194,03
TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	R\$	154.914.823,20
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$	98.086.312,80
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	R\$	55.373.220,16
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A	R\$	42.884.814,58
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$	38.945.920,84
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$	5.717.082,28
SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	R\$	21.118,54
TOTAL RF	R\$	1.539.691.307,86
Renda Variável		
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	R\$	216.420.905,57
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	136.691.954,74
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	85.559.713,12
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$	70.814.053,79
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	R\$	58.004.841,79
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$	41.011.006,93
SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	R\$	7.993.428,86
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A	R\$	6.504.754,51
LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	6.386.573,89
TOTAL RV	R\$	629.387.233,20
SALDO CONTA CORRENTE	R\$	1,00
PATRIMÔNIO	R\$	2.169.078.542,06

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (Índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,30 a 0,50	IMA GERAL EX-C	Não possui	3,42%	1,00%	R\$ 74.258.236,12	25.078.994/0001-90	1,02%	9,33%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Muito Alto
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%	0,02%	R\$ 190.141,92	13.077.415/0001-05	0,47%	2,81%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IDKA IPCA 2A	Não possui	1,95%	0,55%	R\$ 42.390.705,53	13.322.205/0001-35	0,98%	6,68%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Muito Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IMA-B	Não possui	10,66%	3,96%	R\$ 231.211.375,41	07.442.078/0001-05	1,27%	17,04%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,15%	IPCA + 6,00%	Não possui	1,11%	7,22%	R\$ 24.007.805,51	15.486.093/0001-83	1,08%	10,44%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IPCA + 6,00%	Não possui	3,68%	9,05%	R\$ 79.733.878,31	19.303.795/0001-35	0,90%	8,18%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IMA-B	Não possui	1,37%	10,61%	R\$ 29.738.192,36	19.523.306/0001-50	0,99%	10,11%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,20%	IMA-B	Não possui	0,68%	2,16%	R\$ 14.814.342,07	19.523.305/0001-06	0,83%	6,50%	Médio Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Baixo
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	0,20%	IMA-B	Não possui	6,13%	7,99%	R\$ 133.056.725,46	08.702.798/0001-25	1,23%	16,57%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Baixo
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC DE FII IF IMA-B 5	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	0,20%	IMA-B 5	Não possui	1,49%	4,48%	R\$ 32.347.901,03	20.216.216/0001-04	0,96%	8,22%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	3,00%	CDI	Não possui	0,01%	0,04%	R\$ 194.567,54	13.397.466/0001-14	0,33%	2,35%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Muito Baixo
CAIXA BRASIL IDIA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IDKA IPCA 2A	Não possui	2,62%	0,65%	R\$ 56.767.045,96	14.386.926/0001-71	0,92%	7,01%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	1,14%	5,61%	R\$ 24.781.965,00	18.598.288/0001-03	0,95%	11,73%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	1,38%	2,17%	R\$ 29.939.780,00	20.139.595/0001-78	0,95%	11,71%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,33%	10,87%	R\$ 7.206.804,00	19.769.046/0001-06	0,92%	17,38%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	Não possui	0,52%	3,17%	R\$ 11.304.874,00	20.139.534/0001-00	0,92%	17,40%	Longo Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B 5	Não possui	13,37%	2,90%	R\$ 289.900.927,42	11.060.913/0001-10	0,95%	8,20%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSECTORIAL INVEST DUMAS LP (COTAS SÊNIORES)	TERCON INVESTIMENTOS LTDA	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	0,20%	125% do DI	Não possui	0,00%	14,22%	R\$ 21.118,54	13.633.964/0001-19	61,76%	4097,75%	Médio Prazo	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	Risco Muito Alto

Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (Índice de Referência anual)	Taxa Performance *	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	ITAÚ UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	ITAÚ UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	0,40%	IPCA	Não possui	1,80%	0,79%	R\$ 38.945.920,84	21.838.150/0001-49	0,95%	6,91%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Muito Alto
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,40%	CDI	0,2	0,19%	2,72%	R\$ 4.051.220,30	19.488.768/0001-84	0,60%	1,64%	Curto Prazo	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	Risco Baixo
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	0,20%	IMA-B 5	Não possui	4,52%	7,06%	R\$ 98.086.312,80	13.455.117/0001-01	0,95%	8,13%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RF LONGO PRAZO	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	0,40%	IMA-B	20,00%	2,37%	3,08%	R\$ 51.321.999,86	09.326.708/0001-01	1,08%	15,81%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219 (7604)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	0,00%	IPCA+7.002299%%	Não possui	1,34%	0,00%	R\$ 29.032.724,19		0,76%	-17,82%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220 (7608)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	0,00%	IPCA+7.002655%%	Não possui	2,88%	0,00%	R\$ 62.417.748,25		0,76%	-17,82%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 (7647)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	0,00%	IPCA+6.261127%%	Não possui	1,46%	0,00%	R\$ 31.749.142,85		0,69%	-10,38%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571 (7632)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	0,00%	IPCA+6.269771%%	Não possui	1,46%	0,00%	R\$ 31.715.207,92		0,69%	-10,47%	Médio Prazo	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	Risco Muito Baixo
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A	0,40%	CDI	Não possui	0,99%	1,13%	R\$ 21.572.209,37	03.499.367/0001-90	0,66%	5,43%	Curto Prazo	FI Renda Fixa - Geral	Risco Médio
WESTERN ASSET IMABS ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A	0,40%	IMA-B 5	Não possui	0,98%	5,51%	R\$ 21.312.605,20	17.517.577/0001-78	1,11%	10,63%	Curto Prazo	FI 100% Títulos Públicos	Risco Médio
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LP	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	0,50%	IMA-B 5	Não possui	0,26%	1,25%	R\$ 5.717.082,28	14.146.491/0001-98	0,87%	8,79%	Curto Prazo	FI Renda Fixa "Referenciado"	Risco Médio
Renda Fixa						70,98%		R\$ 1.539.691.307,86			1,03%			
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	1,21%	10,31%	R\$ 26.337.031,38	14.550.994/0001-24	1,64%	18,24%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,50%	Índice Small Cap	20,00%	1,06%	1,94%	R\$ 22.989.383,77	11.392.165/0001-72	9,48%	20,66%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	2,60%	IBOVESPA	Não possui	1,21%	7,70%	R\$ 26.247.078,59	18.270.783/0001-99	0,36%	11,34%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	1,00%	IGC	Não possui	2,17%	9,15%	R\$ 47.123.680,56	10.418.335/0001-88	0,66%	14,94%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	Risco Muito Alto
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	1,50%	IBOVESPA	Não possui	3,20%	2,43%	R\$ 69.509.859,40	06.916.384/0001-73	-0,05%	13,40%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	0,70%	IBRX-50	Não possui	1,49%	7,31%	R\$ 32.266.708,32	03.737.217/0001-77	0,65%	15,76%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	Risco Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	1,50%	Índice Small Cap	Não possui	1,14%	6,38%	R\$ 24.682.664,45	15.154.220/0001-47	6,67%	33,98%	Curto Prazo	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	Risco Muito 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	0,2	1,32%	4,11%	R\$ 28.610.340,35	15.154.441/0001-15	1,04%	22,46%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
BB RECEÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	0,85%	IPCA + 6,9506%	20,00%	0,21%	4,83%	R\$ 4.659.923,97	20.716.161/0001-93	1,28%	11,01%	Longo Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	1,36%	IPCA+7,50%	20,00%	0,37%	22,62%	R\$ 7.993.428,86	16.841.067/0001-99	3,37%	10,93%	Médio Prazo	FI Imobiliários	Risco Médio
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	1,50%	IPCA+9,00%	Não possui	0,22%	4,55%	R\$ 4.757.862,09	12.312.767/0001-35	-0,15%	-39,63%	Médio Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	0,30%	IPCA+ 10,50%	Vide regulamento	0,39%	3,14%	R\$ 8.364.345,27	11.490.580/0001-69	-0,03%	0,76%	Curto Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUA DO BRASIL INFRAESTRUTURA	LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	1,20%	IPCA+8,00%	Não possui	0,29%	3,40%	R\$ 6.386.573,89	17.213.821/0001-09	-0,11%	-0,72%	Longo Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto
TERRAS BRASIL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	2,00%	IPCA+6,00%	20,00%	0,07%	9,94%	R\$ 1.546.790,69	19.412.474/0001-79	-0,40%	-5,25%	Médio Prazo	FI em Participações	Risco Muito Alto

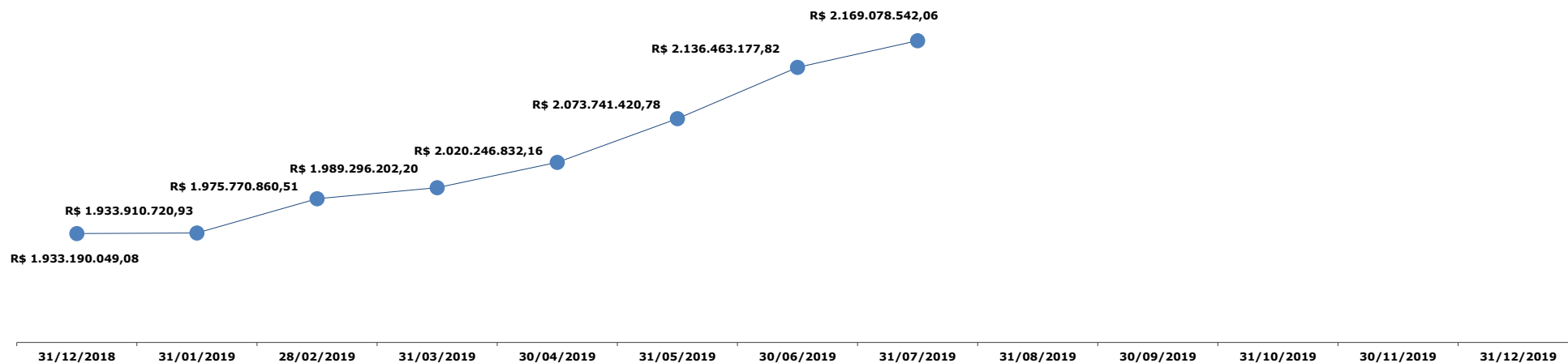
Nome do Fundo	Gestor	Administrador	Taxa de Administração Anual (%)	Benchmark (Índice de Referência anual)	Taxa Performance*	% PL RECIPREV	% PL Fundo	Valor (R\$)	CNPJ	Rentabilidade do Produto (mensal)	Rentabilidade do Produto (anual)	Prazo de Liquidação	Artigo da Resolução 3.922/10	Classificação Risco do Fundo
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	ITAÚ UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	ITAÚ UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	2,50%	IBOVESPA	20,00%	3,26%	3,92%	R\$ 70.814.053,79	23.731.629/0001-07	4,95%	21,25%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBRX	20,00%	0,53%	10,54%	R\$ 11.550.173,16	09.289.072/0001-75	1,80%	21,99%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	2,50%	IBOVESPA	20,00%	2,67%	7,71%	R\$ 58.004.841,79	02.436.763/0001-05	1,37%	14,79%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
SUL AMÉRICA EVOLUTION FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	1,00%	CDI	20,00%	0,66%	2,19%	R\$ 14.377.247,94	12.839.769/0001-87	0,49%	4,37%	Curto Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Alto
SUL AMÉRICA EQUITIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	1,50%	IBRX-50	20,00%	1,98%	6,75%	R\$ 42.996.316,29	11.458.144/0001-02	4,85%	25,88%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	2,00%	IBOVESPA	20,00%	1,32%	9,27%	R\$ 28.660.893,62	07.488.106/0001-25	1,69%	23,53%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO	VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	0,35%	IPCA	Não possui	0,00%	0,00%	R\$ 0,00	14.491.564/0001-89	0,86%	8,92%	Médio Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Médio
WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A	2,50%	Sem benchmark	Não possui	0,30%	4,94%	R\$ 6.504.754,51	09.087.523/0001-91	1,38%	16,22%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Muito Alto
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	3,00%	Sem benchmark	Não possui	1,02%	6,74%	R\$ 22.092.439,47	16.575.255/0001-12	0,74%	24,86%	Curto Prazo	FI de Ações - Geral	Risco Alto
XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	2,50%	CDI	20,00%	0,27%	2,91%	R\$ 5.796.360,10	11.616.403/0001-86	-1,05%	2,23%	Curto Prazo	FI Multimercado - Aberto	Risco Muito Alto
Renda Variável						29,02%		R\$ 629.387.233,20			1,97%			
Saldo Conta Corrente						0,00%		R\$ 1,00						
Total Geral						100,00%		R\$ 2.169.078.542,06		Rentabilidade Reciprev	1,30%			

* 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: TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS COM VENCIMENTO EM 15/05/2045 (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219; TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220; TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 e TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CODIGO: 6650571, passaram a ser marcados pela "CURVA DE JUROS", de aquisição dos títulos, respectivamente: IPCA+7.002299%; IPCA+7.002655%; IPCA+6.261127% e IPCA+6.269771%, conforme definido na Política de Investimentos de 2019 e em conformidade com as normas da Secretaria de Previdência (Portaria nº 577, de 27 de dezembro de 2017 e Portaria SPIREV 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.

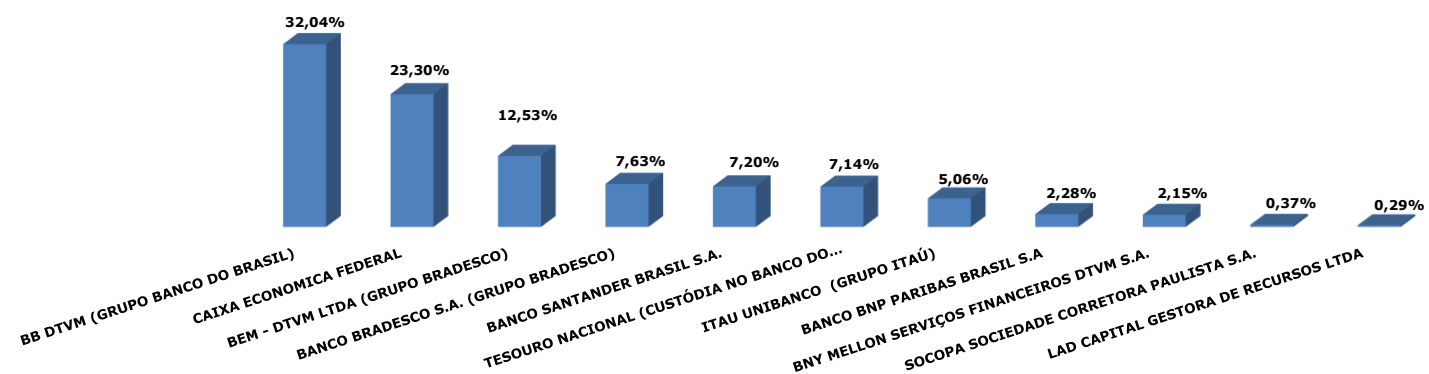
TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045) / Marcação a Mercado	R\$	231.308.990,46
Preço da Carteira à Mercado	R\$	2.245.472.709,32

Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPRE V - 2019

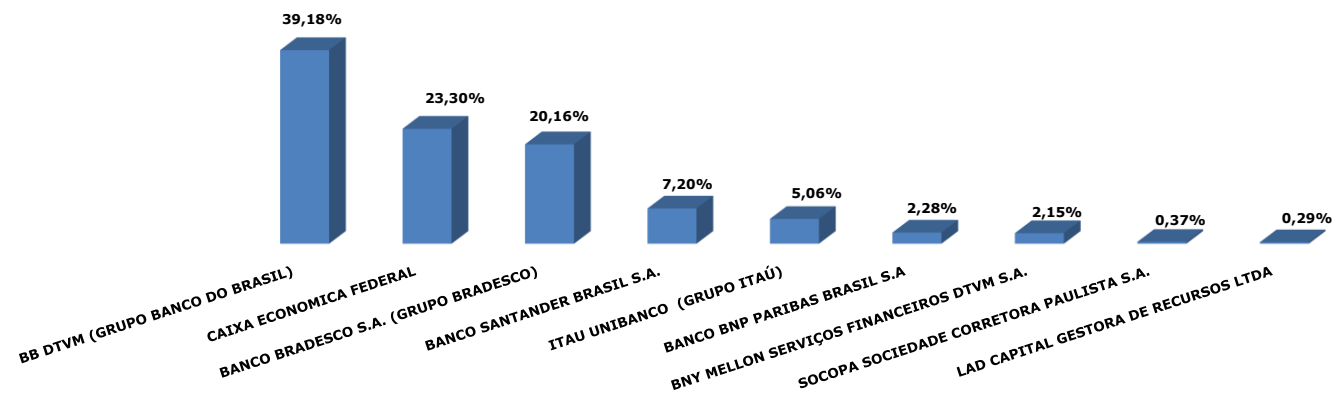


ADMINISTRADORES DE RECURSOS	GRUPO ECONÔMICO DO ADMINISTRADOR DE RECURSOS	GESTORES DE RECURSOS				
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	688.732.665,15	31,75%	
		BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$	1.546.790,69	0,07%	
		RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$	4.659.923,97	0,21%	
		TOTAL	R\$	694.939.379,80	32,04%	
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	476.850.769,15	21,98%	
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$	28.610.340,35	1,32%	
		TOTAL	R\$	505.461.109,50	23,30%	
		GESTOR/CUSTODIA	VALOR		% CARTEIRA	
		TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL) - Valor na Curva	R\$	154.914.823,20	7,14%	
		TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL) - Valor à Mercado	R\$	231.308.990,46	10,30%	
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$	165.599.194,03	7,63%	
		TOTAL	R\$	165.599.194,03	7,63%	
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R\$	69.509.859,40	3,20%	
		CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R\$	26.337.031,38	1,21%	
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$	11.550.173,16	0,53%	
		SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R\$	108.695.564,09	5,01%	
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R\$	28.660.893,62	1,32%	
		MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R\$	4.051.220,30	0,19%	
		AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	R\$	22.989.383,77	1,06%	
		TOTAL	R\$	271.794.125,73	12,53%	
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	156.091.154,59	7,20%	
		TOTAL	R\$	156.091.154,59	7,20%	
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R\$	109.759.974,63	5,06%	
		TOTAL	R\$	109.759.974,63	5,06%	
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$	4.757.862,09	0,22%	
		BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$	8.364.345,27	0,39%	
		XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	33.605.881,85	1,55%	
		TOTAL	R\$	46.728.089,21	2,15%	
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	49.389.569,09	2,28%	
		TOTAL	R\$	49.389.569,09	2,28%	
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A.	R\$	7.993.428,86	0,37%	
		TERCON INVESTIMENTOS LTDA	R\$	21.118,54	0,00%	
		TOTAL	R\$	8.014.547,39	0,37%	
		GESTOR	VALOR		% CARTEIRA	
		LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	6.386.573,89	0,29%	
		TOTAL	R\$	6.386.573,89	0,29%	
		TOTAL GERAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECI PREV	Na Curva	R\$	2.169.078.541,06	100,00%
			À Mercado	R\$	2.245.472.708,32	

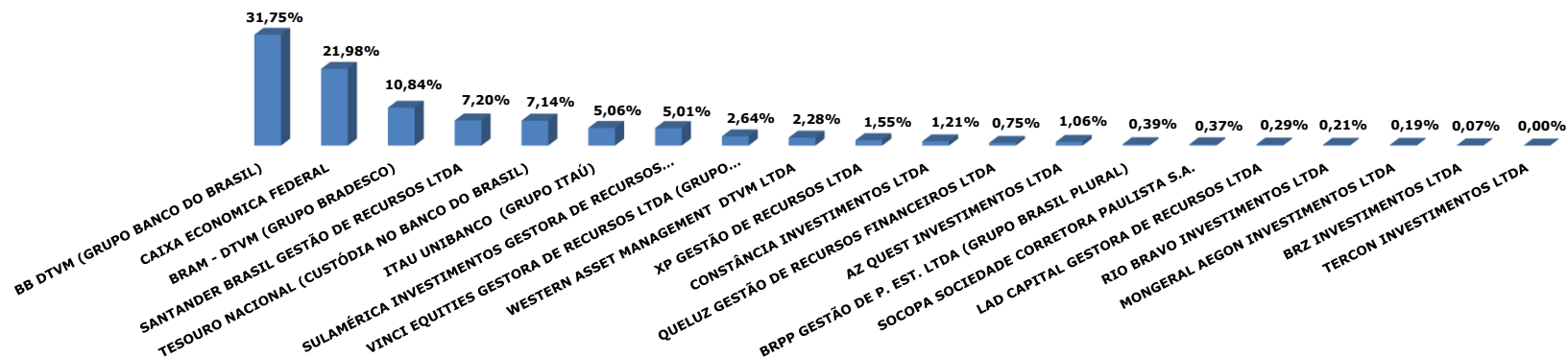
Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV - 2019



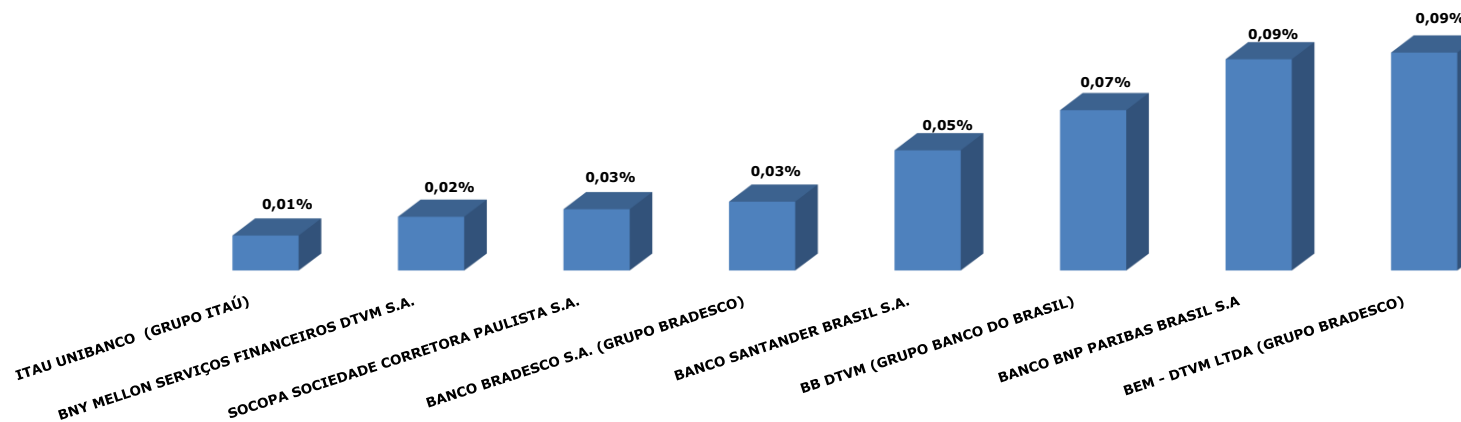
Percentual de Participação das Instituições Administradoras Consolidado por Grupo Econômico - Carteira RECIPREV - 2019



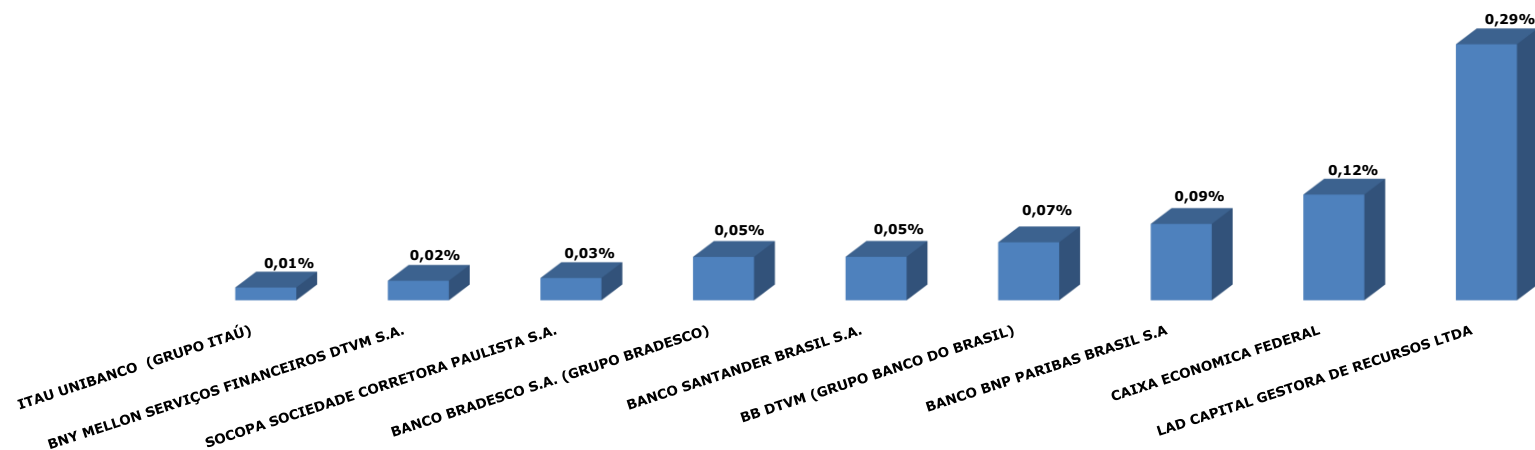
Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV - 2019



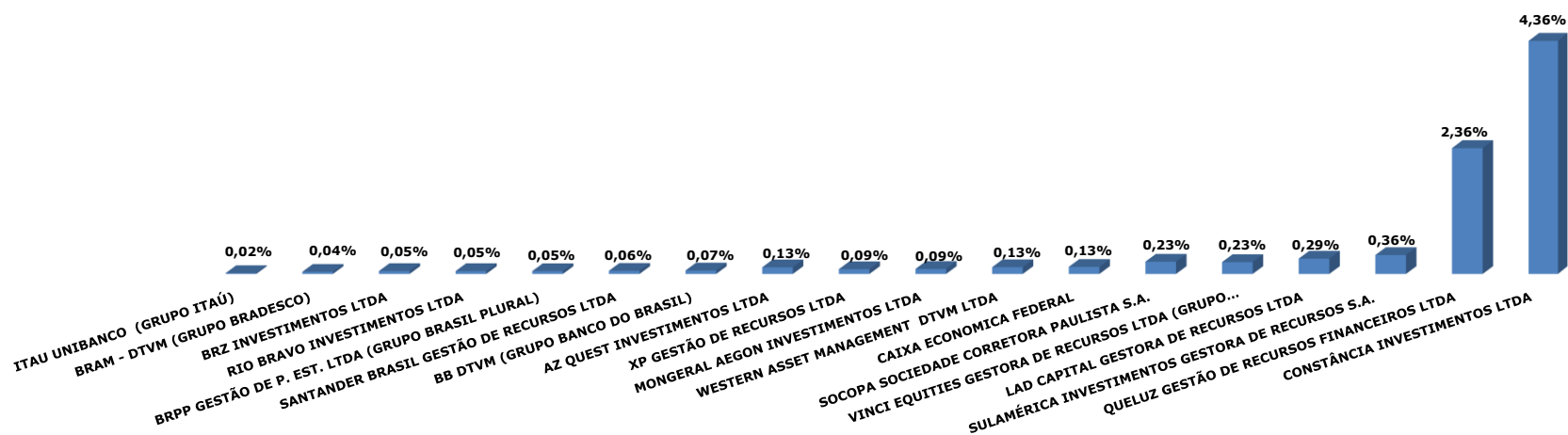
Percentual de participação dos investimentos da Reciprev em relação ao Volume sob Administração Anbima - 2019



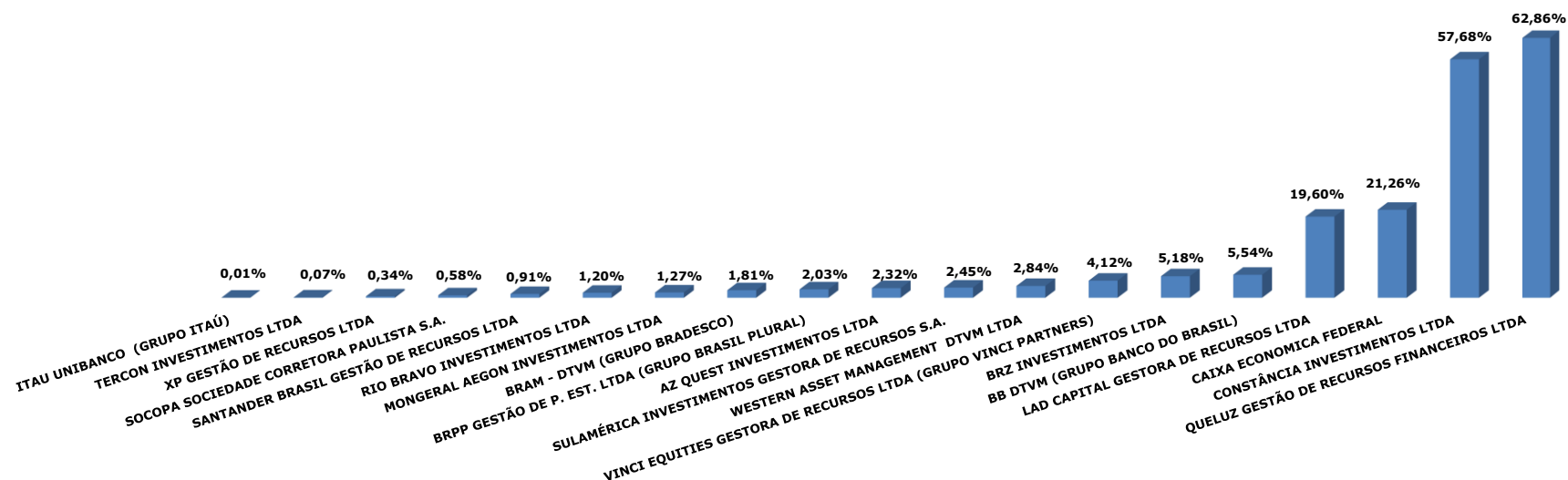
Percentual de participação dos investimentos da Reciprev em relação ao Volume Consolidado por Grupo Econômico sob Administração Anbima - 2019



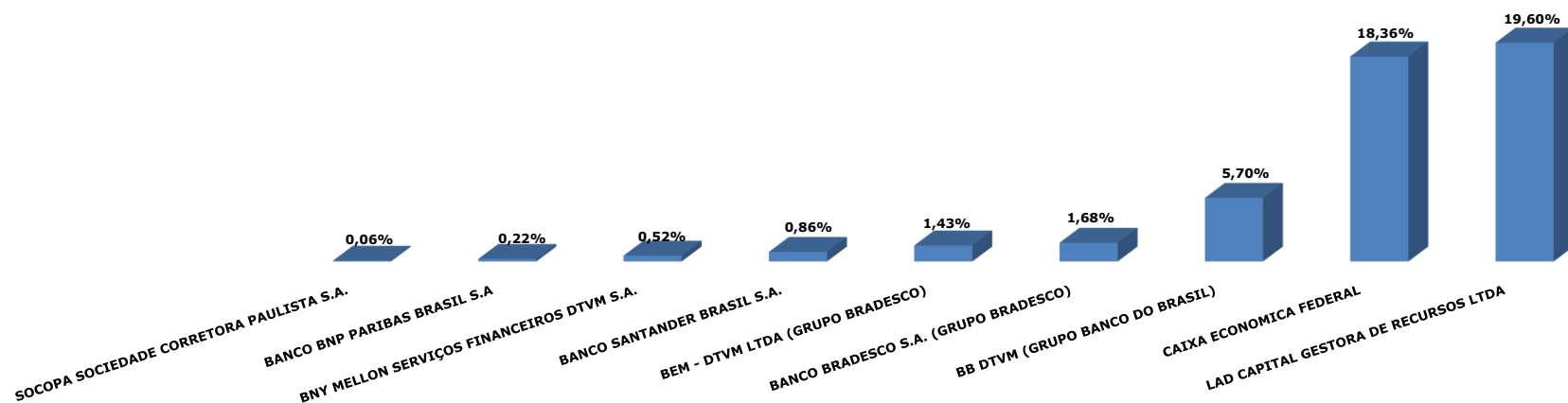
Percentual de participação dos investimentos da Reciprev em relação ao Volume sob Gestão Anbima - 2019



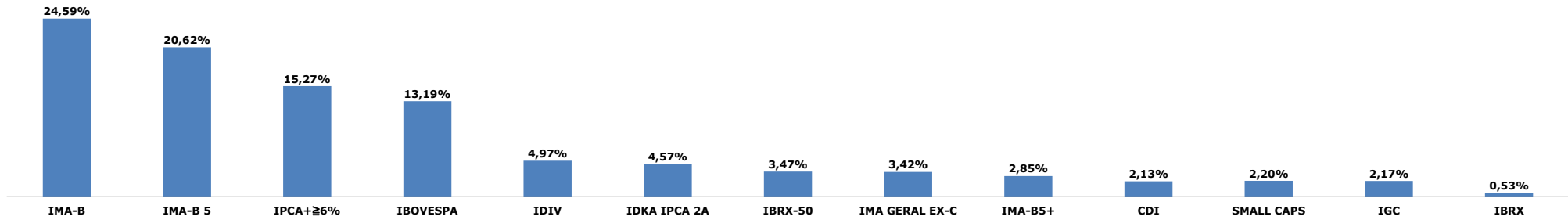
Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Gestão Anbima - 2019



Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Administração Anbima - 2019

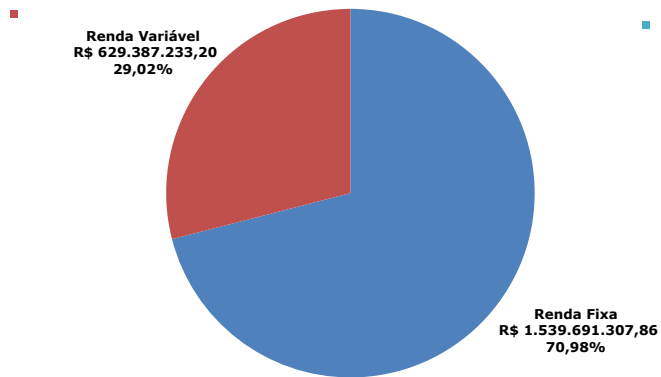


Percentual de Composição da Carteira RECIPREV por Benchmark - 2019

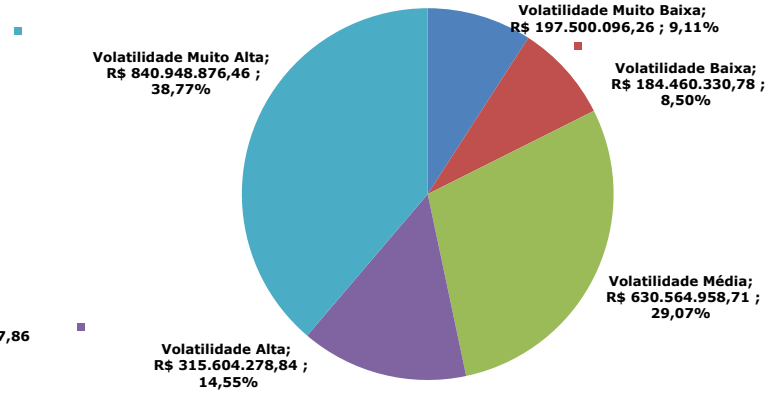


Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2019

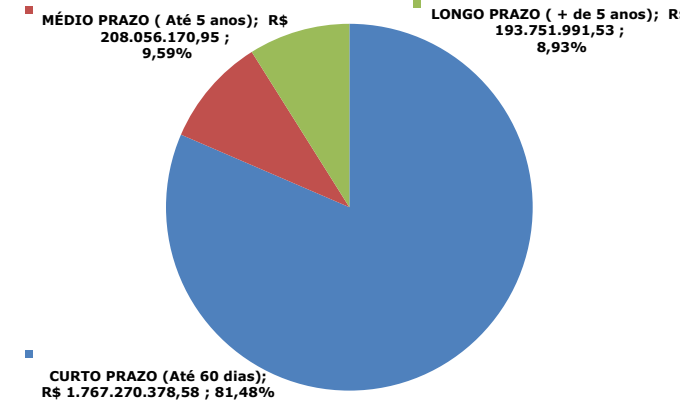
RENDA FIXA X RENDA VARIÁVEL



VOLATILIDADE DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS E TÍTULOS

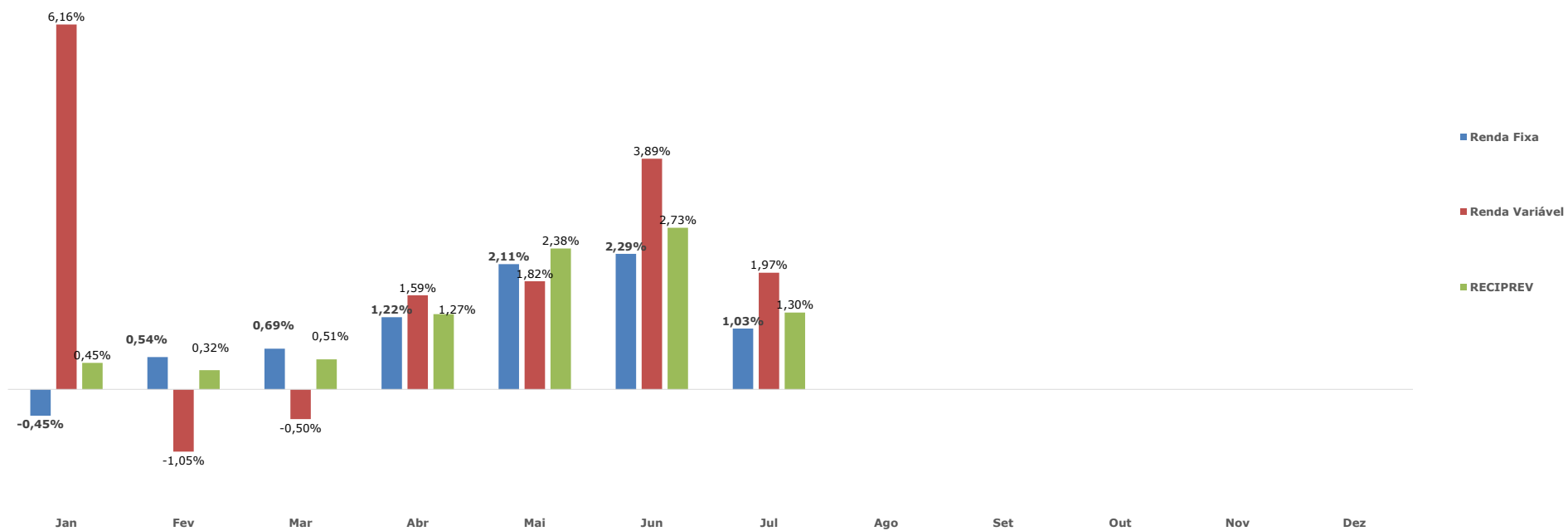


PRAZOS GERAIS DE LIQUIDAÇÃO

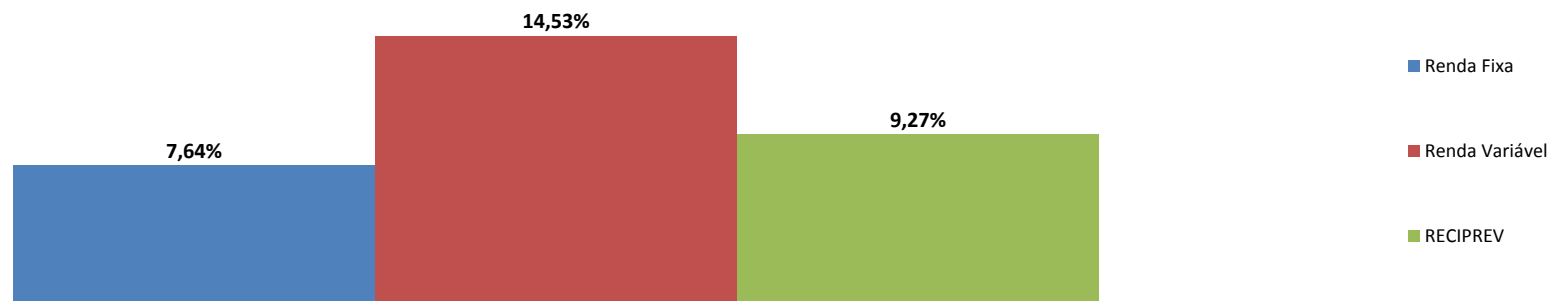


[illegible]

Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2019



Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV - 2019

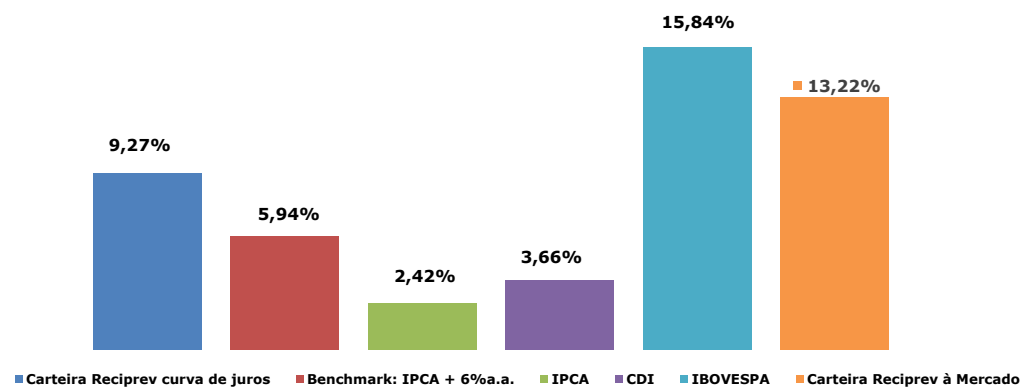
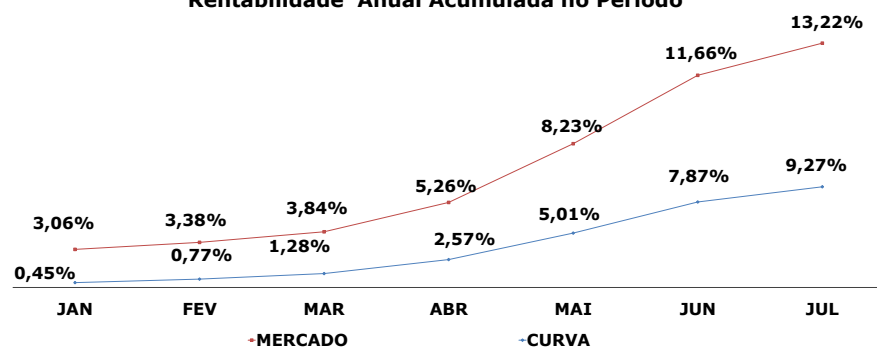


Rentabilidade Anual Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV -2019

% Atingimento acumulado anual da meta na Curva	156,10%
% Atingimento acumulado anual da meta à Mercado	222,68%

Acumulado Janeiro a Dezembro 2019 - Rentabilidade Carteira X Índices

Rentabilidade Anual Acumulada no Período



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

Data da Posição:	31/07/2019
-------------------------	-------------------

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\$ 37.303,47	R\$ 354.740,93
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\$ 1.066,79	R\$ 227.273,43
Saldo Conta Corrente				R\$ 126,50
Total Carteira RECIFIN			R\$ 38.370,26	R\$ 582.140,86

RESUMO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

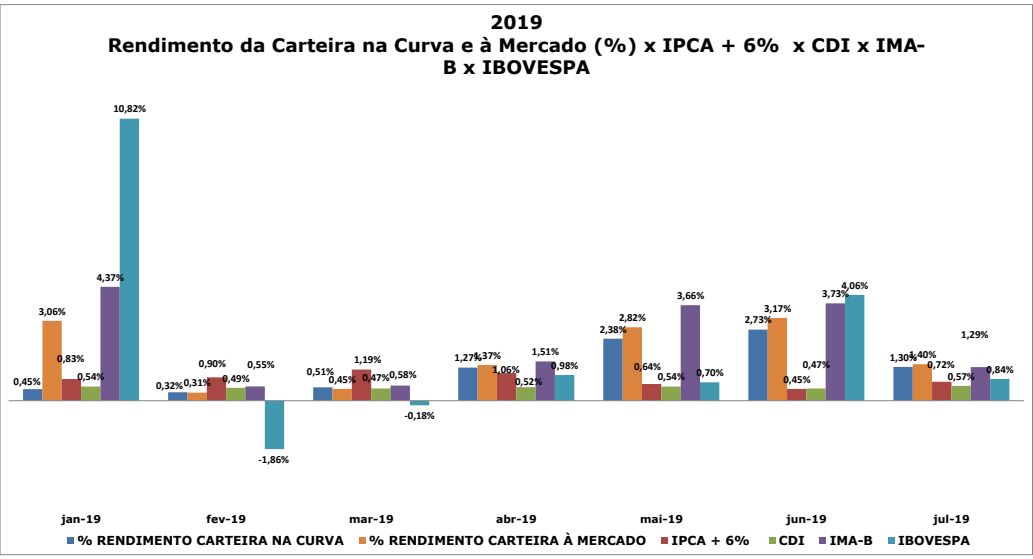
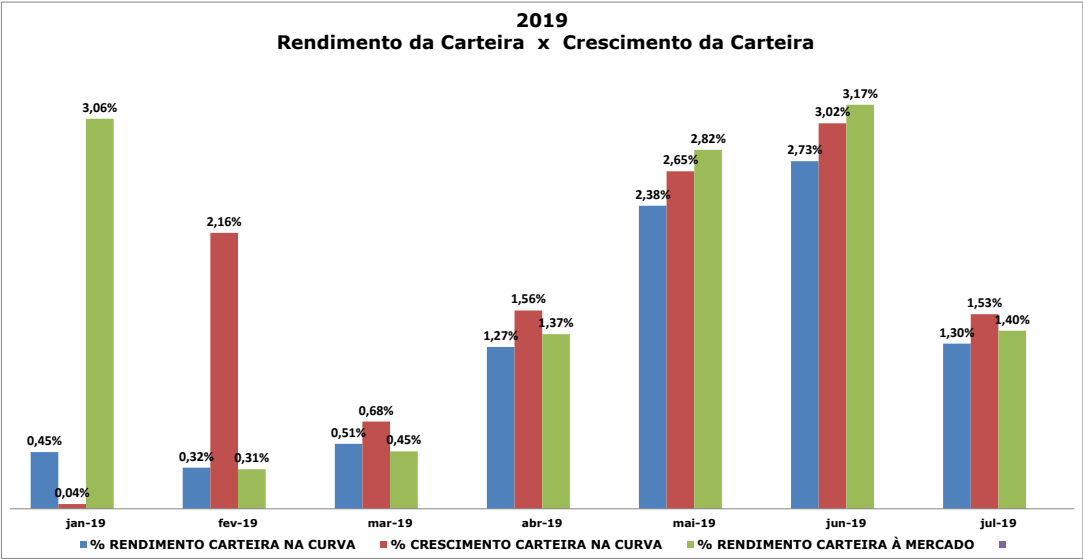
ANO 2019

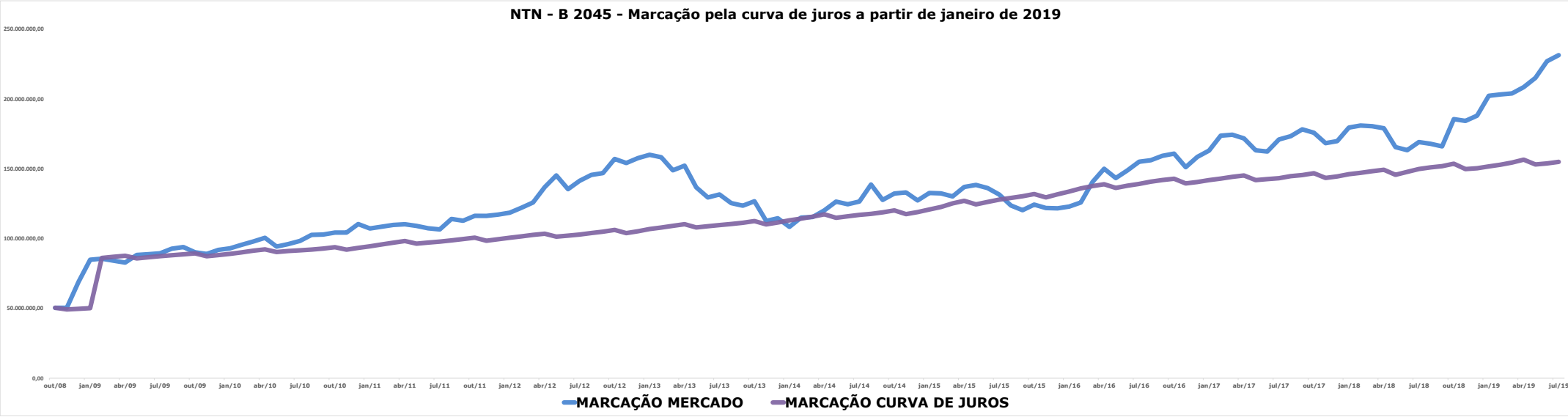
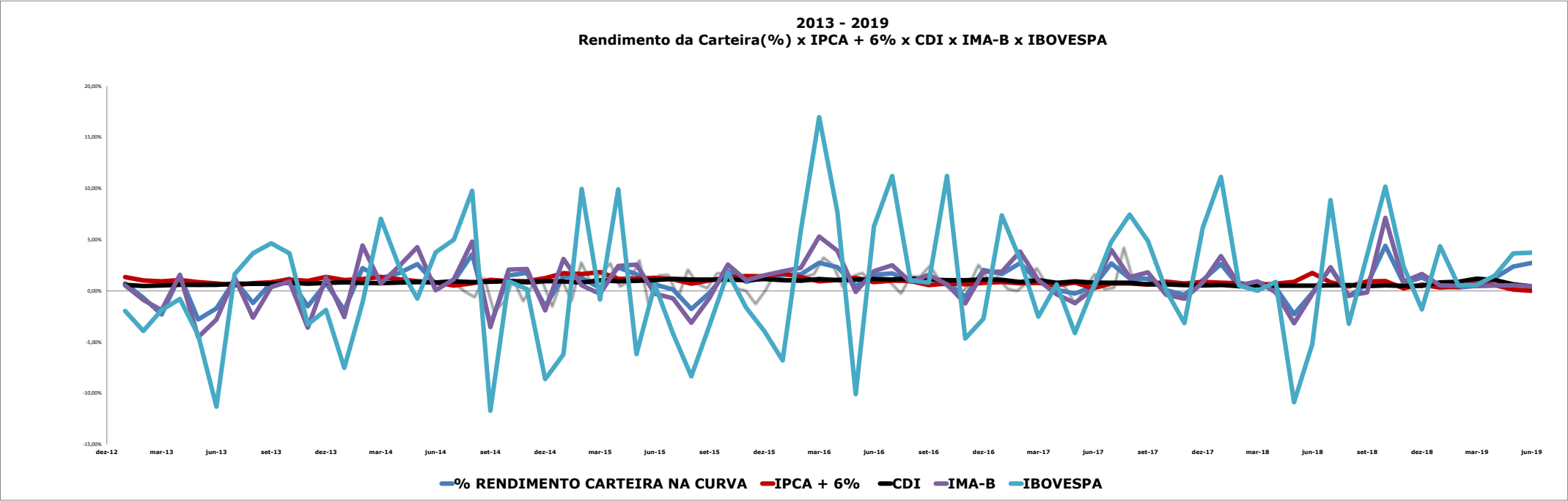
FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV - VALOR PELA CURVA DE JUROS				
DATA	SALDO R\$		RENDIMENTO R\$	% RENDIMENTO CARTEIRA NA CURVA
31/01/2019	R\$	1.933.910.720,93	R\$	8.604.309,67 0,45%
28/02/2019	R\$	1.975.770.860,51	R\$	6.242.031,26 0,32%
31/03/2019	R\$	1.989.296.202,20	R\$	9.929.509,25 0,51%
30/04/2019	R\$	2.020.246.832,16	R\$	25.422.286,46 1,27%
30/05/2019	R\$	2.073.741.420,78	R\$	48.297.438,05 2,38%
30/06/2019	R\$	2.136.463.177,82	R\$	56.562.673,43 2,73%
31/07/2019	R\$	2.169.078.542,11	R\$	27.667.981,34 1,30%
31/08/2019				
30/09/2019				
31/10/2019				
30/11/2019				
31/12/2019				
TOTAL				

FUNDO FINANCEIRO RECIFIN			
SALDO R\$		RENDIMENTO R\$	
R\$	567.775,06	R\$	5.134,80
R\$	5.211.635,36	R\$	47.000,76
R\$	375.757,49	R\$	35.294,30
R\$	536.845,30	R\$	31.209,18
R\$	267.989,95	R\$	38.116,07
R\$	703.335,93	R\$	27.627,40
R\$	582.140,86	R\$	38.370,26
TOTAL	R\$	222.752,77	

TOTAL FUNDOS: RECIPREV E RECIFIN			
SALDO R\$		RENDIMENTO R\$	
R\$	1.934.478.495,99	R\$	8.609.444,47
R\$	1.980.982.495,87	R\$	6.289.032,02
R\$	1.989.671.959,69	R\$	9.964.803,55
R\$	2.020.783.677,46	R\$	25.453.495,64
R\$	2.074.009.410,73	R\$	48.335.554,12
R\$	2.137.166.513,75	R\$	56.590.300,83
R\$	2.169.660.682,97	R\$	27.706.351,60
TOTAL	R\$	182.948.982,23	

GRÁFICO COMPARATIVO DA CARTEIRA RECIPREV





FLUXO MENSAL DE RECEBIMENTOS/PAGAMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV					
ANO 2019					
MÊS	JULHO				
RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO		COMPETÊNCIA	VALOR		ACUMULADO ANUAL
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		Contribuição de 06/2019	R\$	6.888.486,04	R\$ 55.781.183,18
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL INATIVOS/PENSIONISTAS)		Contribuição de 06/2019	R\$	1.573.255,52	R\$ 12.513.982,43
PREFEITURA DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		Contribuição de 06/2019	R\$	6.812.470,67	R\$ 53.109.525,86
PARCELAMENTO		Parcelamento 43/60	R\$	335.840,22	R\$ 2.281.037,55
COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA		07/2019	R\$	182.220,14	R\$ 1.399.082,72
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO PATRONAL)		Contribuição de 06 de 2019	R\$	51.076,17	R\$ 229.559,25
CÂMARA MUNICIPAL DO RECIFE (CONTRIBUIÇÃO SERVIDOR)		Contribuição de 06 de 2019	R\$	53.812,81	R\$ 286.246,45
TOTAL			R\$	15.897.161,57	R\$ 125.600.617,44
RECEBIMENTOS/RENDIMENTOS/AMORTIZAÇÕES ESPECÍFICAS			VALOR		ACUMULADO ANUAL
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)			R\$	31.000,00	R\$ 225.500,00
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO – FII - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)		Resgate total do fundo		R\$	69.111,00
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		Fundo Liquidado		R\$	344.883,60
SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - (RENDIMENTOS/DIVIDENDOS)			R\$	173.863,04	R\$ 495.119,95
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES) - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)			R\$	4.124,52	R\$ 103.751,66
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		-		R\$	603.623,21
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		-		R\$	2.043.521,34
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		-		R\$	720.779,44
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO - (AMORTIZAÇÃO/JUROS)		-		R\$	394.262,99
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219		-		R\$	953.376,03
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220		-		R\$	2.049.758,46
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570		-		R\$	953.376,03
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571		-		R\$	953.376,03
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)		-		R\$	603.514,14
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)		-		R\$	623.307,80
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)		-		R\$	162.167,19
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA - (DIVIDENDOS/AMORTIZAÇÃO)		-		R\$	255.060,65
TOTAL			R\$	208.987,56	R\$ 11.554.489,52
FOLHA DE PAGAMENTO E CONSIGNAÇÕES			VALOR		ACUMULADO ANUAL
FOLHA DE PAGAMENTO		-R\$		8.706.280,29	-R\$ 57.651.329,13
CONSIGNAÇÕES		-R\$		1.822.120,54	-R\$ 10.716.309,88
DEVOLUÇÕES DE FOLHA NÃO PROCESSADAS E DE CONSIGNAÇÕES		R\$		22.906,47	R\$ 31.089,87
TOTAL			-R\$	10.505.494,36	-R\$ 68.336.549,14
PAGAMENTOS DIVERSOS			VALOR		ACUMULADO ANUAL
TARIFA DE CORRETAGEM DE COMPRA E VENDA DE TÍTULOS PÚBLICOS		-		R\$	-
TARIFA DE CORRETAGEM DE FUNDOS IMOLIÁRIOS		-		-R\$	4.871,52
TARIFA DE CUSTÓDIA DE FUNDOS IMOBILIÁRIOS		-		R\$	-
TARIFA DE CUSTÓDIA TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)		-		R\$	-
CUSTO SELIC TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)		-R\$		518,14	-R\$ 3.422,71
SISTEMA QUANTUM		-R\$		1.900,00	-R\$ 13.300,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - FUNDO RECIPREV		-R\$		287.910,86	-R\$ 2.015.376,02
AUXILIO DOENÇA E OUTROS		-		R\$	-
TOTAL			-R\$	290.329,00	-R\$ 2.036.970,25
RESUMO GERAL			VALOR		ACUMULADO ANUAL
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE CONTRIBUIÇÕES, COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS E PARCELAMENTO		R\$		15.897.161,57	R\$ 125.600.617,44
TOTAL DE RECEBIMENTOS DE RENDIMENTOS/AMOTRIZAÇÕES ESPECÍFICAS		R\$		208.987,56	R\$ 11.554.489,52
TOTAL DE PAGAMENTOS DE FOLHAS E CONSIGNAÇÕES		-R\$		10.505.494,36	-R\$ 68.336.549,14
TOTAL DE PAGAMENTOS DIVERSOS		-R\$		290.329,00	-R\$ 2.036.970,25
TOTAL			R\$	5.310.325,77	R\$ 66.781.587,57

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\$	1.900,00	-R\$	13.300,00	
Contrato de Custódia Títulos junto ao Banco do Brasil S.A. O custo é somente o da SELIC										-R\$	518,14	-R\$	3.422,71	
Contrato com a Corretora Santander. Destinado a venda dos fundos: FII BB Recebíveis Imobiliário e Caixa Rio Bravo Fundo de Investimento Imobiliário - FII.Custo 0,10% de corretagem e os custos normais da operação.										-		-R\$	4.749,54	
Contrato com a Corretora. Destinado a venda do fundo Socopa FII. Custo zero de corretagem. Somente os custos normais da operação.										-		-R\$	121,98	
Contrato com a Corretora XPI. Destinado aos serviços de compra e venda de Títulos Públicos. Custo sobre as operações, quando houver, 0,001%										-		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\$	-	
Contrato com a LDB Consultoria Financeira LTDA - EPP, no valor global de R\$ 30.000,00 (Trinta mil reais), para realizar o estudo de Asset Liability Management (ALM), Cash Flow Matching e Fronteira Eficiente.										-		R\$	-	
TOTAL										-R\$	2.418,14	-R\$	21.594,23	

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 ficará entre	Em 95% dos dados o retorno ficará entre
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	IPCA+9,00%	-0,61%	-7,10%	-41,37%	33,60%	-54,62%	13	74	2	85	6,99%	19,25%	0,24	-7,60% e 6,38%	-14,60% e 13,37%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Índice Small Cap	1,33%	17,20%	290,59%	14,87%	-10,30%	68	35	67	36	4,66%	5,55%	0,16	-3,33% e 6,00%	-8,00% e 10,66%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	IGC	0,60%	7,47%	85,58%	11,85%	-9,83%	56	47	27	76	4,82%	4,53%	0,17	-4,22% e 5,42%	-9,04% e 10,25%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IBOVESPA	0,89%	11,20%	87,36%	11,10%	-9,70%	43	28	35	36	5,11%	3,69%	0,18	-4,23% e 6,00%	-9,34% e 11,12%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,72%	9,05%	104,34%	1,17%	0,39%	99	0	1	98	0,23%	0,03%	0,01	0,50% e 0,95%	0,27% e 1,18%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA IPCA 2A	0,96%	12,13%	157,10%	3,50%	-0,91%	89	10	36	63	0,77%	0,56%	0,03	0,19% e 1,72%	-0,57% e 2,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	1,06%	13,47%	195,91%	7,07%	-4,50%	75	28	18	85	2,06%	2,22%	0,07	-1,00% e 3,12%	-3,06% e 5,18%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	0,97%	12,23%	66,46%	2,53%	-0,52%	50	3	22	31	0,66%	0,64%	0,02	0,31% e 1,63%	-0,35% e 2,29%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + 6,00%	1,11%	14,17%	107,23%	5,90%	-0,27%	65	1	35	31	0,78%	0,96%	0,03	0,33% e 1,89%	-0,45% e 2,67%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + 6,00%	1,16%	14,87%	116,80%	5,14%	-3,13%	53	14	37	30	1,60%	1,43%	0,06	-0,44% e 2,76%	-2,03% e 4,36%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	1,12%	14,27%	105,97%	4,77%	-2,78%	55	10	30	35	1,45%	1,37%	0,05	-0,33% e 2,56%	-1,78% e 4,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA GERAL EX-C	0,98%	12,38%	40,57%	3,50%	-1,34%	30	5	20	15	0,96%	1,20%	0,03	0,01% e 1,94%	-0,95% e 2,91%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B5+	1,18%	15,15%	220,14%	10,54%	-6,15%	68	31	24	75	3,08%	3,40%	0,11	-1,89% e 4,26%	-4,97% e 7,34%
BB AÇÕES DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IDIV	0,62%	7,71%	89,10%	10,03%	-11,15%	56	47	46	57	4,47%	3,74%	0,15	-3,85% e 5,09%	-8,32% e 9,56%
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	IMA-B	1,08%	13,78%	202,92%	7,43%	-4,37%	75	28	53	50	2,09%	2,33%	0,07	-1,01% e 3,17%	-3,10% e 5,26%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	IBOVESPA	0,90%	11,37%	151,99%	12,66%	-12,05%	58	45	57	46	4,81%	3,88%	0,17	-3,91% e 5,71%	-8,72% e 10,52%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RF IMA-B 5	IMA-B 5	1,00%	12,69%	79,91%	3,17%	-1,72%	55	4	23	36	0,85%	0,89%	0,03	0,15% e 1,85%	-0,70% e 2,70%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	CDI	0,54%	6,65%	61,25%	0,93%	0,25%	89	0	0	89	0,21%	0,02%	0,01	0,32% e 0,75%	0,11% e 0,97%
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	IPCA+ 10,50%	0,36%	4,39%	44,63%	39,38%	-20,82%	9	94	3	100	5,29%	0,27%	0,18	-4,93% e 5,65%	-10,22% e 10,94%
TERRAS BRASIL – FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	IPCA+6,00%	-1,12%	-12,65%	-50,27%	104,77%	-62,23%	3	59	2	60	16,08%	8,42%	0,56	-17,20% e 14,96%	-33,27% e 31,03%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,09%	13,87%	106,56%	6,15%	-3,32%	49	18	26	41	1,86%	1,84%	0,06	-0,78% e 2,95%	-2,64% e 4,82%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,03%	13,10%	72,22%	6,15%	-3,32%	39	14	19	34	1,70%	1,83%	0,06	-0,67% e 2,73%	-2,36% e 4,42%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,21%	15,54%	118,69%	9,10%	-4,91%	45	20	31	34	2,67%	2,79%	0,09	-1,46% e 3,88%	-4,13% e 6,56%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	1,19%	15,20%	86,79%	9,10%	-4,02%	37	16	27	26	2,52%	2,79%	0,09	-1,33% e 3,70%	-3,85% e 6,22%

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 ficará entre	Em 95% dos dados o retorno ficará entre
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	IBRX-50	0,30%	3,68%	36,36%	11,94%	-13,12%	55	48	40	63	5,28%	4,38%	0,18	-4,98% e 5,58%	-10,26% e 10,86%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B 5	0,97%	12,33%	171,37%	3,61%	-1,59%	93	10	15	88	0,83%	0,85%	0,03	0,14% e 1,80%	-0,68% e 2,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IDKA IPCA 2A	0,92%	11,57%	113,18%	2,90%	-0,91%	76	7	29	54	0,74%	0,55%	0,03	0,18% e 1,66%	-0,56% e 2,39%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Índice Small Cap	0,62%	7,71%	64,05%	13,33%	-13,84%	44	36	39	41	5,06%	5,05%	0,18	-4,44% e 5,68%	-9,50% e 10,74%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,60%	7,49%	72,89%	11,71%	-11,45%	54	37	43	48	5,00%	4,65%	0,17	-4,40% e 5,60%	-9,40% e 10,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IBOVESPA	2,05%	27,50%	107,28%	14,23%	-7,92%	24	12	23	13	4,88%	5,96%	0,17	-2,84% e 6,93%	-7,72% e 11,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IPCA	1,08%	13,80%	71,35%	3,82%	-1,11%	47	3	25	25	0,94%	0,80%	0,03	0,14% e 2,03%	-0,81% e 2,97%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	IPCA+8,00%	0,05%	0,57%	3,73%	14,74%	-0,55%	1	76	1	76	1,70%	0,01%	0,06	-1,65% e 1,74%	-3,35% e 3,44%
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	CDI	0,85%	10,73%	63,67%	1,26%	0,47%	58	0	53	5	0,26%	0,05%	0,01	0,59% e 1,11%	0,33% e 1,38%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBRX	0,85%	10,68%	138,93%	12,29%	-9,12%	66	37	53	50	3,79%	4,75%	0,13	-2,94% e 4,64%	-6,73% e 8,42%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	IPCA + 6,9506%	1,07%	13,61%	87,27%	4,31%	-1,67%	49	10	33	26	1,24%	1,40%	0,04	-0,17% e 2,31%	-1,41% e 3,55%
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B 5	0,94%	11,92%	141,61%	3,10%	-1,58%	85	9	12	82	0,82%	0,85%	0,03	0,12% e 1,77%	-0,70% e 2,59%
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES	IBOVESPA	0,76%	9,51%	118,07%	11,43%	-11,26%	58	45	58	45	4,82%	4,51%	0,17	-4,06% e 5,58%	-8,88% e 10,40%
SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	IPCA+7,50%	1,09%	13,93%	109,36%	12,50%	-2,75%	49	19	30	38	2,10%	3,79%	0,07	-1,01% e 3,20%	-3,11% e 5,30%
SUL AMÉRICA EQUITIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBRX-50	0,49%	6,05%	65,57%	14,70%	-17,93%	56	47	51	52	5,56%	4,74%	0,19	-5,07% e 6,05%	-10,64% e 11,62%
SUL AMÉRICA EVOLUTION FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	CDI	0,86%	10,86%	138,14%	4,42%	-2,70%	88	13	64	37	1,03%	0,14%	0,04	-0,17% e 1,90%	-1,20% e 2,93%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RF LONGO PRAZO	IMA-B	1,09%	13,88%	205,18%	6,85%	-4,08%	79	24	56	47	2,06%	2,06%	0,07	-0,97% e 3,15%	-3,02% e 5,20%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	125% do DI	2,05%	27,59%	281,95%	740,83%	-69,06%	57	9	44	22	98,74%	215,99%	3,42	-96,69% e 100,79%	-195,42% e 199,53%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219 (7604)	IPCA+7.002299%	0,66%	8,22%	97,01%	11,73%	-22,16%	63	40	51	52	4,45%	7,65%	0,15	-3,79% e 5,11%	-8,23% e 9,56%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220 (7608)	IPCA+7.002655%	0,66%	8,22%	97,00%	11,73%	-22,17%	63	40	51	52	4,45%	7,65%	0,15	-3,79% e 5,11%	-8,23% e 9,56%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 (7647)	IPCA+6.261127%	0,75%	9,32%	114,84%	11,73%	-14,83%	63	40	55	48	4,12%	5,80%	0,14	-3,38% e 4,87%	-7,50% e 8,99%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571 (7632)	IPCA+6.269771%	0,74%	9,31%	114,62%	11,73%	-14,92%	63	40	54	49	4,13%	5,82%	0,14	-3,38% e 4,87%	-7,51% e 9,00%
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	0,89%	11,19%	148,47%	12,09%	-11,40%	65	38	59	44	3,83%	4,63%	0,13	-2,94% e 4,72%	-6,78% e 8,55%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	IDIV	0,75%	9,41%	86,29%	12,57%	-10,58%	49	34	41	42	3,95%	5,01%	0,14	-3,20% e 4,70%	-7,14% e 8,65%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	CDI	0,86%	10,85%	142,12%	2,19%	-0,27%	100	3	63	40	0,42%	0,36%	0,01	0,44% e 1,28%	0,02% e 1,71%
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IMA-B 5	1,08%	13,71%	113,85%	4,11%	-2,49%	60	11	41	30	1,22%	1,25%	0,04	-0,14% e 2,29%	-1,36% e 3,51%
WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	Sem benchmark	0,45%	5,56%	59,16%	15,06%	-11,03%	52	51	52	51	5,18%	4,54%	0,18	-4,72% e 5,63%	-9,90% e 10,80%
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Sem benchmark	1,33%	17,15%	191,14%	15,80%	-11,09%	53	28	45	36	4,94%	6,17%	0,17	-3,61% e 6,27%	-8,56% e 11,21%
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LP	IMA-B 5	0,95%	11,99%	131,63%	3,11%	-1,50%	78	11	43	46	0,82%	0,89%	0,03	0,13% e 1,77%	-0,69% e 2,58%
XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	CDI	0,92%	11,68%	158,07%	3,62%	-2,41%	88	15	56	47	1,09%	1,15%	0,04	-0,17% e 2,02%	-1,26% e 3,11%
CARTEIRA RECIPREV	IPCA+6% ano	0,93%	11,69%	158,28%	4,55%	-2,78%	82	21	51	52	1,38%	1,32%	0,05	-0,46% e 2,31%	-1,84% e 3,69%

FUNDO	Retorno Relativo ao Benchmark	Retorno Relativo ao CDI	Retorno Relativo ao IBOVESPA	Retorno Relativo ao IMA B	Retorno Relativo ao IPCA + 6% ano	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)
BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	-78,98%	-70,24%	-64,40%	-75,47%	-74,31%	-0,70	-0,92	24,18%	11,23%	9,71%	-0,047	0,040	-0,72	8,46	7,09%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	145,81%	72,20%	165,87%	28,50%	46,08%	0,45	1,26	9,23%	9,11%	11,00%	-0,116	0,728	0,47	0,95	2,78%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	-8,77%	-18,18%	26,33%	-38,94%	-30,59%	-0,15	-1,07	1,08%	8,65%	10,32%	-0,061	0,969	-0,16	0,99	0,32%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-7,97%	4,82%	-7,97%	-18,26%	-4,81%	0,05	-0,26	5,95%	9,43%	10,39%	-0,075	0,963	0,05	0,76	1,71%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-6,75%	-6,75%	32,73%	-31,12%	-19,63%	-1,18	-13,65	0,07%	1,10%	0,80%	0,996	-0,019	-44,56	0,76	0,07%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-5,19%	17,32%	67,00%	-13,34%	1,11%	0,81	-1,29	0,56%	2,22%	2,19%	0,266	0,182	1,14	0,93	0,17%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-2,65%	30,46%	101,43%	-2,65%	10,68%	0,49	-1,74	0,20%	4,47%	5,43%	0,147	0,490	0,54	0,91	0,06%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	-14,66%	8,19%	-15,66%	-14,66%	2,84%	0,87	-0,78	5,27%	2,05%	2,02%	0,222	0,289	1,47	0,22	1,54%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	11,04%	20,44%	-3,04%	-12,83%	11,04%	1,41	0,83	2,60%	2,40%	2,41%	-0,030	0,181	2,04	0,99	0,76%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	14,95%	24,96%	9,68%	-6,41%	14,95%	0,81	0,51	5,59%	3,80%	4,04%	0,068	0,522	0,96	0,56	1,62%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FUNDO DE INVESTIMENTO	-9,51%	20,65%	-4,73%	-9,51%	11,65%	0,78	-0,73	2,91%	3,51%	3,73%	0,084	0,525	0,93	0,54	0,85%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO	11,05%	11,05%	-20,06%	-9,09%	7,81%	1,19	10,84	0,37%	2,57%	2,41%	0,209	0,682	1,54	1,06	0,10%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-2,11%	46,09%	107,95%	7,91%	25,91%	0,49	-0,28	1,08%	6,29%	7,83%	0,128	0,506	0,52	0,91	0,31%
BB AÇÕES DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-15,68%	-16,63%	28,72%	-37,79%	-29,27%	-0,15	-0,21	10,25%	8,08%	9,85%	-0,036	0,885	-0,16	0,65	2,96%
BRANCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	-0,34%	33,55%	106,20%	-0,34%	13,29%	0,52	-0,14	0,33%	4,54%	5,51%	0,137	0,492	0,58	0,96	0,09%
BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	71,53%	11,10%	71,53%	-17,10%	-5,75%	0,08	0,77	8,77%	8,93%	10,09%	-0,053	0,901	0,09	0,78	2,56%
BRANCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RF IMA-B 5	-1,31%	10,82%	8,30%	-9,83%	3,05%	0,79	-1,19	0,25%	2,40%	2,49%	0,188	0,315	1,13	0,96	0,08%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO	-19,37%	-19,37%	4,23%	-36,60%	-30,63%	-4,23	-41,94	0,07%	0,89%	0,65%	0,997	0,022	68,13	0,53	0,24%
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	-61,97%	-36,24%	-1,55%	-52,42%	-45,91%	-0,31	-0,68	18,27%	9,18%	8,75%	0,090	-0,155	-0,32	0,06	5,31%
TERRAS BRASIL – FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	-72,11%	-70,16%	-74,97%	-76,50%	-72,11%	-0,41	-0,44	55,70%	26,51%	23,64%	-0,172	0,085	-0,42	9,54	15,97%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	-10,83%	19,05%	4,50%	-10,83%	9,52%	0,54	-0,79	2,99%	4,17%	4,60%	0,027	0,503	0,62	0,73	0,88%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	-11,71%	11,94%	-12,74%	-11,71%	6,40%	0,49	-0,99	3,28%	3,84%	4,32%	0,075	0,573	0,58	0,73	0,97%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	-3,92%	28,10%	1,16%	-3,92%	18,54%	0,56	-0,28	3,05%	5,64%	6,64%	0,032	0,613	0,61	1,13	0,87%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	-4,24%	21,41%	-5,36%	-4,24%	15,40%	0,57	-0,16	7,32%	5,36%	6,38%	0,057	0,661	0,64	1,13	2,10%

FUNDO	Retorno Relativo ao Benchmark	Retorno Relativo ao CDI	Retorno Relativo ao IBOVESPA	Retorno Relativo ao IMA B	Retorno Relativo ao IPCA + 6% ano	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)
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	-21,59%	-39,88%	-7,18%	-55,14%	-49,00%	-0,35	-1,01	2,95%	9,12%	10,58%	-0,070	0,978	-0,36	0,93	0,88%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	-2,17%	19,64%	84,72%	-10,72%	1,49%	0,81	-1,85	0,16%	2,34%	2,46%	0,245	0,261	1,10	0,92	0,05%
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	16,59%	19,26%	4,71%	-7,00%	8,30%	1,10	4,03	0,61%	2,13%	2,16%	0,263	0,262	1,61	0,58	0,18%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3,96%	-12,97%	-7,39%	-22,79%	-23,38%	-0,13	0,12	5,17%	9,07%	11,20%	0,006	0,833	-0,14	0,92	1,48%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-3,62%	-14,94%	-3,62%	-34,53%	-27,05%	-0,13	-0,06	8,22%	8,95%	10,45%	-0,067	0,915	-0,14	0,96	2,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	16,67%	61,79%	16,67%	32,87%	57,43%	1,12	0,86	7,40%	10,19%	9,89%	-0,022	0,914	1,17	0,83	2,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2,20%	14,71%	-11,20%	-7,95%	10,39%	1,13	0,19	3,11%	2,64%	2,60%	0,335	0,579	1,59	0,31	0,89%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIS MAUÁ DO BRASIL INFRAESTRUTURA	-55,46%	-44,08%	-41,49%	-50,41%	-49,79%	-1,62	-2,33	5,80%	2,85%	2,68%	0,184	-0,091	-1,88	0,00	1,96%
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,73%	1,73%	-13,00%	-20,86%	-5,23%	0,43	4,69	0,08%	1,28%	0,97%	0,995	-0,072	47,34	1,09	0,04%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	24,55%	5,34%	62,64%	-21,39%	-10,64%	0,05	0,29	9,51%	7,15%	8,71%	-0,082	0,834	0,05	0,95	2,74%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII	7,27%	15,36%	12,73%	-6,14%	7,27%	0,76	0,35	4,56%	3,12%	3,55%	-0,001	0,554	0,95	0,01	1,31%
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	-1,46%	15,79%	24,17%	-11,96%	-0,93%	0,73	-2,41	0,09%	2,30%	2,44%	0,220	0,326	1,00	0,92	0,03%
SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES	48,44%	-3,86%	48,44%	-28,26%	-18,44%	-0,03	0,65	7,62%	8,80%	10,19%	-0,079	0,929	-0,03	0,89	2,21%
SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,12%	19,73%	7,92%	-10,79%	9,51%	0,49	0,03	7,23%	4,57%	5,28%	0,081	0,224	0,55	1,94	2,07%
SUL AMÉRICA EQUITIES FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-4,80%	-27,01%	12,70%	-45,53%	-38,08%	-0,21	-0,06	10,84%	9,80%	11,95%	-0,103	0,839	-0,21	0,93	3,11%
SUL AMÉRICA EVOLUTION FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	6,79%	6,79%	57,61%	-21,40%	-8,63%	0,24	0,25	3,45%	2,57%	2,31%	0,274	0,217	0,31	0,76	0,99%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RF LONGO PRAZO	0,40%	34,55%	107,74%	0,40%	14,14%	0,54	0,04	1,20%	4,49%	5,42%	0,154	0,483	0,61	0,84	0,34%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP (COTAS SÊNIORES)	93,97%	121,99%	78,71%	60,67%	104,66%	0,05	0,04	342,22%	178,19%	262,16%	0,001	-0,051	0,05	1.621,31	99,14%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359219 (7604)	-32,60%	-13,14%	34,11%	-35,18%	-26,32%	-0,12	-0,33	15,41%	8,08%	7,08%	0,103	0,533	-0,12	0,13	4,44%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 10359220 (7608)	-32,60%	-13,14%	34,10%	-35,19%	-26,32%	-0,12	-0,33	15,41%	8,08%	7,08%	0,103	0,533	-0,12	0,13	4,44%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650570 (7647)	-22,00%	-5,28%	46,25%	-29,32%	-19,65%	-0,05	-0,22	14,29%	7,61%	7,13%	0,103	0,533	-0,05	0,42	4,11%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)-CÓDIGO: 6650571 (7632)	-22,13%	-5,38%	46,09%	-29,39%	-19,73%	-0,05	-0,23	14,31%	7,62%	7,13%	0,103	0,533	-0,05	0,41	4,11%
VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	69,13%	9,54%	69,13%	-18,26%	-7,07%	0,09	0,52	12,77%	7,26%	9,21%	0,004	0,777	0,09	0,78	3,69%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	3,59%	-2,82%	4,41%	-17,17%	-15,68%	-0,03	0,04	15,33%	7,32%	9,67%	-0,040	0,800	-0,04	0,83	4,40%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	6,75%	6,75%	64,81%	-20,34%	-9,44%	0,58	0,65	1,30%	1,56%	1,48%	0,477	0,285	1,19	0,23	0,38%
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,20%	19,64%	5,04%	-6,70%	8,64%	0,81	0,48	1,66%	3,08%	3,44%	0,087	0,395	1,00	1,32	0,48%
WESTERN ASSET VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	8,34%	-29,83%	8,34%	-47,64%	-40,47%	-0,25	0,12	8,31%	9,10%	10,58%	0,003	0,908	-0,26	0,89	2,39%
XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	64,38%	53,63%	63,19%	36,31%	34,57%	0,42	0,60	13,94%	9,58%	11,63%	-0,003	0,838	0,44	1,06	4,03%
XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LP	-0,19%	15,82%	49,72%	-8,92%	-0,36%	0,78	-0,04	0,79%	2,30%	2,50%	0,200	0,351	1,07	0,95	0,23%
XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	13,78%	13,78%	75,67%	-15,10%	-3,48%	0,44	0,46	3,64%	2,73%	2,01%	0,274	0,201	0,55	-11,34	1,05%
CARTEIRA RECIPREV	-3,40%	13,87%	75,81%	-15,03%	-3,40%	0,35	-0,09	4,85%	3,21%	3,57%	0,151	0,516	0,42	0,46	1,39%

CONCEITOS

* Base de dados: Quantum; Econômica; 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 a RECIPREV efetuou as aplicações ou resgates no ativo. Este fato, altera os cálculos, em particular, no mês do referido evento, para mais ou para menos em todos os indicadores desta planilha, porém, não de forma significativa;

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

****A Reciprev possui fundos imobiliários com as seguintes Características: a) de renda; b) recebíveis com retornos programados; c) recebíveis sem retorno programado; Todos os fundos são cotados na BM&FBovespa. Pelas características dos fundos imobiliários, alguns indicadores demonstrados nesta planilha podem não cumprir de forma correta sua função conceitual

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

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

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

➤ Benchmark: Indicador de retorno do fundo

➤ Retorno médio mensal: Quanto o ativo proporcionou de retorno médio mensal, considerando o período avaliado do ativo, tendo como base o período da observação (**);

➤ Retorno médio anual: Quanto o ativo proporcionou de retorno médio anual, considerando o período avaliado do ativo, tendo como base o período da observação (**);

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

➤ Retorno em relação ao IPCA+6% ano: Trata-se do comparativo do retorno do ativo em todo o período avaliado em relação ao retorno de IPCA+6% ano no mesmo período avaliado;

➤ 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 movimentam 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 movimentam em relação ao comportamento do Ibovspa.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;

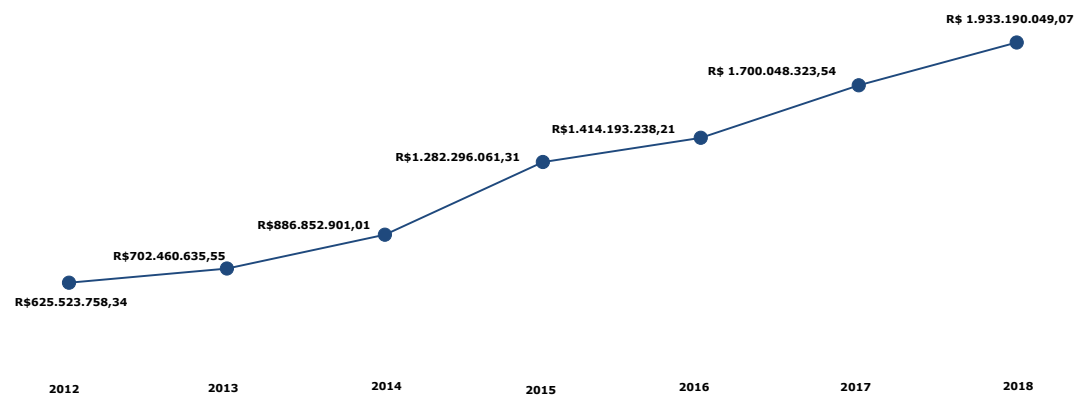
➤ Sharpe Modificado: Dado pela fórmula: (Retorno médio anual do ativo - Retorno médio anual do CDI) / (Risco anual do Ativo - Risco anual do CDI). Comparado com o Índice Sharpe, leva em consideração o risco do "ativo livre de risco". Portanto, quanto maior, melhor;

➤ 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;

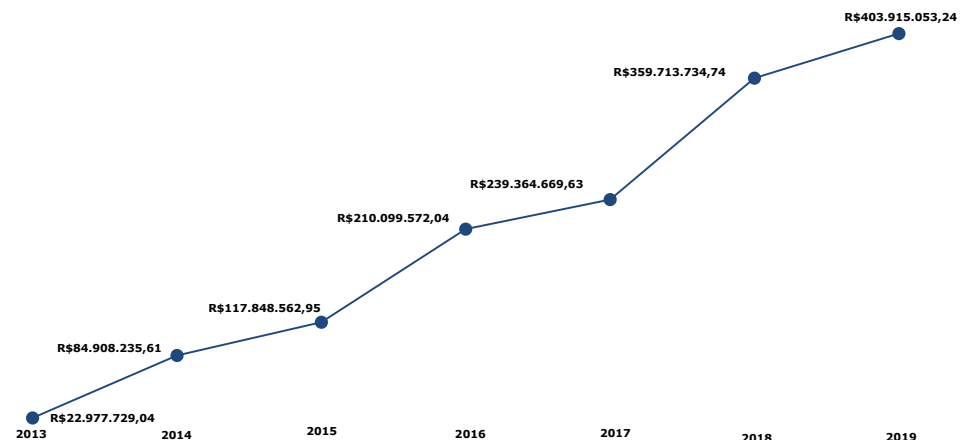
➤ Erro Quadrático Médio (EQM): Mede o quanto o retorno de um fundo se afasta do retorno de seu benchmark. Quanto mais próximo de zero maior a aderência dos retornos ao benchmark;

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

Fundo Previdenciário Reciprev - Total de Ativos

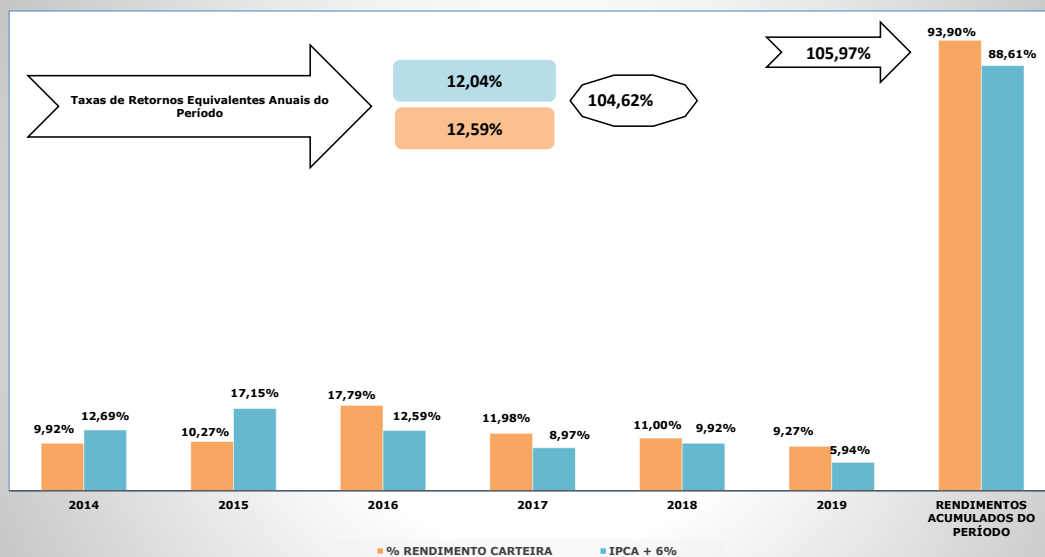


Fundo Previdenciário Reciprev - Superavit Atuarial

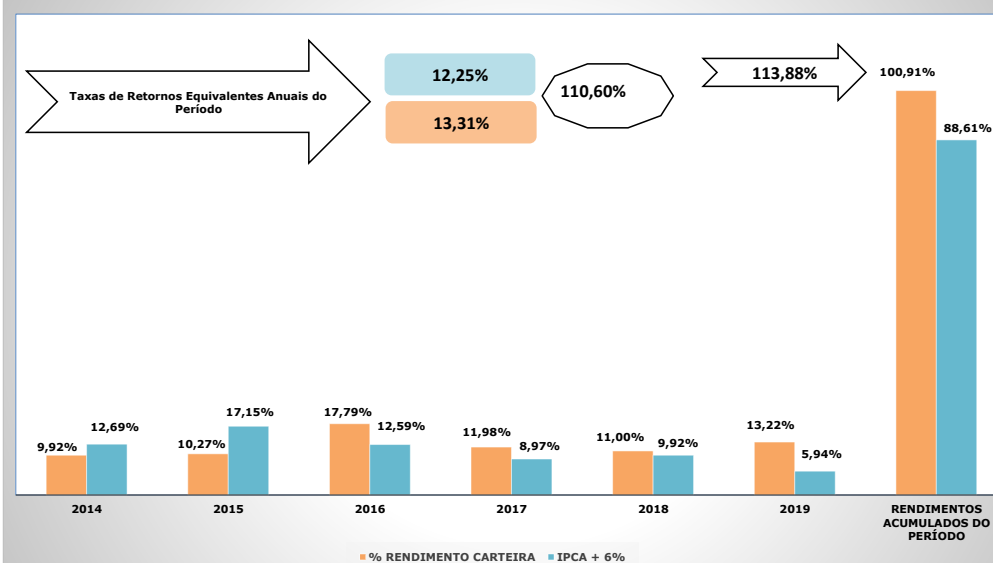


RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV: 2014 À 2019

Retornos Anuais RECIPREV pela curva de juros x Meta



Retornos Anuais RECIPREV à mercado x Meta



RESUMOS OPERACIONAIS - QUANTIDADES APROXIMADAS: 2014 À 2019

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)
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	9	184	0	272
TOTAIS	73	1.172	34	1.960

EQUIPE DA GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS RECIPREV

PANORAMA MACROECONÔMICO

O IPCA do mês de julho ficou em 0,19%, alinhado com a expectativa do mercado. Durante o mês de julho, tivemos a aprovação em primeiro turno da PEC da Previdência.

DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV							
IPCA do mês de	JULHO	0,19%	Sendo	Meta Atuarial para o Ano de 2019			IPCA + 6,00% ao ano
Meta Atuarial para o mês de	JULHO	0,72%		Meta Atuarial acumulada no ano de 2019			5,94%
Rentabilidade da Carteira de Investimentos Reciprev em	JULHO	1,30%		Renda Fixa	1,03%	Renda Variável	1,97%
Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos Reciprev no ano de 2019		9,27%		Percentual de atingimento da meta atuarial acumulada no ano de 2019			156,10%

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

Este é o relatório mensal da Carteira de Investimentos do Fundo Previdêncio Reciprev em conformidade com a Portaria MPS Nº 519, de 24 de agosto de 2011, Art. 3º, V, que submetemos ao Comitê de Investimentos da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde para deliberação e controle.

Os fundos de investimentos que compõem a Carteira de Investimentos Reciprev e que possuem lâminas constam do site: reciprev.recife.pe.gov.br.

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Divisão de Investimentos

Paulo José Batbosa
Equipe Investimentos

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

Concordamos com as informações do presente relatório.

Manoel Carneiro Soares Cardoso
Diretor Presidente

Francisco Canindé Antunes Furtado Junior
Diretor Vice-Presidente

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Divisão de Investimentos

Paulo José Barbosa
Equipe Investimentos

Rodrigo Chagas de Sá
Representante Titular da Secretaria de Finanças da Prefeitura do Recife

Roberto Wagner Martins Mateus
Representante Titular da Secretaria de Administração e Gestão de Pessoas da Prefeitura do Recife

Originais assinados e arquivados na Reciprev

Recife (PE), 08 de agosto de 2019