RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE

RECI
PREV

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

DATA	31/05/2022

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$ 57.564.555,32	Indeterminado	D +29	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	5,83%	2,72%	20,21%	11,67%	10,93%	9,74%
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$ 3.517.721,62	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	2	Risco Baixo	0,33%	0,56%	1,14%	-10,03%	1,16%	1,05%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO	19.523.305/0001-06	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IMA-B	R$ 5.574.087,43	Indeterminado	D+66	Médio Prazo	2	Risco Baixo	0,69%	0,83%	2,38%	-11,55%	1,93%	1,83%
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$ 55.201.749,61	Indeterminado	D+797	Longo Prazo	5	Risco Muito Alto	0,83%	0,94%	2,89%	-7,46%	2,29%	1,98%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	15.486.093/0001-83	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IPCA + 6,00%	R$ 26.061.551,47	Indeterminado	D+340	Médio Prazo	4	Risco Alto	1,44%	0,95%	4,99%	-16,06%	3,35%	3,00%
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$ 32.474.999,71	Indeterminado	D+797	Médio Prazo	4	Risco Alto	1,35%	1,28%	4,68%	20,99%	3,15%	2,74%
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 55.737.473,69	Indeterminado	D+4	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	6,45%	3,46%	22,36%	107,82%	11,38%	11,79%
BNB IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	08.266.261/0001-60	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IMA-B	R$ 20.180.648,07	Indeterminado	D+1	Curto Prazo	3	Risco Médio	1,90%	1,54%	6,60%	44,14%	3,98%	3,48%
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$ 17.323.164,40	Indeterminado	D+29	Curto Prazo	4	Risco Alto	4,82%	4,00%	16,71%	329,51%	9,20%	8,98%
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$ 35.247.020,83	Indeterminado	D+7	Curto Prazo	4	Risco Alto	6,40%	4,81%	22,16%	177,68%	11,57%	10,98%
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$ 99.931,98	Indeterminado	D +0	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,17%	3,56%	4,05%	24,13%	2,24%	1,04%
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$ 93.644.827,84	Indeterminado	D+3	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,50%	5,37%	19,05%	205,10%	10,04%	8,20%
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$ 182.631.670,46	5 anos (1.826 dias). Vence 23/03/2027	D+1	Médio Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,67%	0,67%	2,33%	-1,48%	1,85%	1,85%
TERRAS BRASIL – FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	19.412.474/0001-79	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	Fundos Estruturados	Fundos de Investimento em Participações (FIP) - Art. 10, II	IPCA+6,00%	R$ 956.840,70	6,14 anos (2.243Dias)	D+0	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	17,43%	17,72%	60,38%	-48,78%	29,54%	32,63%
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$ 26.617.875,00	Indeterminado	D+798	Médio Prazo	3	Risco Médio	1,71%	1,25%	5,92%	-60,13%	3,73%	3,41%
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$ 32.120.380,00	Indeterminado	D+798	Médio Prazo	3	Risco Médio	1,61%	1,61%	5,57%	-82,45%	3,50%	3,26%

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$ 7.359.208,00	Indeterminado	D+2979	Longo Prazo	3	Risco Médio	2,59%	1,98%	8,96%	9,37%	5,15%	4,59%
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$ 11.403.980,00	Indeterminado	D+2989	Longo Prazo	3	Risco Médio	2,65%	2,98%	9,17%	-8,60%	5,05%	3,69%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15.154.220/0001-47	CAIXA DTVM S/A	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	Índice Small Cap	R$ 0,01	Indeterminado	D+3	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	6,34%	4,64%	21,95%	74,59%	11,19%	10,19%
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$ 41.205.964,56	Indeterminado	D+25	Curto Prazo	4	Risco Alto	7,89%	5,02%	27,33%	5,17%	13,61%	12,46%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	11.182.064/0001-77	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 54.974.281,10	Indeterminado	D +15	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,98%	6,31%	20,71%	163,20%	10,81%	9,44%
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$ 12.945.956,97	Indeterminado	D +3	Curto Prazo	4	Risco Alto	7,43%	4,16%	25,72%	-14,06%	13,15%	12,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	23.731.629/0001-07	ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBOVESPA	R$ 38.338.708,31	Indeterminado	D+23	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	7,37%	3,32%	25,52%	80,36%	13,36%	12,45%
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	19.488.768/0001-84	MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	Renda Fixa	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V,"b"	CDI	R$ 15.606.767,89	Indeterminado	D+1	Curto Prazo	2	Risco Baixo	0,84%	1,72%	2,92%	32,13%	1,96%	1,37%
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$ 30.138.447,24	Indeterminado	D+15	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,60%	4,55%	19,40%	33,57%	10,26%	7,88%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	09.289.072/0001-75	QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IBRX	R$ 10.064.819,77	Indeterminado	15,00	Curto Prazo	4	Risco Alto	4,86%	3,36%	16,85%	0,38%	8,89%	9,49%
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$ 6.199.692,29	6 anos (2.190 Dias)	D+0	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	6,31%	0,11%	21,85%	-72,48%	10,42%	10,30%
BB RECEBIVEIS 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$ 2.449.594,13	10 anos (3.650 Dias)	D+824	Médio Prazo	3	Risco Médio	3,77%	1,35%	13,05%	-77,97%	7,15%	7,18%
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$ 2.797.051,50	30/11/2028	D +3	Médio Prazo	3	Risco Médio	6,77%	17,65%	23,44%	34,78%	13,12%	18,87%
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$ 5.651,91	10 anos (3.650 Dias)	D +1080	Médio Prazo	5	Risco Muito Alto	107,12%	20,25%	371,06%	-99,99%	197,76%	186,10%
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$ 35.430.923,00	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	3,87%	1,11%	13,40%	16,01%	7,17%	7,27%
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$ 76.176.484,45	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	3,87%	1,11%	13,40%	-4,38%	7,17%	7,26%
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$ 38.890.826,00	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	3,59%	1,23%	12,44%	81,16%	6,74%	6,68%
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$ 38.886.187,00	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	3,60%	1,24%	12,46%	41,61%	6,74%	6,65%
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$ 45.917.601,27	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,08%	1,08%	3,74%	-72,18%	2,75%	2,75%
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$ 45.917.601,27	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,08%	1,08%	3,74%	-71,94%	2,75%	2,75%
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$ 45.917.601,27	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,08%	1,08%	3,74%	-69,04%	2,75%	2,75%
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$ 137.664.190,02	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,08%	1,08%	3,75%	-70,51%	2,75%	2,75%

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$ 91.776.126,68	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,08%	1,08%	3,75%	-2,31%	2,75%	2,75%
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$ 136.033.220,61	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,29%	0,29%	1,01%	-74,27%	1,77%	1,77%
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$ 45.294.291,51	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,29%	0,29%	1,01%	-74,24%	1,77%	1,77%
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$ 45.294.291,51	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,29%	0,29%	1,01%	-72,15%	1,77%	1,77%
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$ 22.647.145,76	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,29%	0,29%	1,01%	-72,11%	1,77%	1,77%
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$ 181.177.166,04	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,34%	0,34%	1,19%	-1,40%	1,77%	1,77%
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$ 52.194.460,94	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,08%	1,08%	3,74%	-5,74%	2,50%	2,50%
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$ 43.707.014,45	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,11%	1,11%	3,84%	-5,51%	2,56%	2,56%
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$ 131.121.043,35	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,11%	1,11%	3,84%	-5,48%	2,56%	2,56%
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$ 174.828.057,80	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,11%	1,11%	3,84%	-2,29%	2,56%	2,56%
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$ 43.683.185,87	Até o dia 15/08/2040	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	3,08%	3,08%	10,66%	-13,00%	4,33%	4,33%
TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045-CÓDIGO: 19447309)	-	TESOURO NACIONAL	Renda Fixa	Renda Fixa	IPCA+5,730%	R$ 106.129.375,05	Até o dia 15/05/2045	D +14760	Longo Prazo	1	Risco Muito Baixo	1,71%	1,71%	5,94%	-11,22%	2,61%	2,61%
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$ 30.629.676,00	Indeterminado	D +3	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,78%	3,02%	20,03%	6,97%	10,28%	10,73%
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$ 15.014.244,61	#N/D	D+0	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,26%	0,23%	0,89%	-54,79%	0,76%	0,99%
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$ 5.541.836,68	Indeterminado	D +1	Curto Prazo	2	Risco Baixo	0,59%	0,15%	2,03%	-48,42%	1,43%	1,69%
SUL AMERICA SELECTION FIC FIA	34.525.068/0001-06	SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	Renda Variável	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I,"a"	IVBX-2	R$ 35.020.120,38	Indeterminado	D +30	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	11,36%	6,74%	39,35%	-65,31%	19,39%	17,12%
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$ 33.389.980,72	Indeterminado	D+3	Curto Prazo	5	Risco Muito Alto	4,69%	3,31%	16,25%	0,00%	8,70%	9,18%
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$ 74.503.967,31	Indeterminado	D+3	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,13%	5,53%	17,76%	92,05%	9,19%	8,54%
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$ 26.035.582,57	Indeterminado	D+1	Curto Prazo	1	Risco Muito Baixo	0,81%	1,11%	2,80%	33,36%	2,21%	2,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.386.926/0001-71	CAIXA DTVM S/A	Renda Fixa	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I,"b"	IDKA IPCA 2A	R$ 63.540.198,64	Indeterminado	D+0	Curto Prazo	3	Risco Médio	0,80%	1,10%	2,77%	25,29%	2,16%	2,10%
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$ 21.333.917,13	Indeterminado	D +4	Curto Prazo	4	Risco Alto	5,73%	3,76%	19,84%	46,01%	10,50%	8,95%
TOTAL GERAL	**07.749.668/0001-85**	**RECIPREV**	-	-	**IPCA + 6% até 31.12.2019. De 01.01.2020 IPCA+5,00%. De 01.01.2021 IPCA+5,41%. De 01.01.2022 IPCA+4,87%**	**R$ 2.722.140.939,71**	**Risco Ponderado da Carteira**			**2,08**		**1,89%**	**1,11%**	**6,56%**	**-40,99%**	**3,98%**	**3,42%**

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 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;*

********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	2,52	4,01%	3,51%
FEVEREIRO	2,37	3,99%	3,61%
MARÇO	2,25	4,02%	3,79%
ABRIL	2,08	3,99%	3,51%
MAIO	2,08	3,98%	3,42%
JUNHO			
JULHO			
AGOSTO			
SETEMBRO			
OUTUBRO			
NOVEMBRO			
DEZEMBRO			

VOLATILIDADE DA CARTEIRA			
CONCEITOS	TIPO VOLATILIDADE	VALOR	%
Até 1	Volatilidade Muito Baixa	R$ 1.762.468.223,47	64,75%
Acima de 1 até 2	Volatilidade Baixa	R$ 30.240.413,62	1,11%
Acima de 2 até 3	Volatilidade Média	R$ 166.468.935,34	6,12%
Acima de 3 até 4	Volatilidade Alta	R$ 480.548.594,34	17,65%
Acima de 4 até 5	Volatilidade Muito Alta	R$ 282.414.772,94	10,37%
TOTAL		R$ 2.722.140.939,71	100,00%

PRAZOS DA CARTEIRA		
TIPO	VALOR	%
CURTO PRAZO (Até 60 dias)	R$ 798.756.346,64	29,34%
MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)	R$ 310.732.861,61	11,42%
LONGO PRAZO (+ de 5 anos)	R$ 1.612.651.731,45	59,24%
TOTAL	R$ 2.722.140.939,71	100,00%

RATINGS DOS GESTORES DE INVESTIMENTOS		
CONCEITOS		
TIPO	VALOR	%
Muito bom	R$ 104.125.931,06	3,83%
Bom	R$ 19.067.215,47	0,70%
Excelente	R$ 771.983.049,41	28,36%
NTN-B 2045	R$ 1.826.964.743,77	67,11%
TOTAL	R$ 2.722.140.939,71	100,00%

3. RISCO DE FUNDOS ESPECÍFICOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

	AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR		VINCI GAS DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		SOMMA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		BNP PARIBAS ACTION FIC FI AÇÕES	
	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)
JANEIRO	11,05%	10,51%	13,96%	12,81%	8,62%	8,58%	10,27%	10,63%	8,84%	8,91%	11,69%	12,84%	9,10%	10,31%
FEVEREIRO	11,02%	10,63%	13,99%	13,40%	8,72%	8,58%	10,33%	11,41%	8,90%	9,61%	11,63%	12,10%	9,22%	9,47%
MARÇO	11,04%	10,79%	13,98%	13,42%	8,77%	9,89%	10,34%	11,21%	8,91%	9,89%	11,72%	12,66%	9,31%	10,02%
ABRIL	10,98%	10,24%	13,77%	12,94%	8,71%	9,47%	10,29%	10,86%	8,88%	9,67%	11,62%	11,73%	9,22%	9,33%
MAIO	10,93%	9,74%	13,61%	12,46%	8,70%	9,18%	10,28%	10,73%	8,89%	9,49%	11,57%	10,98%	9,20%	8,98%
JUNHO														
JULHO														
AGOSTO														
SETEMBRO														
OUTUBRO														
NOVEMBRO														
DEZEMBRO														

	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO		FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA		BB AÇÕES QUANTITATIVO		BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES MID SMALL CAPS		FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		SUL AMERICA SELECTION FIC FIA	
	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)
JANEIRO	11,27%	12,00%	9,34%	9,76%	10,62%	11,55%	11,50%	13,13%	10,01%	8,46%	9,03%	7,73%	13,20%	12,65%	20,44%	19,19%
FEVEREIRO	11,22%	11,26%	9,16%	8,88%	10,59%	11,20%	11,42%	12,53%	10,01%	8,83%	9,16%	8,88%	13,23%	13,42%	20,21%	18,90%
MARÇO	11,40%	11,98%	9,31%	9,42%	10,71%	11,38%	11,44%	12,39%	10,21%	9,80%	9,31%	9,42%	13,21%	13,16%	20,21%	18,75%
ABRIL	11,25%	10,94%	9,20%	8,81%	10,83%	9,57%	11,39%	12,00%	10,07%	8,80%	9,20%	8,81%	13,18%	12,90%	19,75%	17,77%
MAIO	11,19%	10,19%	9,19%	8,54%	10,81%	9,44%	11,38%	11,79%	10,04%	8,20%	9,19%	8,54%	13,15%	12,68%	19,39%	17,12%
JUNHO																
JULHO																
AGOSTO																
SETEMBRO																
OUTUBRO																
NOVEMBRO																
DEZEMBRO																

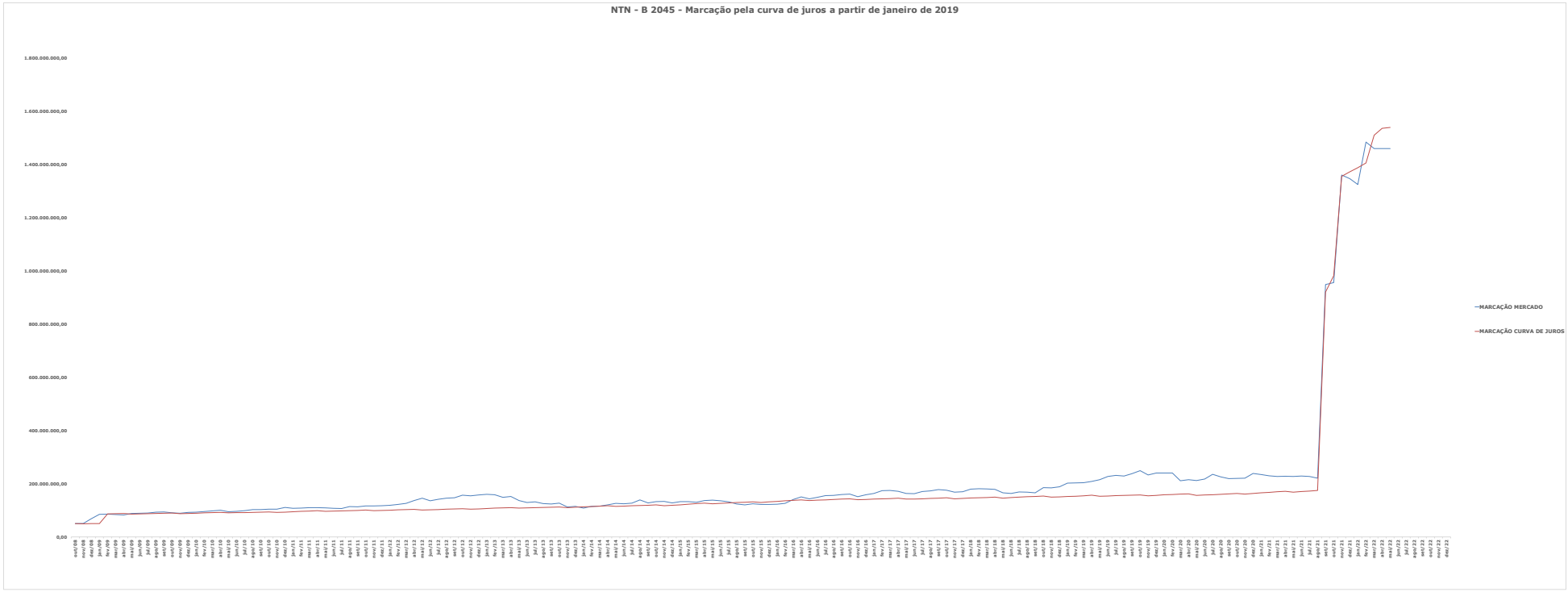
	OCCAM FIC FIA		XP DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	
	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)	VAR HISTÓRICO (95%)	VAR 12 MESES (95%)
JANEIRO				
FEVEREIRO				
MARÇO				
ABRIL				
MAIO	10,26%	7,88%	10,50%	8,95%
JUNHO				
JULHO				
AGOSTO				
SETEMBRO				
OUTUBRO				
NOVEMBRO				
DEZEMBRO				

4. 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+7.002655%;IPCA+6.261127% e IPCA+6.269771%, conforme definido na Política de Investimentos de 2019 e em conformidade com as normas da Secretaria de Previdência (Portaria nº 577, de 27 de dezembro de 2017 e Portaria SPREV nº 4, de 05 de fevereiro de 2018). Como os títulos são de longo prazo e com expectativa de se levar 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.

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.

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



6. RISCOS DE ADMINISTRADOR - GRUPO ECONÔMICO

ADMINISTRADORES DE RECURSOS	GRUPO ECONÔNIMICO DO ADMINISTRADOR DE RECURSOS	GESTORES DE RECURSOS			
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		R$ 204.603.166,11	7,52%
		BRZ INVESTIMENTOS LTDA		R$ 956.840,70	0,04%
		RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA		R$ 2.449.594,13	0,09%
		TOTAL		**R$ 208.009.600,93**	**7,64%**
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		CAIXA DTVM S/A		R$ 182.247.606,22	6,70%
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)		R$ 74.503.967,31	2,74%
		TOTAL		**R$ 256.751.573,53**	**9,43%**
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	Valor na Curva	**R$ 1.538.686.793,85**	**56,52%**
		TESOURO NACIONAL (CUSTÓDIA NO BANCO DO BRASIL)	Valor à Mercado	**R$ 1.458.926.477,39**	**55,21%**
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)		R$ 99.931,98	0,00%
		BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)		R$ 182.631.670,46	6,71%
		TOTAL		**R$ 182.731.602,44**	**6,71%**
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)		R$ 93.644.827,84	3,44%
		CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA		R$ 54.974.281,10	2,02%
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA		R$ 10.064.819,77	0,37%
		SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.		R$ 35.020.120,38	1,29%
		VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)		R$ 33.389.980,72	1,23%
		MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA		R$ 15.606.767,90	0,57%
		AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA		R$ 57.564.555,32	2,11%
		SOMMA INVESTIMENTOS S/A		R$ 36.171.512,68	1,33%
		FINACAP INVESTIMENTOS LTDA		R$ 12.945.956,97	0,48%
		OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA		R$ 30.138.447,24	1,11%
		TOTAL		**R$ 379.521.269,91**	**13,94%**
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)		R$ 38.338.708,31	1,41%
		TOTAL		**R$ 38.338.708,31**	**1,41%**
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.		R$ 35.194.892,68	1,29%
		XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA		R$ 21.333.917,13	0,78%
		TOTAL		**R$ 56.528.809,82**	**2,08%**
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA		R$ 6.199.692,29	0,23%
		TOTAL		**R$ 6.199.692,29**	**0,23%**
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)		R$ 52.570.185,24	1,93%
		TOTAL		**R$ 52.570.185,24**	**1,93%**
		GESTOR		**VALOR**	**% CARTEIRA**
		SINGULARE CTVM S.A.		R$ 2.802.703,41	0,10%
		TOTAL		**R$ 2.802.703,41**	**0,10%**
		TOTAL GERAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RECIPREV	Valor na Curva	**R$ 2.722.140.939,73**	**100,00%**
			Valor à Mercado	**R$ 2.642.380.623,28**	

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

7.1 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 248 2019
	Valor RECEBIDO	R$ 3.858.597,35	
	Valor a RECEBER	-R$ 3.141.402,65	**0,12%** do total da carteira na curva / **0,12%** 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.

7.2 FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÃO (FIP)

Os fundos a seguir possuem risco de liquidez maior por não existir, ainda, mercado secundário forte de Fundos de Participação (FIP) no Brasil. 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 investimentos em empresas de forma geral. Possuem volatilidades decorrentes da liquidez e de mercado, entre outros, e em especial do crescimento econômico do Pais, que podem indicar ou não o crescimento dos negócios e consequentemente das empresas. A partir de 2014, até o momento atual o Brasil vêm passando por momentos difíceis na economia, e por conseguinte, dificultando, também este segmento de investimentos. Apesar de constar como risco de liquidez, também pode fazer parte do risco de contraparte e operacional. O Fundo Cais Maúa foi liquidado em novembro/2020, e zerado o saldo em 01.04.2021, e as cotas transformadas em participação percentual na Empresa Cais Mauá do Brasil na mesma proporção, e devem ser entregue as ações aos acionistas até 30.04.2021. O Fundo Geração Energia apresentou saldo negativo a partir de abril de 2022, está em processo de liquidação, e no momento atual administradora atual (RJI), irá ingressou com uma ação contra o administrador anterior BNY Mellon.

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$	6.199.692,29	
TERRAS BRASIL – FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	19.412.474/0001-79	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R$	956.840,70	
TOTAL				**R$**	**7.156.532,99**	
% CARTEIRA				**% Total Carteira pela curva de juros**	**0,27%**	**% Total Carteira à mercado**

8. 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$ 4.492.047,06

9.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.

10.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.

11. 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%%**
TERRAS BRASIL – FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	Participação % no PL do fundo superior a 5%	**9,94%**

12. 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$ 6.199.692,29	Gestor e Administrador sem Comitê de Auditoria e Comitê de Riscos, obrigados, pelo BACEN
SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	SINGULARE CTVM	SINGULARE CTVM	R$ 2.797.051,50	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$ 5.651,91	Gestor e Administrador sem Comitê de Auditoria e Comitê de Riscos, obrigados, pelo BACEN
TOTAL			**R$ 9.002.395,70**	

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.

13. 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$ 57.564.555,32	2,11%	Máximo permitido 5,00% do volume de gestão ANBIMA	0,35%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R$ 204.603.166,11	7,52%		0,01%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	R$ 35.194.892,68	1,29%		0,49%
BNP Paribas Asset Management Brasil (GRUPO BNP)	R$ 52.570.185,24	1,93%		0,09%
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	R$ 93.744.759,83	3,44%		0,02%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R$ 182.631.670,46	6,71%		0,04%
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R$ 956.840,70	0,04%		0,04%
CAIXA DTVM S/A	R$ 182.247.606,22	6,70%		0,04%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	R$ 54.974.281,10	2,02%		3,51%
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	R$ 12.945.956,97	0,48%		1,86%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R$ 38.338.708,31	1,41%		0,16%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	R$ 15.606.767,90	0,57%		0,17%
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$ 30.138.447,24	1,11%		0,24%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R$ 16.264.512,06	0,60%		2,25%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R$ 2.449.594,13	0,09%		0,03%
SINGULARE CTVM S.A.	R$ 2.802.703,41	0,10%		0,05%
SOMMA INVESTIMENTOS S/A	R$ 36.171.512,68	1,33%		0,74%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	R$ 35.020.120,38	1,29%		0,11%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	R$ 107.893.948,03	3,96%		0,25%
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R$ 21.333.917,13	0,78%		0,02%
TESOURO NACIONAL	R$ 1.538.686.793,85	56,52%		
TOTAL	R$ 2.722.140.939,73	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$ 52.570.185,24	1,93%	Máximo permitido 5,00% do volume de Administração ANBIMA	Máximo permitido de todos os RPPS 50,00% do volume de Administração ANBIMA	0,07%	2,38%
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	R$ 562.252.872,36	20,65%			0,12%	1,91%
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R$ 208.009.600,93	7,64%			0,01%	4,71%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R$ 6.199.692,29	0,23%			0,00%	0,12%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R$ 256.751.573,53	9,43%			0,04%	12,72%
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	R$ 38.338.708,31	1,41%			0,01%	0,00%
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM	R$ 56.528.809,82	2,08%			0,00%	3,03%
SINGULARE CTVM S.A.	R$ 2.802.703,41	0,10%			0,00%	0,00%
TESOURO NACIONAL	R$ 1.538.686.793,85	56,52%				
R$ -	R$ 2.722.140.939,73	100,00%				

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	19/08/2021	19/08/2022	0	
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	30.822.936/0001-69	31/08/2021	31/08/2022	0	
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	07.237.373/0001-20	14/04/2022	14/04/2023	0	
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL (GRUPO BNP)	02.562.663/0001-25	31/08/2021	31/08/2022	0	
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	62.375.134/0001-44	06/09/2021	06/09/2022	0	
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	60.746.948/0001-12	06/09/2021	06/09/2022	0	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	02.888.152/0001-06	26/08/2021	26/08/2022	0	
CAIXA DTVM S/A	42.040.639/0001-40	13/12/2021	13/12/2022	0	
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	10.626.543/0001-72	12/08/2021	12/08/2022	0	
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	60.701.190/0001-04	30/06/2021	30/06/2022	0	
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	16.500.294/0001-50	27/08/2021	27/08/2022	0	COBRAR DOCUMENTOS PARA ATUALIZAÇÃO DO CREDENCIAMENTO
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	11.628.883/0001.03	11/04/2022	11/04/2023	0	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	07.250.864/0001-00	18/08/2021	18/08/2022	0	
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	03.864.607/0001-08	27/08/2021	27/08/2022	0	
SINGULARE CTVM S.A.	62.285.390/0001-40	25/08/2021	25/08/2022	0	
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	21.813.291/0001-07	23/08/2021	23/08/2022	0	
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	10.917.835/0001-64	18/08/2021	18/08/2022	0	
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	37.918.829/0001-88	23/03/2022	23/03/2023	0	
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA (GRUPO XP)	07.625.200/0001-89	20/08/2021	20/08/2022	0	

ADMINISTRADOR DE INVESTIMENTOS	CNPJ	DATA CREDENCIAMENTO	DATA RENOVAÇÃO	OBSERVAÇÃO	AÇÃO
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (GRUPO BNP)	01.522.368/0001-82	21/03/2022	21/03/2023	0	
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	60.746.948/0001-12	06/09/2021	06/09/2022	0	
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	30.822.936/0001-69	31/08/2021	31/08/2022	0	
BEM - DTVM LTDA (GRUPO BRADESCO)	00.066.670/0001-00	06/09/2021	06/09/2022	0	
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	02.201.501/0001-61	13/09/2021	13/09/2022	0	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	00.360.305/0001-04	16/08/2021	16/08/2022	0	
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	60.701.190/0001-04	30/06/2021	30/06/2022	0	COBRAR DOCUMENTOS PARA
SANTANDER CACEIS BRASIL DTVM	62.318.407/0001-19	14/04/2022	14/04/2023	0	
SINGULARE CTVM S.A.	62.285.390/0001-40	25/08/2021	25/08/2022	0	

DISTRIBUIDOR	CNPJ	DATA CREDENCIAMENTO	DATA RENOVAÇÃO	OBSERVAÇÃO	AÇÃO
BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)	00.000.000/0001-91	19/08/2021	19/08/2022	0	
GRID AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTO LTDA	17.203.539/0001-40	25/03/2022	25/03/2023	0	
MAGNA – AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA	13.426.885/0001-37	07/10/2020	18/08/2022	0	
PERFORME AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS EIRELI	10.819.611/0001-10	18/08/2021	18/08/2022	0	
PRIVATIZA AGENTES AUTÔNOMOS DE INVESTIMENTOS LTDA	00.840.515/0001-08	19/08/2021	19/08/2022	0	
SINGULARE CTVM S.A.	62.285.390/0001-40	25/08/2021	25/08/2022	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	28/09/2021	28/09/2022	Excelente		R$ 57.564.555,32
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	Fitch Ratings	Excelente	20/08/2021	20/08/2022	Excelente		R$ 204.603.166,11
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	Moody's	AA.br	28/07/2021	28/07/2022	Alta qualidade		R$ 35.194.892,68
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL (GRUPO BNP)	Fitch Ratings	Excelente	06/01/2022	06/01/2023	Excelente		R$ 52.570.185,23
BRAM - DTVM (GRUPO BRADESCO)	Standard&Poor's	AMP-1	13/10/2021	13/10/2022	Excelente		R$ 93.744.759,83
BANCO BRADESCO S.A. (GRUPO BRADESCO)	Standard&Poor's	brAAA	12/11/2021	12/11/2022	Capacidade extremamente forte para cumprir os compromissos financeiros		R$ -
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	Austing Rating	QG 2	23/04/2021	31/03/2022	Muito bom	COBRAR NOVO RATING	R$ -
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	Moody's	MQ2	29/06/2021	29/06/2022	Muito bom	COBRAR NOVO RATING	R$ 956.840,70
CAIXA DTVM S/A	Fitch Ratings	Excelente	08/12/2021	12/08/2022	Excelente		R$ 182.247.606,22
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA	Austing Rating	QG 2-	02/09/2021	31/08/2022	Muito bom		R$ 54.974.281,10
ITAU UNIBANCO (GRUPO ITAÚ)	Fitch Ratings	Excelente	26/10/2021	26/10/2022	Excelente		R$ 38.338.708,31
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	Moody's	MQ2	04/01/2022	04/01/2023	Muito bom		R$ 15.606.767,89
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	Standard&Poor's	Forte	22/07/2021	22/07/2022	Muito bom		R$ 30.138.447,24
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	Austing Rating	QG 3+	03/03/2022	00/01/1900	Bom		R$ 16.264.512,06
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	Standard&Poor's	AMP-2	30/11/2021	30/11/2022	Muito bom		R$ 2.449.594,13
SINGULARE CTVM S.A.	Austing Rating	QG 3	20/10/2020	31/10/2021	Bom	COBRAR NOVO RATING	R$ 2.802.703,41
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	Standard&Poor's	AMP-1	13/08/2021	13/08/2022	Excelente		R$ 35.020.120,38
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA (GRUPO VINCI PARTNERS)	Moody's	MQ1	29/06/2021	19/06/2023	Excelente		R$ 107.893.948,03
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	Moody's	MQ1	29/06/2021	29/06/2022	Excelente	COBRAR NOVO RATING	R$ -
							R$ 930.371.088,62

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 3.922/2010, 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

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos

Marco Aurtélio Correia Pinheiro
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.

Manoel Carneiro Soares Cardoso
Diretor Presidente

Francisco Canindé Antunes Furtado Junior
Diretor Vice-Presidente

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos

Marco Aurtélio Correia Pinheiro
Chefe de Divisão de Investimentos

Gustavo Lins Dourado
Equipe Investimentos

Rebeca de Souza Alves
Chefe da Área de Controles Internos

Originais assinados e arquivados na Reciprev

Recife (PE), 10 de junho de 2022

ASSINATURAS