

RELATÓRIO DA CARTEIRA PASSIRAPREV 10-2018

MERCADO FINANCEIRO

Juros - As taxas de juros domésticas recuaram substancialmente ao longo de toda curva durante o mês de outubro. No exterior, a maior aversão ao risco fez com que os mercados globais operassem majoritariamente em queda e o dólar se valorizasse ante às demais moedas internacionais. Ativos emergentes, em especial, foram bastante prejudicados no período, o que colaborou para limitar um fechamento adicional da curva doméstica. Internamente, a expectativa de um resultado eleitoral favorável ao mercado, contribuindo para uma importante redução do prêmio de risco Brasil, e o real valorizando-se ante o dólar, impulsionaram o fechamento da curva no mês de outubro, sobretudo na parte média-longa. Por sua vez, os contratos de curto prazo continuaram a receber suporte da manutenção da Selic em patamar historicamente baixo e dos dados de inflação doméstica bastante contidos.

Câmbio - O real encerrou o mês de outubro com importante valorização de 7,15% ante o dólar, a R\$ 3,72. No ano a moeda doméstica exhibe desvalorização de 12,39%. Já no acumulado em 12 meses, as perdas são de 13,45%. No exterior, o dólar apresentou ganho ante às demais moedas. O ambiente de maior aversão ao risco, motivado por preocupações quanto a uma possível aceleração da alta dos juros nos EUA, temores de desaceleração do crescimento econômico em algumas regiões e em relação à questão fiscal italiana, afetaram negativamente os principais mercados internacionais. Por outro lado, a agenda macroeconômica se manteve majoritariamente satisfatória, sobretudo nos EUA, e o suporte advindo da manutenção do gradualismo das políticas monetárias pelos principais bancos centrais ajudaram a reduzir o impacto desse aumento na aversão ao risco. Nesse ambiente, a moeda americana apresentou ganhos globais – o índice DXY, encerrou o mês com alta de 2,10%. Já ante uma cesta de moedas emergentes, o dólar mostrou valorização de 1,83%. Internamente, as perspectivas favoráveis em relação ao resultado eleitoral, em que o candidato Jair Bolsonaro venceu o pleito, a melhora da agenda econômica e a forte redução no prêmio de risco compensaram a influência negativa advinda do exterior

CENÁRIOS E PROJEÇÕES

RESUMO	2016	2017	2018
JUROS NOMINAIS ACUMULADO (SELIC)	14,12%	9,86%	6,52%
JUROS NOMINAIS ACUMULADO (CDI)	14,02%	9,89%	6,50%
INFLAÇÃO a.a. (IGP-M)	7,19%	-0,53%	9,82%
INFLAÇÃO a.a. (IPCA)	6,29%	2,95%	4,22%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IGP-M)	6,47%	10,45%	-3,00%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IPCA)	7,37%	6,71%	2,21%
CÂMBIO (US\$ variação anual)	-16,47%	1,42%	7,54%

Instituto de Previdência do Município de Passira

Rua Maria Pereira da Silva, 87 – Centro – Passira/PE – CEP.: 55650-000

INVESTIMENTOS DO RPPS

CNPJ: 11328882/000135

Nome Fundo de Investimento: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS

Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b Segmento: Renda Fixa

Instituição: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM - CNPJ: 30.822.936/0001-69

Cotista: RPPS, EFPCs, FI e FICFI exclusivos das EFPC

Objetivos do Fundo: Aplicação em cotas de FIs que detenham 100% de Tít. Púb. Fed. em suas carteiras e tenham como parâmetro de rentabilidade o sub-índice IRFM-1.

Despesas: Tx. admin. do FIC 0,10% a.a. Os FIs investidos poderão cobrar tx. admin. de até 0,20%a.a. Não há tx. de performance, de ingresso ou de saída

Código Mnemônico: 0962509F063

Início do Fundo: 08/12/2009

Código/Tipo ANBIMA: 239003 - Renda Fixa Indexados

Tributação: Conforme Legislação Fiscal Vigente

Cota de Aplicação: D + 0

Cota de Resgate: D + 0

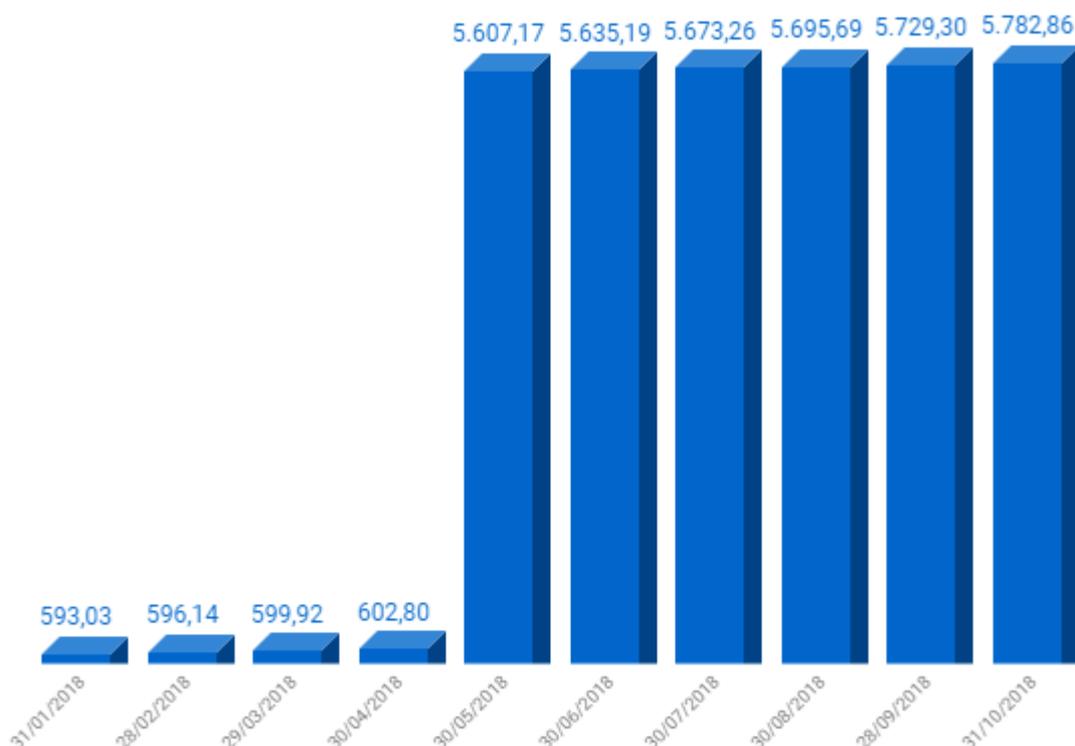
Crédito do Resgate: D + 0

Tipo de Quota: Fechamento

Gestor Responsável: Marise Freitas

Auditoria Externa: KPMG Auditores Investimentos

INVESTIMENTOS



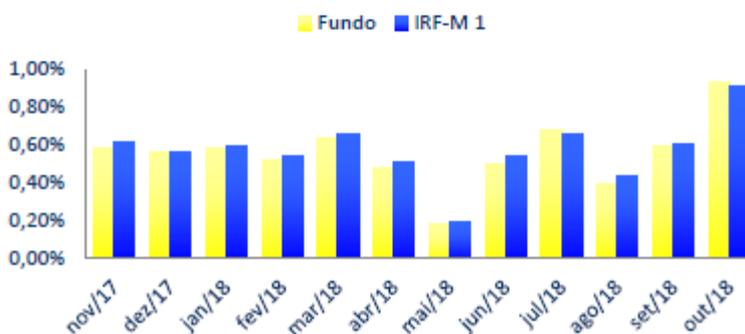
Instituto de Previdência do Município de Passira

Rua Maria Pereira da Silva, 87 – Centro – Passira/PE – CEP.: 55650-000

Informações Gerais Fundo BB Previdenciário RF-M1 TP em 31/10/2018

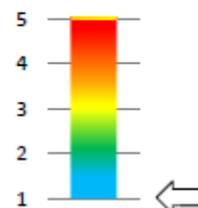
RENTABILIDADE				
A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS				
Ano	Taxa Nominal	IRF-M 1	Acumulada	
			5 anos	
2013	7,11%	7,44%	Fundo	IRF-M 1
2014	10,22%	10,58%	68,69%	71,15%
2015	12,58%	13,01%	2018	
2016	14,48%	14,72%	Fundo	IRF-M 1
2017	10,86%	11,12%	5,64%	5,81%

Mês	Fundo	IRF-M 1
out/18	0,93%	0,92%
set/18	0,59%	0,61%
ago/18	0,40%	0,44%
jul/18	0,68%	0,66%
jun/18	0,50%	0,55%
mai/18	0,18%	0,20%
abr/18	0,48%	0,51%
mar/18	0,63%	0,66%
fev/18	0,52%	0,54%
jan/18	0,59%	0,59%
dez/17	0,56%	0,57%
nov/17	0,59%	0,62%
últimos 12 meses	6,85%	7,06%



DADOS DE FECHAMENTO DO MÊS

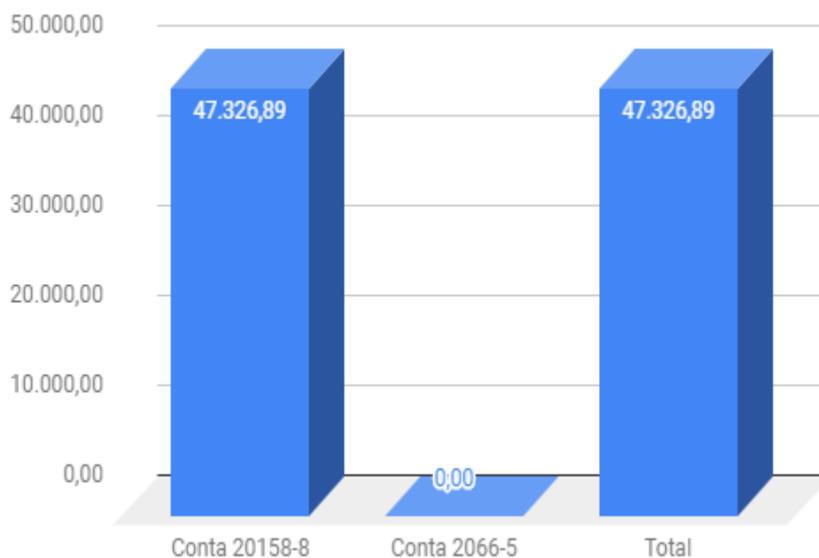
Cota Fech.	Qtd. Cotas	PL Médio 12 m	PL Fechamento
2,447290873	5265365232,82	R\$ 12.116.886.165,12	R\$ 12.885.880.277,28
V@R (95% de confiança)(¹)		0,0598%	
Volatilidade no ano(²)		0,60%	
Volatilidade nos últimos 12 m(²)		0,55%	
% de retornos positivos no ano		88,57%	
% de retornos positivos nos últimos 12 m		90,48%	
Índice de Sharpe nos últimos 12 m(³)		0,54	



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

POSIÇÃO EM 31.10.2018

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS



RESUMO DA CARTEIRA

Carteira PASSIRAPREV 10-2018



Instituto de Previdência do Município de Passira

Rua Maria Pereira da Silva, 87 – Centro – Passira/PE – CEP.: 55650-000

relatorio 10-2018.pdf

Código do documento f8c70be2-dd09-4dbf-b2f8-90fb847bb791

Assinaturas



Daniela Cristina da Silva
danycrsilva.dcs@gmail.com
Assinou

Daniela Cristina da Silva

Eventos do documento

16 Nov 2018, 12:49:09

Documento número f8c70be2-dd09-4dbf-b2f8-90fb847bb791 **criado** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email :danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE_ATOM: 2018-11-16T12:49:09-02:00

16 Nov 2018, 12:49:29

Lista de assinatura **iniciada** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email: danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE_ATOM: 2018-11-16T12:49:29-02:00

16 Nov 2018, 12:49:36

DANIELA CRISTINA DA SILVA **Assinou** (Conta e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38) - Email: danycrsilva.dcs@gmail.com - IP: 177.181.162.215 (b1b5a2d7.virtua.com.br porta: 48990) - **Geolocalização:** -7.9734561 -34.837322 - Documento de identificação informado: 696.585.951-20 - DATE_ATOM: 2018-11-16T12:49:36-02:00

Hash do documento original

(SHA256):0e24b425aaf2974864d943d414c064e2c24edac0fa6615fc06696edfd1990840

(SHA512):7ad8caf33928cf36ac0fe1d8826544182a39945f922ace943e2bce4ccf40cfad3640bea0797f7fafc83d5dc1fb48f73074cb6e757b801e102965b704a4c4fe4c

Esse log pertence **única e exclusivamente** aos documentos de HASH acima

Esse documento está assinado e certificado pela D4Sign