

RELATÓRIO DA CARTEIRA PASSIRAPREV 12-2018

MERCADO FINANCEIRO

Juros: As taxas de juros domésticas apresentaram forte queda ao longo de toda curva durante o mês de dezembro. No exterior, a maior aversão ao risco causada por preocupações com o crescimento global e uma possível recessão nos EUA colaborou para o movimento. Internamente, a combinação de um quadro de surpresa deflacionária e atividade melhorando de forma gradual, mas ainda aquém do esperado, favoreceu a expectativa de Selic estável ao longo de 2019 e, por consequência, o fechamento das taxas. Ademais, a expectativa de que o novo governo realize algumas reformas importantes para a economia, sobretudo, a da previdência, melhorando a questão fiscal, também contribuiu para a redução dos prêmios na parte mais longa da curva.

Câmbio: O real encerrou o mês de dezembro com desvalorização de 0,2% ante o dólar, a R\$ 3,875. No ano, a moeda doméstica exibe depreciação de 17,1%. No exterior, o dólar apresentou perdas ante as principais moedas. O aumento dos receios em torno do risco de recessão nos EUA conduziu a moeda americana a perdas ante as divisas dos países desenvolvidos. Por outro lado, dados piores que o esperado na Europa e na China, levaram a um aumento da aversão ao risco e compensaram as perdas do dólar nestas regiões. Nesse ambiente, o índice DXY, que mede o comportamento do dólar ante as principais divisas internacionais, encerrou o mês praticamente estável (+0,11%). Ademais, perante uma cesta de moedas emergentes, o dólar mostrou discreta valorização de 0,13%. Internamente, a melhora das perspectivas quanto à atividade e de alguma redução nas incertezas políticas, além da percepção de que a moeda doméstica já se encontra em nível considerado desvalorizado, colaboraram para a estabilidade do real ante o dólar.

CENÁRIOS E PROJEÇÕES

RESUMO	2016	2017	2018
JUROS NOMINAIS ACUMULADO (SELIC)	14,12%	9,86%	6,48%
JUROS NOMINAIS ACUMULADO (CDI)	14,02%	9,89%	6,46%
INFLAÇÃO a.a. (IGP-M)	7,19%	-0,53%	8,18%
INFLAÇÃO a.a. (IPCA)	6,29%	2,95%	3,72%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IGP-M)	6,47%	10,45%	-1,58%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IPCA)	7,37%	6,71%	2,65%
CÂMBIO (US\$ variação anual)	-16,47%	1,42%	16,76%

Instituto de Previdência do Município de Passira
Rua Maria Pereira da Silva, 87 – Centro – Passira/PE – CEP.: 55650-000
CNPJ: 09.032.346/0001-46 – Fone: (81) 3651 1476

INVESTIMENTOS DO RPPS

CNPJ: 11.328.882/0001-35

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

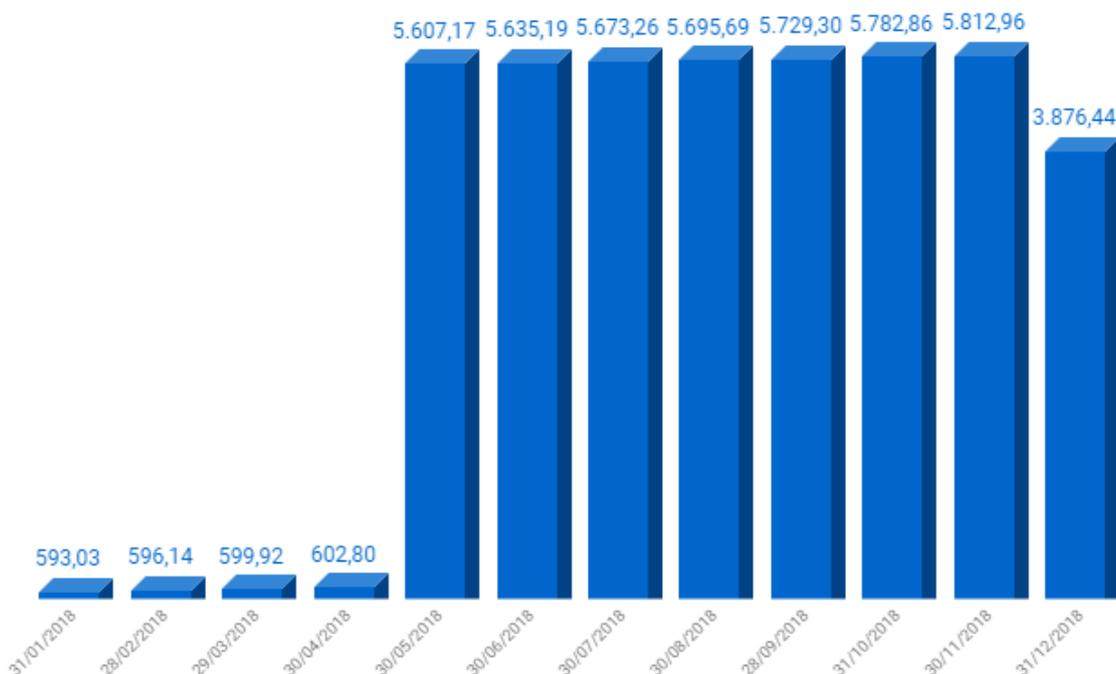
Crédito do Resgate: D + 0

Tipo de Quota: Fechamento

Gestor Responsável: Marise Freitas

Auditoria Externa: KPMG Auditores Investimentos

EVOLUÇÃO INVESTIMENTOS

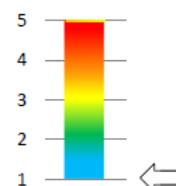


Instituto de Previdência do Município de Passira
Rua Maria Pereira da Silva, 87 – Centro – Passira/PE – CEP.: 55650-000
CNPJ: 09.032.346/0001-46 – Fone: (81) 3651 1476

Informações Gerais Fundo BB Previdenciário RF-M1 TP em 31/12/2018

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%	6,76%	6,97%
Mês	Fundo		IRF-M 1	
dez/18	0,54%		0,56%	
nov/18	0,52%		0,54%	
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%	
últimos				

DADOS DE FECHAMENTO DO MÊS			
Cota Fech.	Qtd. Cotas	PL Médio 12 m	PL Fechamento
2,473215152	4865181321,37	R\$ 12.181.296.326,12	R\$ 12.032.640.161,24
V@R (95% de confiança)(¹)		0,0578%	
Volatilidade no ano(²)		0,55%	
Volatilidade nos últimos 12 m(²)		0,55%	
% de retornos positivos no ano		90,40%	
% de retornos positivos nos últimos 12 m		90,48%	
Índice de Sharpe nos últimos 12 m(²)		0,58	



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA
POSIÇÃO EM 31.12.2018

Instituto de Previdência do Município de Passira
Rua Maria Pereira da Silva, 87 – Centro – Passira/PE – CEP.: 55650-000
CNPJ: 09.032.346/0001-46 – Fone: (81) 3651 1476

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS



RESUMO DA CARTEIRA



Instituto de Previdência do Município de Passira
Rua Maria Pereira da Silva, 87 – Centro – Passira/PE – CEP.: 55650-000
CNPJ: 09.032.346/0001-46 – Fone: (81) 3651 1476

relatorio 12-2018.pdf

Código do documento b087ab78-4ffc-451d-9a94-d3993767c919

Assinaturas



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

Daniela Cristina da Silva

Eventos do documento

18 Jan 2019, 17:45:16

Documento número b087ab78-4ffc-451d-9a94-d3993767c919 **criado** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email :danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE_ATOM: 2019-01-18T17:45:16-02:00

18 Jan 2019, 17:45:38

Lista de assinatura **iniciada** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email: danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE_ATOM: 2019-01-18T17:45:38-02:00

18 Jan 2019, 17:45:44

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: 43828) - **Geolocalização:** [-7.973490299999999 -34.8373294](#) - Documento de identificação informado: 696.585.951-20 - DATE_ATOM: 2019-01-18T17:45:44-02:00

Hash do documento original

(SHA256):7fcef133eb173798c48262be9c6f55ef81449226bd7a4ee2ad7e2c76a11145d8

(SHA512):67178edfc1fa6ec2e8572a005c584f90893b526f1f61826214d6c1fa67c54b0ad6c7d996bdb6362398939d3dea7ef5be9f1970ff698602a72e29d3ffe65d12ad

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

Esse documento está assinado e certificado pela D4Sign