

RELATÓRIO DA CARTEIRA PASSIRAPREV 08-2018

MERCADO FINANCEIRO

Juros - As taxas de juros domésticas subiram em todos os vértices da curva. O movimento recebeu suporte do ambiente de maior cautela no exterior, sobretudo em relação aos países emergentes, após um expressivo aumento dos temores em torno da Turquia e Argentina. Além disso, os riscos fiscais na Itália, a guerra comercial entre os EUA e a China e o enfraquecimento da agenda de atividade do país asiático colaboraram para o movimento de maior aversão aos ativos de maior risco. Apesar disso, a atividade econômica internacional e a política monetária flexível por parte dos principais bancos centrais continuam a atuar a favor dos mercados. Internamente, o aumento das incertezas eleitorais, juntamente com o ambiente mais adverso no exterior, colaborou para a alta do prêmio de risco país, o que contribuiu para a abertura da curva de juros em todos os seus segmentos no mês de agosto.

Câmbio - O real encerrou o mês de agosto com desvalorização de 10,13% ante o dólar, a R\$ 4,14, no maior nível nominal ao término de um mês desde o início do Plano Real. No ano, a moeda doméstica exibe desvalorização de 25,01%. Já no acumulado em 12 meses, as perdas são de 31,40%. No exterior, o dólar apresentou ganho ante a maior parte das moedas. O noticiário político e econômico mais desafiador em torno de países emergentes como a Turquia e a Argentina, bem como as questões fiscais na Itália, num quadro de manutenção das disputas comerciais entre EUA e China e enfraquecimento da atividade econômica chinesa, foi pano de fundo para o aumento da cautela. Por outro lado, a agenda de atividade econômica nos países desenvolvidos se manteve positiva, sobretudo nos EUA, ao mesmo tempo em que os dados de inflação permanecem bastante favoráveis nessas economias – o que têm levado os principais bancos centrais a manterem suas políticas monetárias bastante flexíveis e o FED a sustentar o gradualismo no processo de alta dos juros nos EUA. Internamente, a expressiva alta do prêmio de risco país juntamente com o aumento das incertezas e temores quanto às eleições domésticas prejudicaram o desempenho do real.

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% | 6,45% |
| INFLAÇÃO a.a. (IGP-M) | 7,19% | -0,53% | 10,01% |
| INFLAÇÃO a.a. (IPCA) | 6,29% | 2,95% | 4,32% |
| JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IGP-M) | 6,47% | 10,45% | -3,17% |
| JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IPCA) | 7,37% | 6,71% | 2,11% |
| CÂMBIO (US\$ variação anual) | -16,47% | 1,42% | 17,03% |

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

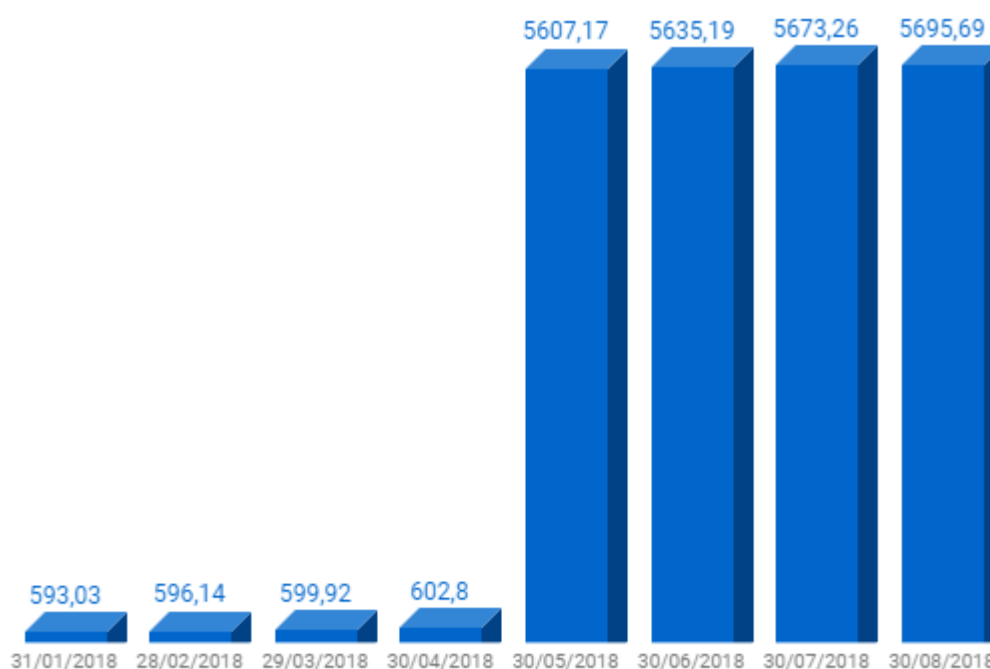
Crédito do Resgate: D + 0

Tipo de Quota: Fechamento

Gestor Responsável: Marise Freitas

Auditoria Externa: KPMG Auditores Investimentos

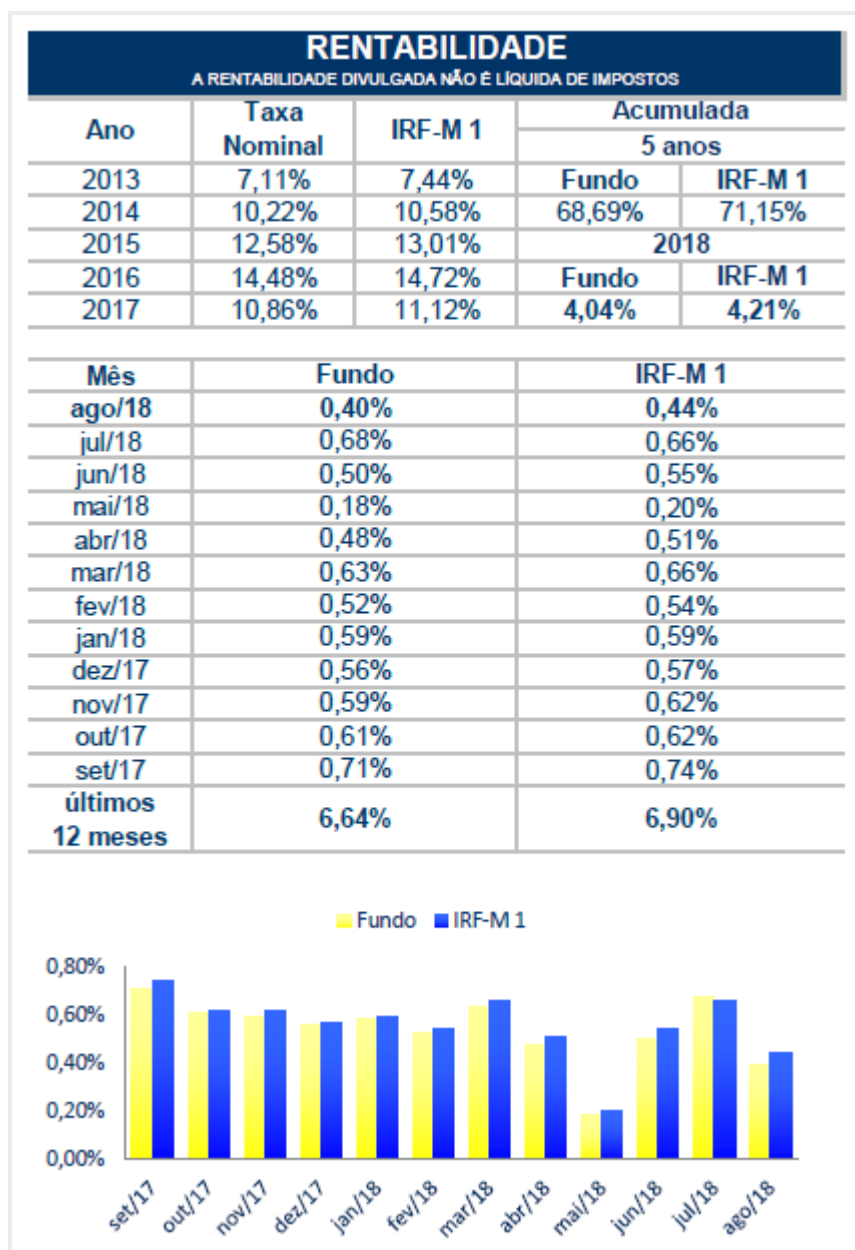
INVESTIMENTOS



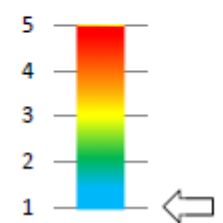
Instituto de Previdência do Município de Passira

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

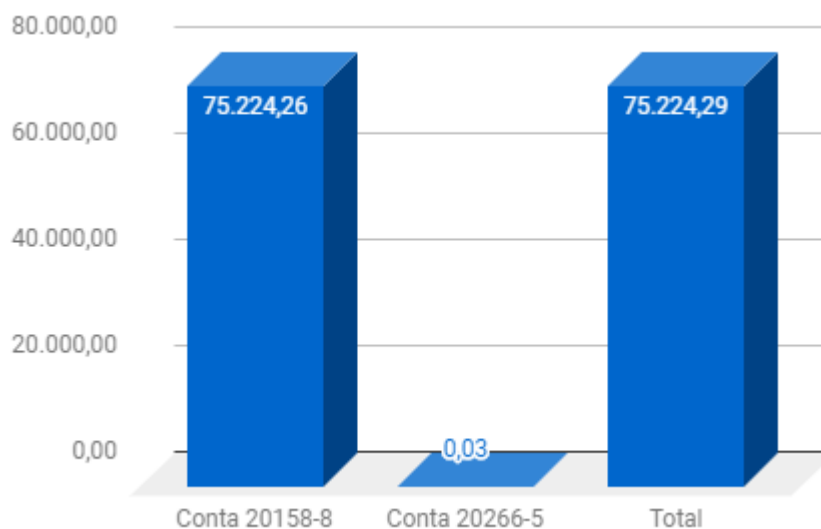
Informações Gerais Fundo BB Previdenciário RF-M1 TP em 31/08/2018



DADOS DE FECHAMENTO DO MÊS

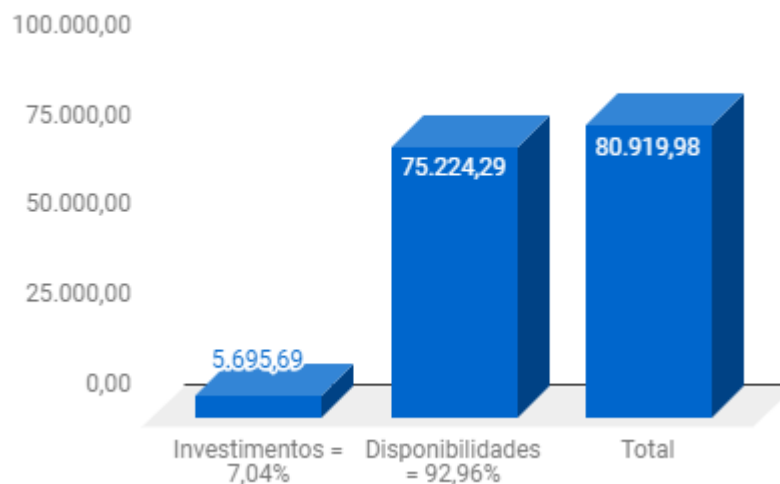
| Cota Fech. | Qtd. Cotas | PL Médio 12 m | PL Fechamento |
|--|---------------|-----------------------|---|
| 2,410399406 | 5362172924,24 | R\$ 11.828.741.938,14 | R\$ 12.924.978.431,45 |
| V@R (95% de confiança)(¹) | | 0,0406% |  |
| Volatilidade no ano(²) | | 0,62% | |
| Volatilidade nos últimos 12 m(²) | | 0,52% | |
| % de retornos positivos no ano | | 86,98% | |
| % de retornos positivos nos últimos 12 m | | 90,87% | |
| Índice de Sharpe nos últimos 12 m(³) | | - | |

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS



RESUMO DA CARTEIRA

Carteira PASSIRAPREV 08-2018



Instituto de Previdência do Município de Passira

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

relatorio 08-2018.pdf

Código do documento 2c161758-1c2e-4db0-886a-01a27247feb9

Assinaturas



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

Daniela Cristina da Silva

Eventos do documento

13 Sep 2018, 16:18:08

Documento número 2c161758-1c2e-4db0-886a-01a27247feb9 **criado** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta #e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email :danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE_ATOM: 2018-09-13T16:18:08-03:00

13 Sep 2018, 16:18:27

Lista de assinatura **iniciada** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta #e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email: danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE_ATOM: 2018-09-13T16:18:27-03:00

13 Sep 2018, 16:18:36

DANIELA CRISTINA DA SILVA **Assinou** (Conta #e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38) - Email: danycrsilva.dcs@gmail.com - IP: 186.223.145.125 (badf917d.virtua.com.br porta: 42204) - **Geolocalização:** [-7.973484899999999 -34.837305900000004](#) - Documento de identificação informado: 696.585.951-20 - DATE_ATOM: 2018-09-13T16:18:36-03:00

Hash do documento original

(SHA256):6d4f86a8f7988b31113883bcc7bb0181675780445be1479a7a2a9b52e033d12a

(SHA512):0a7de46207c118c35ce738e5ee8fcfba5a705a5c0ff0cb6e1b5429385ec5c80ce6494b4526af216931ee1fb0b92879c9f98d402536179bd3996aaa76c5bbacd7

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

Esse documento está assinado e certificado pela D4Sign