

## RELATÓRIO DA CARTEIRA PASSIRAPREV 09-2018

### MERCADO FINANCEIRO

Juros- As taxas de juros domésticas apresentaram ligeiro recuo ao longo de toda a curva em setembro. O movimento recebeu suporte do exterior, onde a aversão ao risco se manteve em patamar baixo. Além disso, a agenda macroeconômica e as decisões dos principais bancos centrais continuaram a se mostrar favoráveis aos ativos de risco. Apesar disso, o quadro fiscal na Itália e o anúncio de novas medidas protecionistas, em mais um episódio da guerra comercial entre EUA e China, contribuíram para limitar o movimento dos ativos no exterior. Internamente, apesar das incertezas eleitorais, a decisão de manutenção da Selic em patamar historicamente baixo por parte do Bacen, o quadro de gradual estabilização da agenda econômica e a queda do prêmio de risco país foram favoráveis ao recuo das taxas de juros futuros.

Câmbio - O real encerrou o mês de setembro com valorização de 3,18% ante o dólar, a R\$ 4,00, após encerrar agosto no maior nível nominal ao término de um mês desde o início do Plano Real (R\$ 4,14). No ano, a moeda doméstica exibe desvalorização de 21,04%. Já no acumulado em 12 meses, as perdas são de 26,39%. No exterior, o dólar apresentou desempenho misto ante às demais moedas. O cenário econômico benigno colaborou para a estabilidade da moeda americana frente às principais divisas internacionais. Apesar disso, o anúncio de novas medidas protecionistas pelos EUA e China e a maior preocupação com a questão fiscal na Itália atuaram reduzindo o apetite por risco. Ante os emergentes, a cautela continuou prevalecendo. O dólar subiu 2,79% ante uma cesta de moedas emergentes em setembro, apesar da elevação dos juros na Turquia e da redução dos temores quanto à questão fiscal na Argentina terem atuado a favor dos mercados. Internamente, a melhora da agenda econômica, a redução no prêmio de risco e o aparente ajuste dos preços dos ativos ajudaram a compensar a maior incerteza quanto ao resultado das eleições em outubro.

### 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%	10,04%
INFLAÇÃO a.a. (IPCA)	6,29%	2,95%	4,33%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IGP-M)	6,47%	10,45%	-3,20%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IPCA)	7,37%	6,71%	2,10%
CÂMBIO (US\$ variação anual)	-16,47%	1,42%	16,61%

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

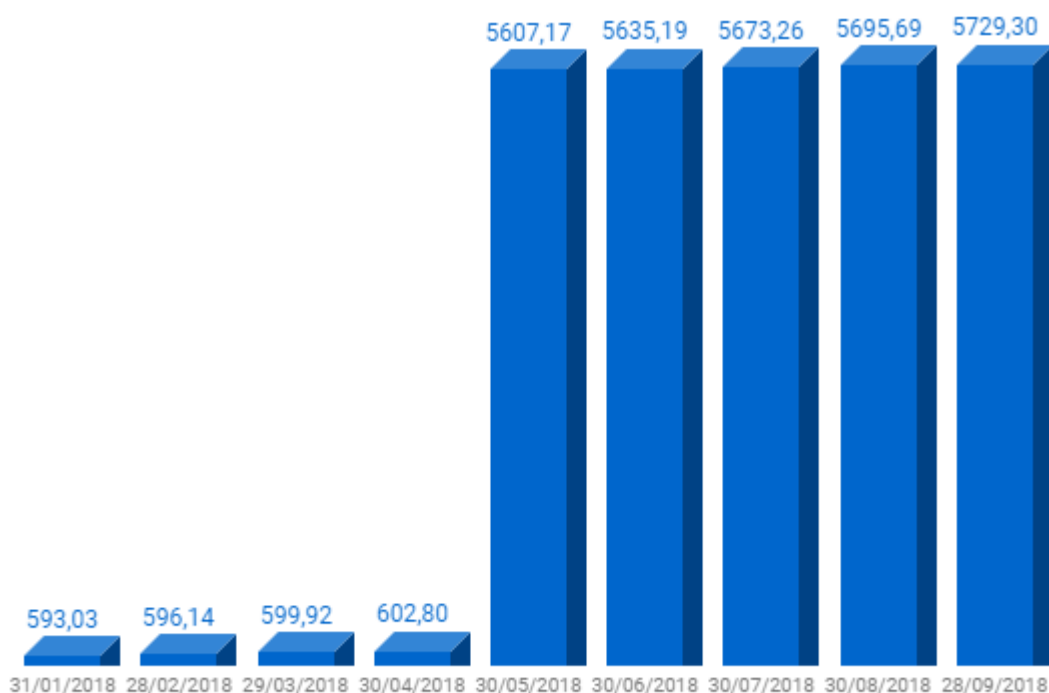
Crédito do Resgate: D + 0

Tipo de Quota: Fechamento

Gestor Responsável: Marise Freitas

Auditoria Externa: KPMG Auditores Investimentos

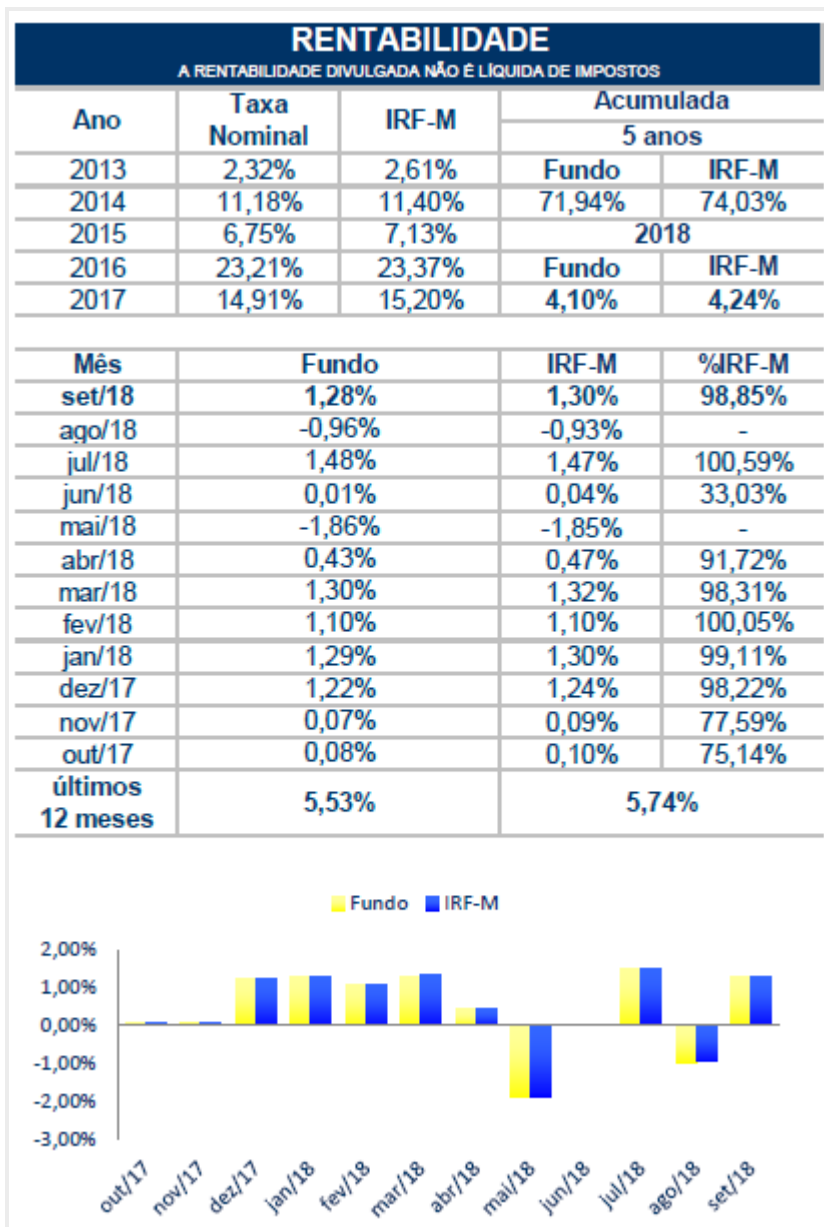
## INVESTIMENTOS



**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 28/09/2018

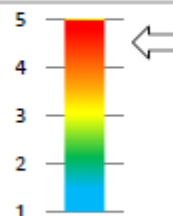


**Instituto de Previdência do Município de Passira**

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

### DADOS DE FECHAMENTO DO MÊS

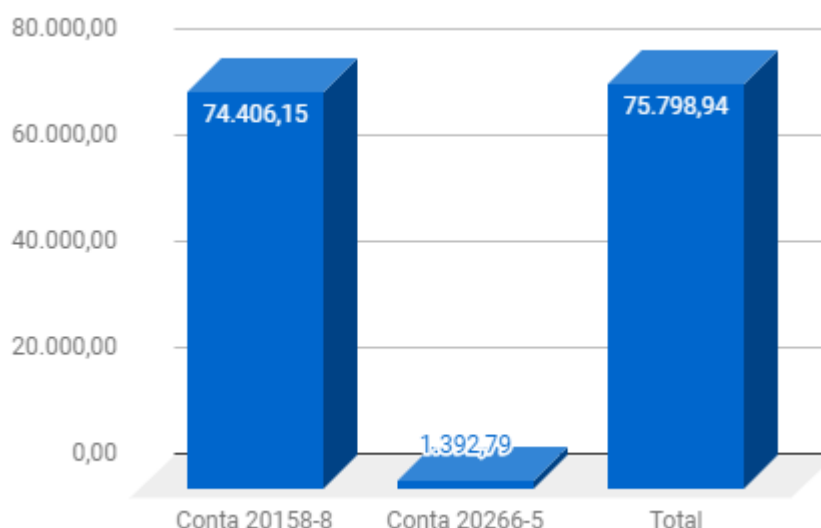
Cota Fech.	Qtd. Cotas	PL Médio 12 m	PL Fechamento
4,868194680	1007351764,97	R\$ 5.200.640.861,05	R\$ 4.903.984.503,12
V@R (95% de confiança)( <sup>1</sup> )		0,3343%	
Volatilidade no ano( <sup>2</sup> )		3,38%	
Volatilidade nos últimos 12 m( <sup>2</sup> )		3,13%	
% de retornos positivos no ano		56,38%	
% de retornos positivos nos últimos 12 m		57,94%	
Índice de Sharpe nos últimos 12 m( <sup>3</sup> )		-	



### COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

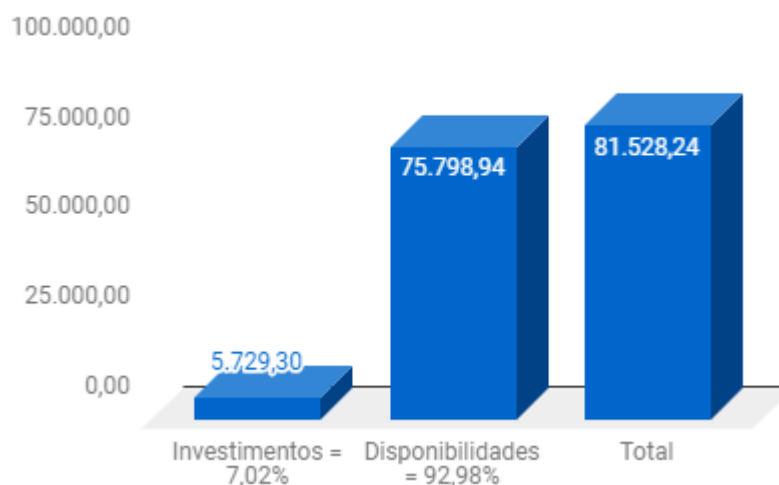
POSIÇÃO EM 28.09.2018

### DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS



### RESUMO DA CARTEIRA

Carteira PASSIRAPREV 09-2018



Instituto de Previdência do Município de Passira

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



## relatorio 09-2018.pdf

Código do documento c31b2d44-e63f-415a-b6ea-a07d9a5c21c1

### Assinaturas



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

*Daniela Cristina da Silva*

### Eventos do documento

#### 25 Oct 2018, 09:38:10

Documento número c31b2d44-e63f-415a-b6ea-a07d9a5c21c1 **criado** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email :danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE\_ATOM: 2018-10-25T09:38:10-02:00

#### 25 Oct 2018, 09:38:44

Lista de assinatura **iniciada** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email: danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE\_ATOM: 2018-10-25T09:38:44-02:00

#### 25 Oct 2018, 09:38:59

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: 40270) - **Geolocalização: -7.97350659999999 -34.8372939** - Documento de identificação informado: 696.585.951-20 - DATE\_ATOM: 2018-10-25T09:38:59-02:00

#### Hash do documento original

(SHA256):a7f9ce089cadf460d9e2a9840bb05086e5247f03f7483cd48ce3a6766964d760

(SHA512):289f0b42f006ca896bece16c9647c1d0aae1ab8316acd88990508f4295f6d59ff47620eb291dff9c3e519f97ba99e46554efc3d63e0ac1d751dfe79e41ca7279

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

**Esse documento está assinado e certificado pela D4Sign**