

RELATÓRIO DA CARTEIRA PASSIRAPREV 01-2018

MERCADO FINANCEIRO

Juros - As taxas de juros domésticas apresentaram queda ao longo de toda a curva pelo segundo mês consecutivo. O desempenho dos contratos de curto prazo continuou influenciado pela comunicação do BACEN, cujos sinais têm sido de que, caso o cenário evolua em linha com o esperado, uma redução adicional da taxa Selic para 6,75% ocorrerá em fevereiro. Nesse mesmo sentido, a melhora das expectativas quanto ao ambiente doméstico, o quadro de inflação corrente confortável e expectativas de preços ancoradas para os próximos anos também foram fatores relevantes para o fechamento da curva. Por sua vez, a parte longa continuou recuando sob influência do movimento da parte curta, da apreciação da taxa de câmbio, do menor risco país e do noticiário político e jurídico doméstico, ainda que a cautela quanto às dificuldades de aprovação das reformas tenha impedido um recuo ainda mais forte das taxas. Entre os contratos futuros de juros mais negociados na BM&F, o contrato com vencimento em janeiro de 2019 encerrou o último dia do mês de com taxa de 6,81% (de 6,87%, do mês anterior); o vencimento janeiro/2021 projetava 8,82% (de 9,06%); o vencimento janeiro/2023 encerrou com taxa de 9,51% (de 9,99%, no último dia do mês anterior); e o vencimento janeiro/2025 encerrou com taxa de 9,86% (de 10,44%).

Câmbio - O real encerrou o mês de janeiro com apreciação de 4,40% ante o dólar, a R\$ 3,16. No acumulado em 12 meses, registra perdas de 1,13%. No exterior, o dólar apresentou novo recuo ante a maior parte das moedas – o índice DXY, que mede o comportamento da divisa ante as principais moedas internacionais, perdeu 3,25% no mês. O movimento foi influenciado pelo cenário global favorável, contendo ampla liquidez internacional, uma agenda macro bastante positiva nas principais regiões e a continuidade da fraqueza dos dados de inflação (sobretudo nos EUA). Ante uma cesta de moedas emergentes, a moeda americana apresentou recuo de 2,04%. Internamente, a favor do real, observou-se a queda do prêmio de risco Brasil (o EMBI+ Brasil encerrou o mês com queda 5,39%, aos 228 pontos) e a melhora das expectativas em torno do cenário doméstico. Em sentido contrário, atuaram a incerteza acerca da aprovação da agenda de reformas fiscais e o novo rebaixamento de rating soberano do país pela agência S&P.

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

CENÁRIOS E PROJEÇÕES

RESUMO	2016	2017	2018
JUROS NOMINAIS ACUMULADO (SELIC)	14,12%	9,99%	6,48%
JUROS NOMINAIS ACUMULADO (CDI)	14,02%	10,01%	6,45%
INFLAÇÃO a.a. (IGP-M)	7,19%	-0,53%	4,00%
INFLAÇÃO a.a. (IPCA)	6,29%	2,95%	4,08%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IGP-M)	6,47%	10,58%	2,38%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IPCA)	7,37%	6,84%	2,30%
CÂMBIO (US\$ variação anual)	-16,47%	1,42%	-4,80%

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

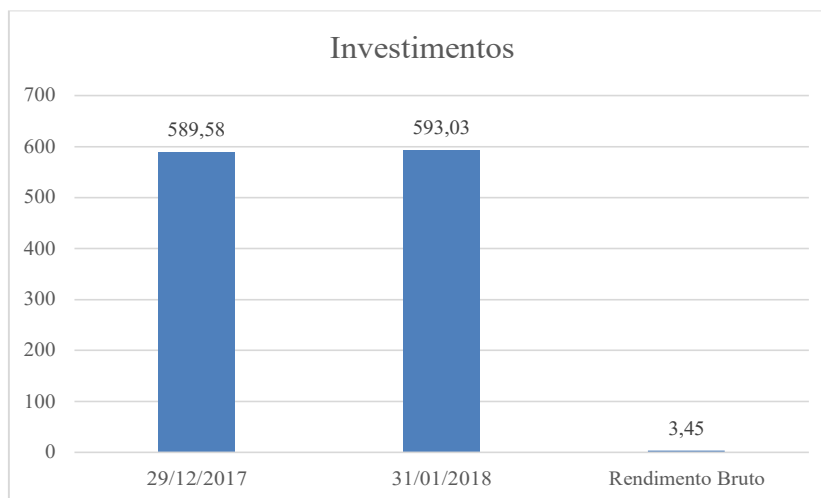
Gestor Responsável: Marise Freitas

Auditoria Externa: KPMG Auditores Independentes

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 IRF-M1 TP em 31/01/2018

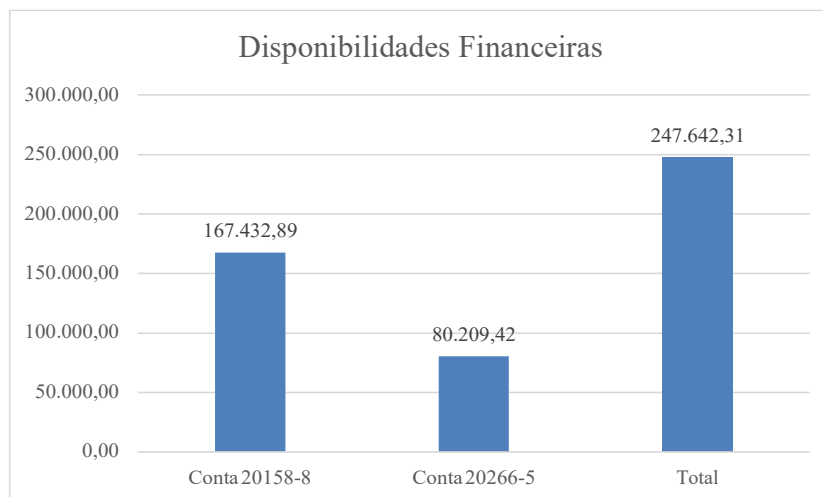
RENTABILIDADE				
A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS				
Ano	Taxa Nominal	IRF-M 1	Acumulada 5 anos	
2013	7,11%	7,44%	Fundo	IRF-M 1
2014	10,22%	10,58%	68,69%	71,15%
2015	12,58%	13,01%	2018	
2016	14,48%	14,72%	Fundo	IRF-M 1
2017	10,86%	11,12%	0,59%	0,59%

Mês	Fundo	IRF-M 1
jan/18	0,59%	0,59%
dez/17	0,56%	0,57%
nov/17	0,59%	0,62%
out/17	0,61%	0,62%
set/17	0,71%	0,74%
ago/17	0,88%	0,90%
jul/17	1,06%	1,05%
jun/17	0,87%	0,89%
mai/17	0,89%	0,91%
abr/17	0,86%	0,87%
mar/17	1,10%	1,12%
fev/17	0,99%	1,01%
últimos 12 meses	10,12%	10,35%

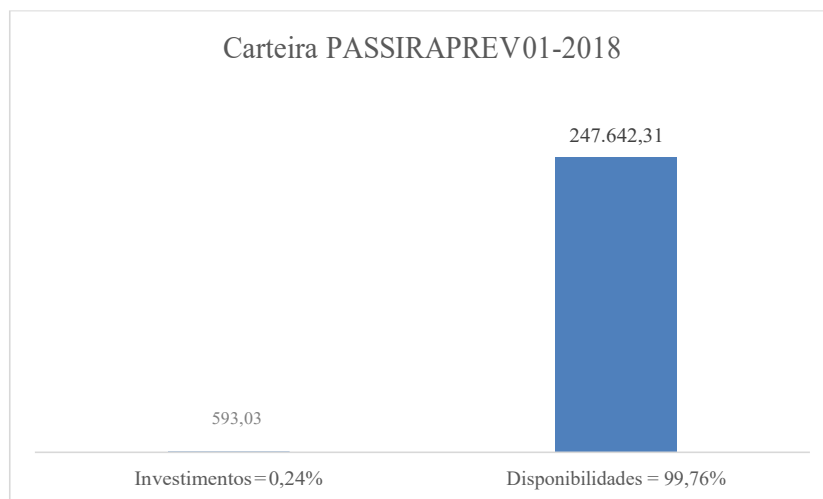


DADOS DE FECHAMENTO DO MÊS			
Cota Fech.	Qtd. Cotas	PL Médio 12 m	PL Fechamento
2,330249690	5261644651,74	R\$ 10.755.572.495,16	R\$ 12.260.945.818,60
V@R (95% de confiança)(1)		0,0131%	
Volatilidade no ano(2)		0,23%	
Volatilidade nos últimos 12 m(2)		0,65%	
% de retornos positivos no ano		95,45%	
% de retornos positivos nos últimos 12 m		98,02%	
Índice de Sharpe nos últimos 12 m(4)		1,05	

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS



RESUMO DA CARTEIRA



relatorio 01-2018.pdf

Código do documento #1eb062d4-9081-4bbe-a7ff-89cc531e96b2

Assinaturas



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

Daniela Cristina da Silva

Eventos do documento

26 Feb 2018, 14:19:55

Documento número 1eb062d4-9081-4bbe-a7ff-89cc531e96b2 **criado** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta #e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email :danycrisilva.dcs@gmail.com. Documento informado: 696.585.951-20. - DATE_ATOM: 2018-02-26T14:19:55-03:00

26 Feb 2018, 14:20:50

Lista de assinatura **iniciada** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta #e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email: danycrisilva.dcs@gmail.com. Documento informado: 696.585.951-20. - DATE_ATOM: 2018-02-26T14:20:50-03:00

26 Feb 2018, 14:20:59

DANIELA CRISTINA DA SILVA **Assinou** (Conta #e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38) - Email: danycrisilva.dcs@gmail.com - IP: 179.235.204.100 (b3ebcc64.virtua.com.br porta: 5840) - Documento de identificação informado: 696.585.951-20 - DATE_ATOM: 2018-02-26T14:20:59-03:00

Hash do documento original

(SHA256):43cac5ea79effc21c49db69a63897af2dc828f70bbf1b9f81bd9d6131d84fc88
(SHA512):8140b821f151d5f6d0d1dcc59ad1ae548b85ce5d4e49f8b9f39a3c22e3a158d4fa8fb9cb3a9dcd26afd5c384a61e0201398d8a6cd685dcd2596325699ad32d4a

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

Esse documento está assinado e certificado pela D4Sign