

RELATÓRIO DA CARTEIRA PASSIRAPREV 07-2018

MERCADO FINANCEIRO

Juros - As taxas de juros domésticas recuaram em todos os vértices da curva. A queda no segmento curto/médio teve apoio na melhora dos indicadores de inflação no Brasil, na forte redução no prêmio de risco país, na valorização do real, e, por fim, no ambiente político menos turbulento. Por sua vez, a parte longa também mostrou fechamento, apoiada pela menor aversão ao risco no exterior. Internamente, a queda do prêmio de risco país, o recuo do dólar ante o real, a estabilização nas perspectivas para a atividade econômica doméstica e o abrandamento do noticiário político doméstico favoreceram o movimento.

Câmbio - O real encerrou o mês de julho com valorização de 2,6% ante o dólar, a R\$ 3,75. No ano, a moeda doméstica exibe desvalorização de 13,5%. Já no acumulado em 12 meses, as perdas são de 19,9%. No exterior, o dólar apresentou desempenho misto ante as demais moedas. O ambiente global mais favorável - agenda de atividade positiva e bem disseminada entre os países, liquidez internacional, reduzidas pressões inflacionárias e relativa estabilidade na China – colaborou para o recuo na aversão ao risco internacional, reduzindo a força do dólar no exterior. Por outro lado, o risco protecionista presente e a forte agenda de atividade nos EUA foram favoráveis à moeda americana. O dólar apresentou ligeira valorização ante a maior parte das moedas de países desenvolvidos e um desempenho um pouco mais elevado frente às moedas de países emergentes. Internamente, a forte queda do prêmio de risco país, a estabilização das expectativas quanto à atividade doméstica e a aparente trégua política favoreceram o desempenho do real, num mês de reduzidas intervenções no mercado de câmbio por parte do Bacen.

CENÁRIOS E PROJEÇÕES

RESUMO	2016	2017	2018
JUROS NOMINAIS ACUMULADO (SELIC)	14,12%	9,86%	6,51%
JUROS NOMINAIS ACUMULADO (CDI)	14,02%	9,89%	6,48%
INFLAÇÃO a.a. (IGP-M)	7,19%	-0,53%	7,58%
INFLAÇÃO a.a. (IPCA)	6,29%	2,95%	4,06%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IGP-M)	6,47%	10,45%	-0,990%
JUROS REAIS BÁSICOS (SELIC/IPCA)	7,37%	6,71%	2,35%
CÂMBIO (US\$ variação anual)	-16,47%	1,42%	14,69%

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

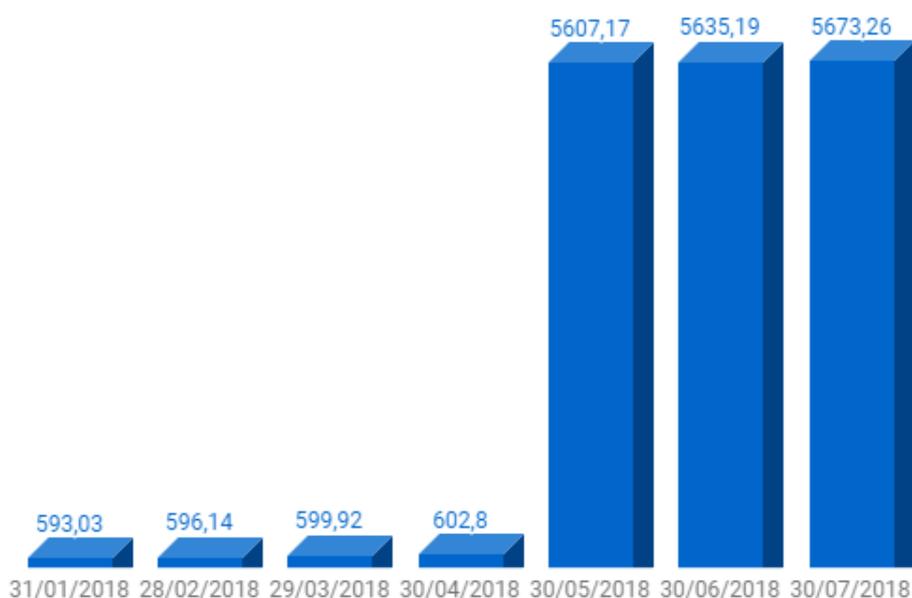
Crédito do Resgate: D + 0

Tipo de Quota: Fechamento

Gestor Responsável: Marise Freitas

Auditoria Externa: KPMG Auditores Investimentos

INVESTIMENTOS



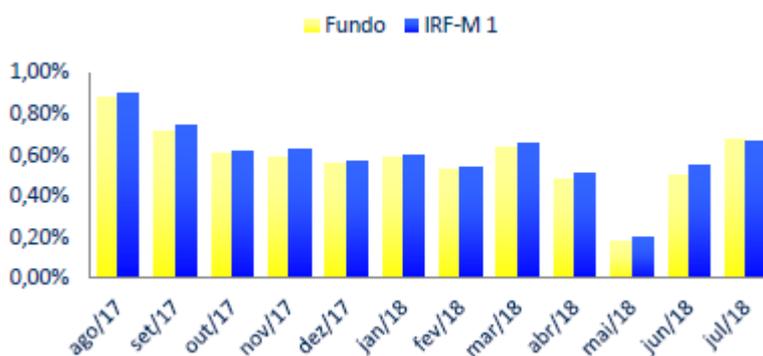
Instituto de Previdência do Município de Passira

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

Informações Gerais Fundo BB Previdenciário RF-M1 TP em 30/07/2018

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%	3,64%	3,76%

Mês	Fundo	IRF-M 1
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%
out/17	0,61%	0,62%
set/17	0,71%	0,74%
ago/17	0,88%	0,90%
últimos 12 meses	7,15%	7,39%

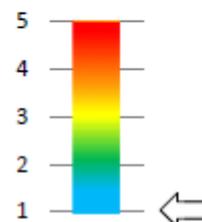


Instituto de Previdência do Município de Passira

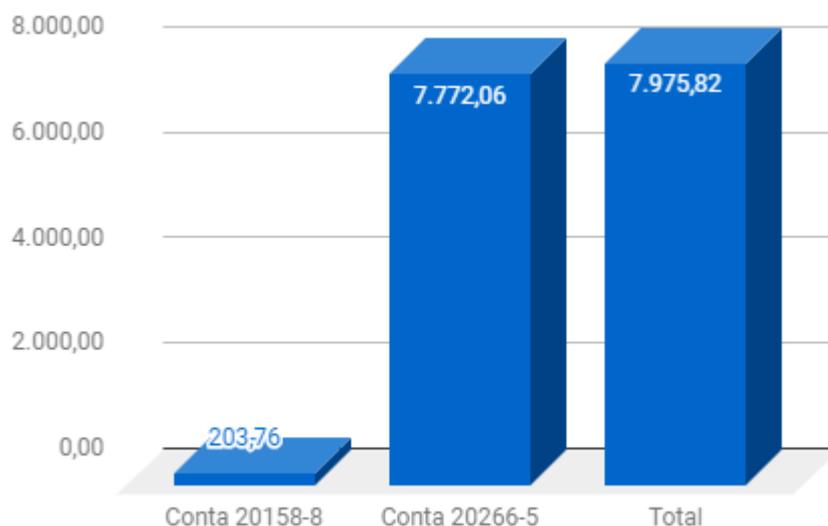
Rua Maria Pereira da Silva, 87 – Centro – Passira/PE – CEP.: 55650-000

DADOS DE FECHAMENTO DO MÊS

Cota Fech.	Qtd. Cotas	PL Médio 12 m	PL Fechamento
2,400907605	4874190740,14	R\$ 11.678.539.712,79	R\$ 11.702.481.616,22
V@R (95% de confiança)(¹)		0,0346%	
Volatilidade no ano(²)		0,63%	
Volatilidade nos últimos 12 m(²)		0,50%	
% de retornos positivos no ano		89,04%	
% de retornos positivos nos últimos 12 m		93,25%	
Índice de Sharpe nos últimos 12 m(³)		0,14	



DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS



RESUMO DA CARTEIRA

Carteira PASSIRAPREV 07-2018



Instituto de Previdência do Município de Passira

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

relatorio 07-2018.pdf

Código do documento 936b5dc8-fc5f-48e7-a903-20757042708a

Assinaturas



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

Daniela Cristina da Silva

Eventos do documento

04 Sep 2018, 10:19:24

Documento número 936b5dc8-fc5f-48e7-a903-20757042708a **criado** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta #e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email :danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE_ATOM: 2018-09-04T10:19:23-03:00

04 Sep 2018, 10:19:42

Lista de assinatura **iniciada** por DANIELA CRISTINA DA SILVA (Conta #e68cb4ea-49d2-4031-903a-a1659243cc38). Email: danycrsilva.dcs@gmail.com. - DATE_ATOM: 2018-09-04T10:19:42-03:00

04 Sep 2018, 10:19:49

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: 20924) - **Geolocalização:** [-7.973409599999998 -34.8373093](#) - Documento de identificação informado: 696.585.951-20 - DATE_ATOM: 2018-09-04T10:19:49-03:00

Hash do documento original

(SHA256):3e28f00bb28d8f0ec121d0c36d2c4297b98163dccfd20e2c681148c6e3efea28

(SHA512):f63abf3d6df55b19229156cd6c935f3632d35fdfe426bca6aee0ee17d9aee1c521fc2cf56c78710aee15483348c65419eb0b1e8c59c8f6987885807f3b035892

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

Esse documento está assinado e certificado pela D4Sign