

RELATÓRIO RPPS CAÇAPAVA DO SUL – 2º TRIMESTRE DE 2017

Comentário do Economista:

Quanto à carteira de investimento do **FUNDO DE APOSENTADORIA E PENSÃO DOS SERVIDORES – CAÇAPAVA DO SUL/RS** informamos que os recursos previdenciários deste Regime Próprio de Previdência Social contemplam exclusivamente aplicações em renda fixa. A Carteira de investimento é o conjunto das aplicações do RPPS onde deve refletir a situação do RPPS, perfil de investidor e as suas perspectivas. Assim verificamos que as alocações dos recursos apresentam 19 ativos distintos - fundos de investimentos – A Carteira de investimento é o conjunto das aplicações do RPPS onde deve refletir a situação do RPPS, perfil de investidor e as suas perspectivas. Assim verificamos que as alocações dos recursos apresentam concentração de 7,8% aproximadamente dos recursos em IMA-B, 17,3% em CDI, 31,3% em IRF-M 1, 9,6% em IMA Geral, 1,7% em IPCA, 8% em IDKA 2, 15,4% em IRF-M, 8,4% em IMA-B 5 e uma posição de 0,01% em IMA-B 5+. A partir do contexto atual de mercado, tal configuração das aplicações apresenta um PERFIL DE RISCO de mercado MODERADO, para a renda fixa, com alguma perspectiva de proteção e média volatilidade. No mês de Junho podemos verificar que a rentabilidade acumulada para o exercício ficou em R\$ 1.825.355,93. Finalizando este mês de 2017 o RPPS apresenta uma rentabilidade acumulada de 5,24% e temos como sua meta atuarial para o mesmo período a rentabilidade desejada de 4,18% (IPCA + 6%).

Referência Gestão e Risco

| Composição da Carteira | jan/17 R\$ | fev/17 R\$ | mar/17 R\$ | abr/17 R\$ | mai/17 R\$ | jun/17 R\$ | % * |
|---|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------|
| BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | \$ 529.270,37 | \$ 534.540,20 | \$ 704.786,19 | \$ 710.841,04 | \$ 894.618,95 | \$ 101,65 | 0,0003% |
| BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP | \$ 2.183.584,17 | \$ 2.235.551,84 | \$ 2.262.219,37 | \$ 2.269.134,11 | \$ 2.270.163,40 | \$ 3.447.344,03 | 9,6% |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP | \$ 1.615.105,12 | \$ 1.680.134,10 | \$ 1.696.550,92 | \$ 1.688.718,19 | \$ 631.309,97 | \$ - | 0,0% |
| BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP | \$ 254.779,71 | \$ 256.893,99 | \$ 259.473,88 | \$ 261.428,74 | \$ 420.262,65 | \$ - | 0,0% |
| BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP | \$ 2.434.775,32 | \$ 2.455.652,29 | \$ 1.640.792,75 | \$ 1.653.570,60 | \$ 2.672.527,35 | \$ 1.226.140,67 | 3,4% |
| BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP | \$ 951.781,17 | \$ 970.205,87 | \$ 987.756,84 | \$ 1.006.688,37 | \$ 1.008.537,81 | \$ 1.021.598,23 | 2,9% |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP | \$ 636.335,00 | \$ 623.300,00 | \$ 628.625,00 | \$ 632.590,00 | \$ 638.030,00 | \$ 641.175,00 | 1,8% |
| BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA | \$ 871.588,89 | \$ 883.547,11 | \$ 896.227,16 | \$ 903.432,75 | \$ 906.792,80 | \$ 1.816.048,15 | 5,1% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | \$ 3.233.282,17 | \$ 3.276.156,61 | \$ 3.322.290,83 | \$ 2.478.821,24 | \$ 2.488.538,98 | \$ 1.074.395,14 | 3,0% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | \$ 425.064,74 | \$ 446.281,79 | \$ 449.991,58 | \$ 446.242,19 | \$ 437.596,05 | \$ 2.303,81 | 0,01% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | \$ 1.951.468,14 | \$ 2.308.703,37 | \$ 2.332.228,05 | \$ 2.324.195,74 | \$ 1.242.750,10 | \$ 1.244.574,68 | 3,5% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | \$ 1.073.073,47 | \$ 1.083.664,10 | \$ 1.095.594,74 | \$ 1.104.974,65 | \$ 2.464.054,48 | \$ 4.598.679,98 | 12,8% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | \$ 250.213,33 | \$ 255.231,66 | \$ 270.465,60 | \$ 1.068.165,25 | \$ 2.089.221,24 | \$ 859.809,99 | 2,4% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | \$ 1.612.040,44 | \$ 769.242,61 | \$ 777.447,25 | \$ 783.532,69 | \$ 790.759,32 | \$ 1.238.959,73 | 3,5% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | \$ 1.890.112,98 | \$ 1.918.048,64 | \$ 1.944.534,77 | \$ 1.958.118,77 | \$ 654.901,32 | \$ 1.661.277,41 | 4,6% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | \$ - | \$ - | \$ 1.534,36 | \$ 1.540,71 | \$ 1.882,64 | \$ 1.564,64 | 0,004% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | \$ 638.292,55 | \$ 664.302,53 | \$ 721.450,44 | \$ 728.822,76 | \$ 3.459.954,05 | \$ 3.763.533,24 | 10,5% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | \$ 1.809.290,95 | \$ 1.836.025,79 | \$ 1.861.313,38 | \$ 1.874.275,58 | \$ 346.883,33 | \$ 1.371.370,52 | 3,8% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | \$ 1.716.907,20 | \$ 1.802.303,71 | \$ 1.817.365,50 | \$ 1.802.495,68 | \$ 515.192,79 | \$ - | 0,0% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | \$ 3.533.674,54 | \$ 3.668.897,59 | \$ 3.706.854,54 | \$ 3.694.211,01 | \$ 534.309,50 | \$ 1.583.124,94 | 4,4% |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | \$ 822.116,82 | \$ 840.514,11 | \$ 1.616.603,96 | \$ 1.621.682,45 | \$ 1.622.916,87 | \$ - | 0,0% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | \$ 2.928.069,85 | \$ 2.957.185,40 | \$ 2.990.136,17 | \$ 2.842.863,52 | \$ 4.379.262,90 | \$ 6.636.085,67 | 18,5% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | \$ 472.361,87 | \$ 1.215.707,54 | \$ 1.233.048,08 | \$ 1.238.883,05 | \$ 2.473.151,52 | \$ 3.643.572,83 | 10,2% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | \$ 315.817,82 | \$ 327.744,02 | \$ 330.855,20 | \$ 329.111,19 | \$ 325.935,71 | \$ - | 0,0% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | \$ 202.228,47 | \$ 204.048,72 | \$ 152.448,54 | \$ 153.623,08 | \$ 154.916,15 | \$ - | 0,0% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | \$ 2.609.791,11 | \$ 2.643.513,73 | \$ 2.681.032,20 | \$ 2.702.127,90 | \$ 2.713.297,80 | \$ - | 0,0% |
| CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | \$ 594.376,74 | \$ 322.793,55 | \$ 48.310,26 | \$ 48.681,94 | \$ 49.088,08 | \$ - | 0,0% |
| Total | 35.555.402,94 | 36.180.190,87 | 36.429.937,56 | 36.328.773,20 | 36.186.855,76 | 35.831.660,31 | 100,00% |

*Alocado do F.I. perante o PL.

| | | | | | | |
|--|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| Disponibilidade em conta corrente | \$ - | \$ 211.869,53 | \$ - | \$ 175.991,91 | \$ 100.809,47 | \$ - |
| Montante total - Aplicações + Disponibilidade | 35.555.402,94 | 36.392.060,40 | 36.429.937,56 | 36.504.765,11 | 36.287.665,23 | 35.831.660,31 |