

FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO MUNICIPIO DE FELIZ/RS  
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL  
COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO RPPS

**RELATÓRIO E PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO RPPS – FELIZ/RS**  
**RENTABILIDADE, RISCOS E ADERÊNCIA DAS ALOCAÇÕES À POLÍTICA DE INVESTIMENTOS**

**Ao Conselho Fiscal do RPPS – Feliz/RS**

Em atendimento ao disposto no Art. 23-A, Inciso VIII, da Lei Municipal nº 1.809/2005, bem como requisito do nível I do Pró-Gestão RPPS, apresentamos o presente relatório com a rentabilidade, controle de riscos e aderência das alocações à Política de Investimentos aprovada pelo Conselho Municipal de Previdência deste RPPS, em relação ao mês de dezembro de 2019.

**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	34.700.185,49	848.368,99	734.139,51	35.661.603,12	847.188,15	2,43%	0,83%	292,61%	1,59%
Fevereiro	35.661.603,12	451.811,19	797.235,62	35.360.716,13	44.537,44	0,12%	0,90%	13,95%	1,96%
Março	35.360.716,13	848.362,29	684.157,45	35.701.837,05	176.916,08	0,50%	1,19%	41,72%	2,41%
Abril	35.701.837,05	3.869.416,51	3.896.879,82	36.025.977,13	351.603,39	0,98%	1,06%	92,95%	1,47%
Mai	36.025.977,13	312.132,22	600.000,00	36.481.245,38	743.136,03	2,06%	0,64%	321,98%	1,93%
Junho	36.481.245,38	2.333.568,37	2.033.800,00	37.712.137,35	931.123,60	2,53%	0,45%	562,14%	1,91%
Julho	37.712.137,35	1.802.915,11	1.797.200,79	38.199.904,74	482.053,07	1,28%	0,72%	176,47%	1,37%
Agosto	38.199.904,74	400.211,86	1.487.316,51	37.062.526,78	-50.273,31	-0,13%	0,62%	-21,21%	2,05%
Setembro	37.062.526,78	3.447.024,88	2.344.147,38	38.879.311,16	713.906,88	1,87%	0,45%	418,88%	1,63%
Outubro	38.879.311,16	392.611,61	421.853,34	39.693.349,02	843.279,59	2,17%	0,63%	342,23%	1,78%
Novembro	39.693.349,02	304.173,00	327.436,87	39.300.078,58	-370.006,57	-0,93%	0,98%	-95,52%	1,63%
Dezembro	39.300.078,58	889.413,53	492.923,69	40.342.710,34	646.141,92	1,63%	1,64%	99,11%	2,11%
<b>Acumulado no ano</b>					<b>5.359.606,27</b>	<b>15,45%</b>	<b>10,59%</b>	<b>145,85%</b>	

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dez/2019)**

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	17.158.735,41	42,53%	25,00%	40,00%	70,00%	11.081.161,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	11.522.565,62	28,56%	5,00%	10,00%	60,00%	12.683.060,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.178.285,55	15,31%	10,00%	20,00%	40,00%	9.958.798,59
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.242.791,49	5,56%	5,00%	10,00%	20,00%	5.825.750,58
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.427.558,27	6,02%	5,00%	10,00%	10,00%	1.606.712,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.017.135,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	812.774,00	2,01%	0,00%	5,00%	5,00%	1.204.361,52
<b>Total Carteira</b>		<b>40.342.710,34</b>					

**Distribuição de rendimentos de Fundos Imobiliários - base (dez/2019)**

Fundo	Valor (R\$)	Nº Cotas	Retorno (R\$)	% retorno PL
BNFS11	0,9441299429	3.665	3.460,23	0,737
RBVA11	0,90	1000	900,00	0,621
CXRI11	21,00	100	2.100,00	1,55

Atestamos que estão sendo realizados os controles de risco de mercado, de crédito e de liquidez previstos na Política de Investimentos. De qualquer sorte, é importante ressaltar que, seja qual for a alocação de ativos, o mercado apresentar períodos adversos, que poderão afetar parte da carteira. Portanto, é imperativo observar um horizonte de tempo que possa ajustar essas flutuações e permitir a recuperação da ocorrência de ocasionais perdas. Desta forma, o RPPS deve manter-se fiel à política de investimentos definida originalmente, a partir do seu perfil de risco.

FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO MUNICIPIO DE FELIZ/RS  
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL  
COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO RPPS

**Observações:**

- Deve-se atentar para que as receitas de contribuição sejam maiores que as despesas com benefícios. Em dezembro/19 identificamos um valor de contribuição de R\$ 46.579,32 inferior à despesa.

Feliz/RS, 21 de janeiro de 2020.

<b>Membro Titular:</b>	<b>Membro Titular:</b>	<b>Gestor Financeiro:</b>
<p><b>Tatiane Schnur</b> CPF: 003.762.150-54 Certificação CPA-10 Ambima Validade: 12/06/2021</p>	<p><b>Eduardo Mello da Silva</b> CPF: 002.796.350-01 Certificação CPA-10 Ambima Validade: 25/10/2020</p>	<p><b>Ramsés Machado Silva</b> CPF: 964.688.900-04 Certificação CPA-10 Ambima Validade: 02/06/2020</p>

\* A ata eletrônica é cópia fiel da ata impressa, que pode ser conferida junto ao Gestor Financeiro do RPPS.