

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 janeiro de 2020.

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	40.342.710,34	569.050,80	940.780,85	40.200.164,16	229.183,87	0,57%	0,71%	79,98%	1,79%
Acumulado no ano					229.183,87				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (jan/2020)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	17.289.513,73	43,01%	20,00%	40,00%	70,00%	10.850.601,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	11.190.558,90	27,84%	10,00%	25,00%	60,00%	12.929.539,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.193.397,22	15,41%	10,00%	15,00%	40,00%	9.886.668,44
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.848.275,06	7,09%	5,00%	8,00%	10,00%	1.171.741,36
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.867.713,00	4,65%	5,00%	10,00%	10,00%	2.152.303,42
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	810.706,25	2,02%	0,00%	0,00%	5,00%	1.199.301,96
Total Carteira		40.200.164,16					

Distribuição de rendimentos de Fundos Imobiliários - base (jan/2020)

Fundo	Valor (R\$)	Nº Cotas	Retorno (R\$)	% retorno PL
BNFS11	0,99212426429	3.665	3.376,35	0,682
RBVA11	1,41	1000	1.410,00	0,834
CXRI11	40,50	100	4.050,00	2,565

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 à 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.

Observações:

- Deve-se atentar para que as receitas de contribuição sejam maiores que as despesas com benefícios. Em janeiro/20 identificamos um valor de contribuição de R\$ 49.150,96 inferior à despesa.

Feliz/RS, 26 de fevereiro de 2020.

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

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