

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 novembro 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%
Acumulado no ano					4.713.464,35	13,60%	8,80%	154,46%	

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	16.711.209,56	42,52%	25,00%	40,00%	70,00%	10.798.845,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	11.267.877,12	28,67%	5,00%	10,00%	60,00%	12.312.170,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.045.129,72	15,38%	10,00%	20,00%	40,00%	9.674.901,71
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.076.430,73	5,28%	5,00%	10,00%	20,00%	5.783.584,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.449.504,95	6,23%	5,00%	10,00%	10,00%	1.480.502,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.965.003,93
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	749.926,50	1,91%	0,00%	5,00%	5,00%	1.215.077,43
Total Carteira		39.300.078,58					

Distribuição de rendimentos de Fundos Imobiliários - base (nov/2019)

Fundo	Valor (R\$)	Nº Cotas	Retorno (R\$)	% retorno PL
BNFS11	0,9327012857	3.665	3.418,35	0,73
RBVA11	0,90	1000	900,00	0,64
CXRI11	8,00	100	800,00	0,67

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.

Observações:

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

- Deve-se atentar para que as receitas de contribuição sejam maiores que as despesas com benefícios. Em novembro/19 identificamos um valor de contribuição de R\$ 43.720,10 inferior à despesa.

Feliz/RS, 16 de dezembro de 2019.

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