



RELATÓRIO TRIMESTRAL - 2/2017

21/07/2017

**Regime Próprio de Previdência Social do município de
NOVA CANAÃ DO NORTE - MT
CANAÃ PREVI**

Prezado(a) , Sr(a). MARIA OZANINA MACHADO DELLATESTA;

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Trimestral dos investimentos, referente ao 2º TRIMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do CANAÃ PREVI.

Este relatório vem atender o **Inciso V, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011**, que exige a elaboração de **Relatórios Trimestrais**, para acompanhamento dos riscos e desempenho das aplicações financeiras.

Art. 3. V – Elaborar relatórios detalhados, no mínimo, trimestralmente, sobre a rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos dos RPPS e a aderência à política anual de investimentos e suas revisões e submetê-las as instâncias superiores de deliberação e controle.



APLICAÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2017 - CANAÃ PREVI

OPÇÃO DE INVESTIMENTO	RESOLUÇÃO CMN 3.922/2010	Atualmente (%)	LIMITE MÁXIMO DO PAI (%)	Atualmente (R\$)	LIMITE MÁXIMO DEFINIDO NO PAI (R\$)	LIMITES PARA APLICAÇÃO, CONFORME A POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	
RENDA FIXA							
Títulos Públicos	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	30%	-	6.548.767,39	AINDA PERMITE	6.548.767,39
F.I. 100% em Títulos Públicos (IMA)	Art. 7º, I, b (100%)	100,0%	100%	21.829.224,64	21.829.224,64		-
Operações Compromissadas	Art. 7º, II	0,0%	0%	-	-		-
F.I. referenciado em Indicadores RF (IMA)	Art. 7º, III, a (80%)	0,0%	50%	-	10.914.612,32	AINDA PERMITE	10.914.612,32
F.I. em índices de RF (IMA)	Art. 7º, III, b (80%)	0,0%	50%	-	10.914.612,32	AINDA PERMITE	10.914.612,32
F.I. referenciado em Indicadores RF	Art. 7º, IV, a (30%)	0,0%	30%	-	6.548.767,39	AINDA PERMITE	6.548.767,39
F.I. em índices de RF	Art. 7º, IV, b (30%)	0,0%	30%	-	6.548.767,39	AINDA PERMITE	6.548.767,39
Poupança	Art. 7º, V, a (20%)	0,0%	0%	-	-		-
LIG - Letras Imobiliárias Garantidas	Art. 7º, V, b (20%)	0,0%	0%	-	-		-
FIDC (Cond. Aberto)	Art. 7º, VI (15%)	0,0%	5%	-	1.091.461,23	AINDA PERMITE	1.091.461,23
FIDC (Cond. Fechado)	Art. 7º, VII, a (5%)	0,0%	0%	-	-		-
F.I. em Crédito Privado	Art. 7º, VII, b (5%)	0,0%	0%	-	-		-
RENDA VARIÁVEL							
F.I. referenciado em ações	Art. 8º, I, (30%)	0,0%	5%	-	1.091.461,23	AINDA PERMITE	1.091.461,23
F.I. referenciado em índices de ações	Art. 8º, II (20%)	0,0%	5%	-	1.091.461,23	AINDA PERMITE	1.091.461,23
F.I. em ações	Art. 8º, III (15%)	0,0%	5%	-	1.091.461,23	AINDA PERMITE	1.091.461,23
F.I. Multimercados	Art. 8º, IV (5%)	0,0%	5%	-	1.091.461,23	AINDA PERMITE	1.091.461,23
F.I. em Participações	Art. 8º, V (5%)	0,0%	0%	-	-		-
F.I. Imobiliário negociado em bolsa	Art. 8º, VI (5%)	0,0%	0%	-	-		-
TOTAL EM RENDA VARIÁVEL	Art. 8º, § único (30%)	0,0%	20%	-	4.365.844,93	AINDA PERMITE	4.365.844,93

Igor França Garcia | Atuário MIBA/RJ 1.659 | Certificação Profissional ANBIMA CPA – 20

Consultor de Investimentos Credenciado pela CVM

(65) 9242.8876 | igor.garcia@atuarialconsultoria.com.br | (SKYPE)igor frança garcia | (65) 3621.8267

Rua Monsenhor Trebaure, nº 210, Centro Norte - Cuiabá – MT - CEP: 78.005-380



RESUMO DO REGULAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF – M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF – M TÍTULOS PÚBLICOS	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA – B TÍTULOS PÚBLICOS	CAIXA FI BRASIL IRF – M 1 TITULOS PUBLICOS RF
CNPJ	11.328.882/0001-35	07.111.384/0001-69	07.442.078/0001-05	10.740.670/0001-06
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IRF – M 1	IRF - M	IMA – B	IRF – M 1
PÚBLICO ALVO	Investidores Qualificados	Investidores Qualificados	Investidores Qualificados	Investidores Qualificados
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a.	Caixa Econômica Federal
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM S.A	BB Gestão de Recursos DTVM S.A	BB Gestão de Recursos DTVM S.A	Caixa Econômica Federal
CUSTODIANTE	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal
AUDITORIA	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Ernst & Young Terco Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	08/12/2009	08/12/2014	24/07/2005	11/05/2012
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,30% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	10.000,00	10.000,00	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
RESGATE MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
SALDO MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte após a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	Baixo	Alto	Muito Alto	Baixo
ENQUADRAMENTO LEGAL	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%)	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%)	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%)	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%)

* Definição da própria Instituição financeira

3



RESUMO DO REGULAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

INFORMAÇÕES	CAIXA FI BRASIL IMA B TITULOS PUBLICOS			
CNPJ	10.740.658/0001-93			
SEGMENTO	Renda Fixa			
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices			
ÍNDICE	IMA - B			
PÚBLICO ALVO	Investidores Qualificados			
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal			
GESTOR	Caixa Econômica Federal			
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal			
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal			
AUDITORIA	Ernst & Young Terco Auditores Independentes			
DATA DE INÍCIO	08/03/2010			
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.			
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui			
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00			
APLICAÇÕES ADICIONAIS	Qualquer valor			
RESGATE MÍNIMO	Qualquer valor			
SALDO MÍNIMO	Qualquer valor			
CARÊNCIA	Não possui			
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)			
RISCO DE MERCADO *	Médio			
ENQUADRAMENTO LEGAL	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%)			

* Definição da própria Instituição financeira

4



MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

1

CAIXA FI BRASIL IMA B TITULOS PUBLICOS						
	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	2.787.445,60	-	-	9.507,55	2.777.938,05	-0,341%
MAIO	2.777.938,05	-	-	33.135,33	2.744.802,72	-1,193%
JUNHO	2.744.802,72	-	-	4.111,14	2.748.913,86	0,150%

2

CAIXA FI BRASIL IRF – M 1 TITULOS PUBLICOS RF						
	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	686.707,98	-	-	5.922,19	692.630,17	0,862%
MAIO	692.630,17	-	-	6.243,38	698.873,55	0,901%
JUNHO	698.873,55	-	-	6.046,21	704.919,76	0,865%



MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

1

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF – M TÍTULOS PÚBLICOS						
	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	6.449.758,07	-	-	32.339,09	6.482.097,16	0,501%
MAIO	6.482.097,16	-	-	16.134,54	6.498.231,70	0,249%
JUNHO	6.498.231,70	-	-	85.997,73	6.584.229,43	1,323%

2

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA – B TÍTULOS PÚBLICOS						
	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	706.876,53	-	-	2.434,52	704.442,01	-0,344%
MAIO	704.442,01	-	-	8.433,55	696.008,46	-1,197%
JUNHO	696.008,46	-	-	1.021,86	697.030,32	0,147%

3

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF – M 1 TÍTULOS PÚBLICOS						
	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	10.269.103,90	-	-	87.918,70	10.357.022,60	0,856%
MAIO	10.357.022,60	350.000,00	-	93.555,85	10.800.578,45	0,903%
JUNHO	10.800.578,45	200.000,00	-	93.552,82	11.094.131,27	0,866%

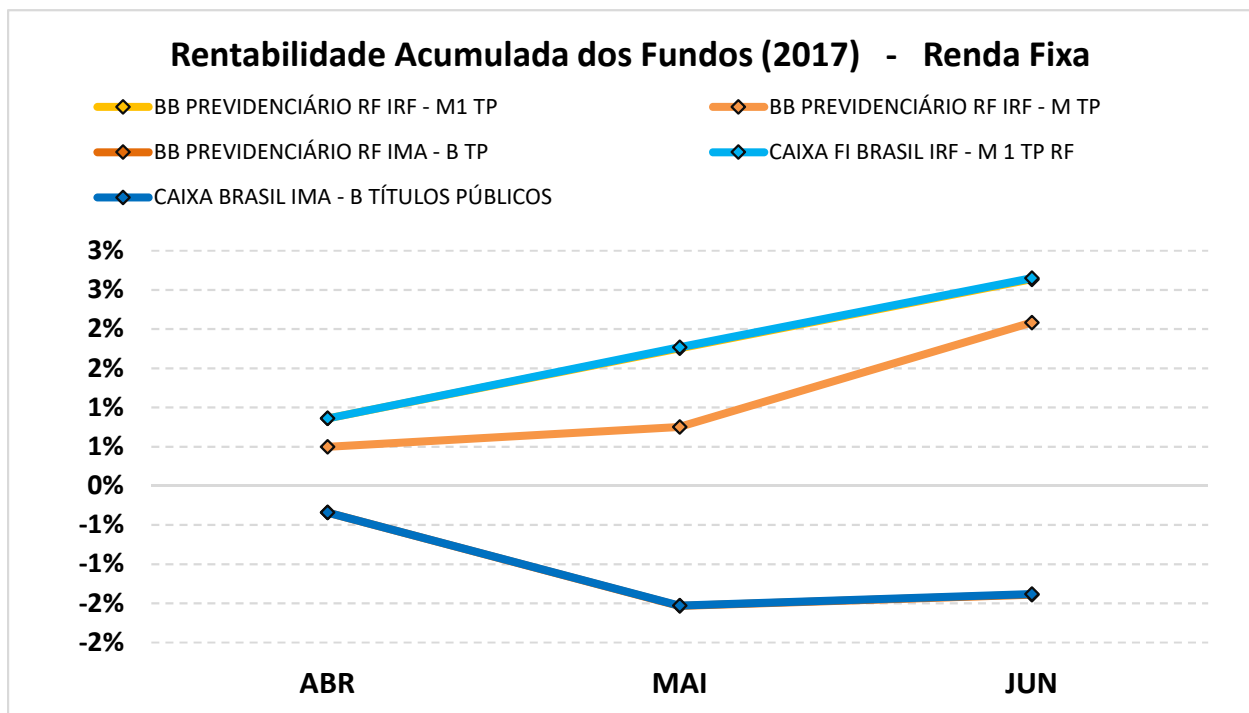
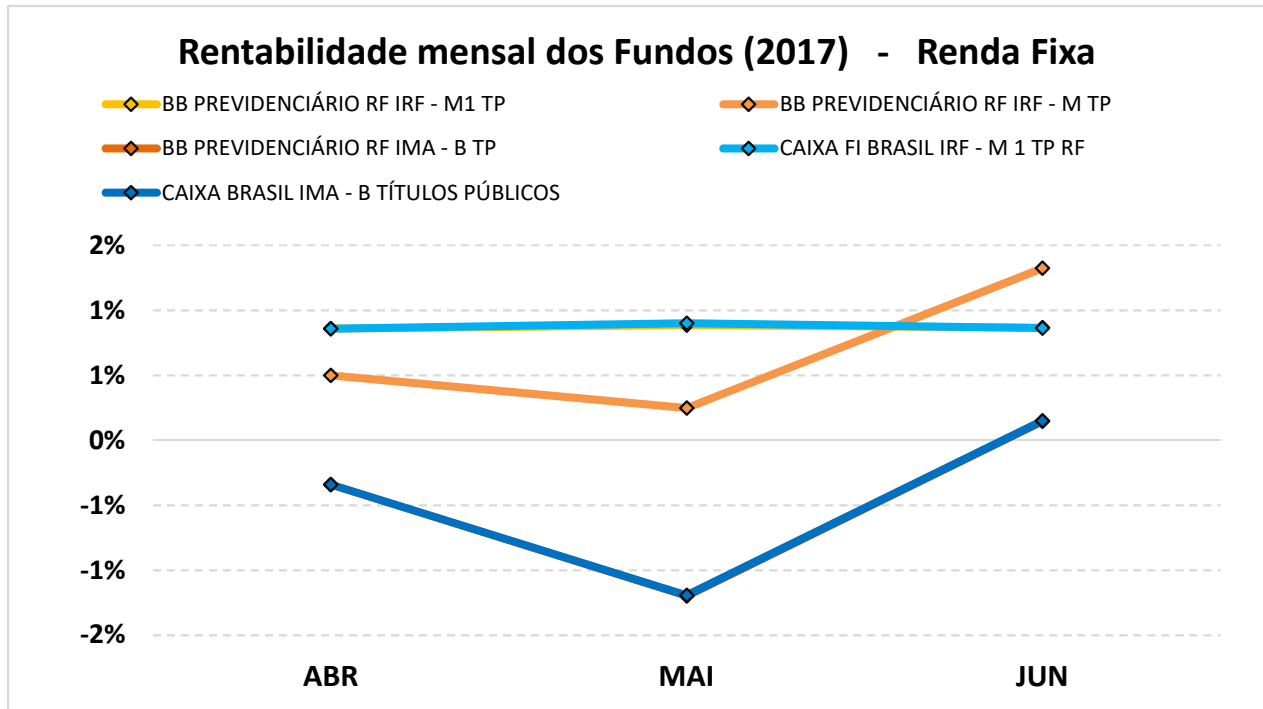


TABELA DE RENTABILIDADE

INVESTIMENTOS	ABR	MAI	JUN	ACUMULADO
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M1 TP	0,86%	0,89%	0,87%	2,64%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP	0,50%	0,25%	1,32%	2,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP	-0,34%	-1,20%	0,15%	-1,39%
CAIXA FI BRASIL IRF - M 1 TP RF	0,86%	0,90%	0,87%	2,65%
CAIXA BRASIL IMA - B TÍTULOS PÚBLICOS	-0,34%	-1,19%	0,15%	-1,38%
IMA - B	-0,32%	-1,19%	0,16%	-1,34%
IRF - M 1	0,87%	0,91%	0,89%	2,69%
IRF - M	0,53%	0,30%	1,35%	2,20%



GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE





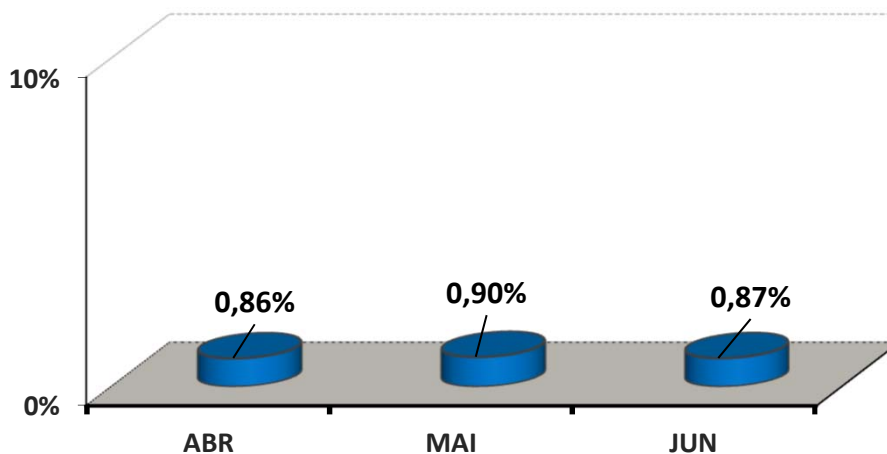
MELHOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDOS DE INVESTIMENTO	ABR	MAI	JUN
CAIXA FI BRASIL IRF - M 1 TP RF	0,86%	0,90%	0,87%

Comportamento MENSAL no Trimestre

■ CAIXA FI BRASIL IRF - M 1 TP RF

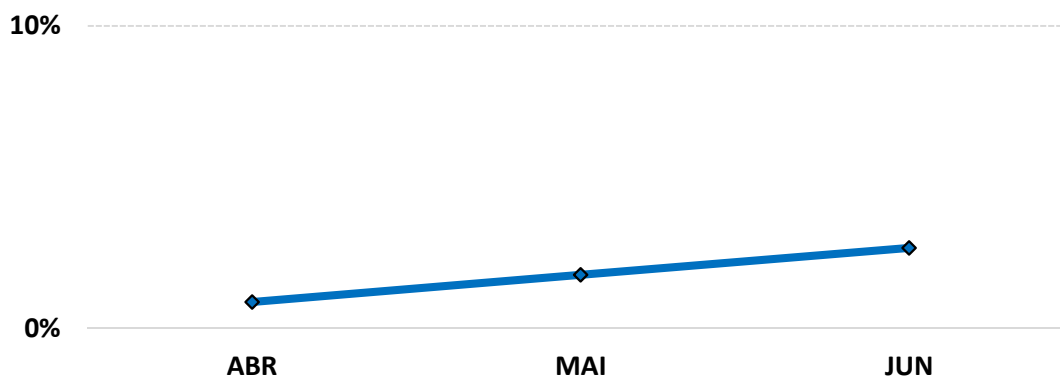


COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDOS DE INVESTIMENTO	ABR	MAI	JUN
CAIXA FI BRASIL IRF - M 1 TP RF	0,86%	1,77%	2,65%

Comportamento ACUMULADO no Trimestre

◆ CAIXA FI BRASIL IRF - M 1 TP RF



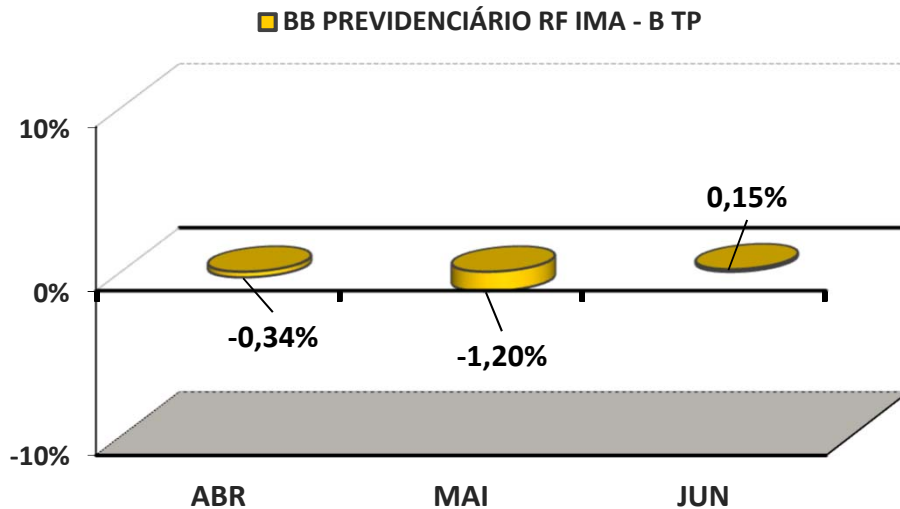


PIOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDOS DE INVESTIMENTO	ABR	MAI	JUN
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP	-0,34%	-1,20%	0,15%

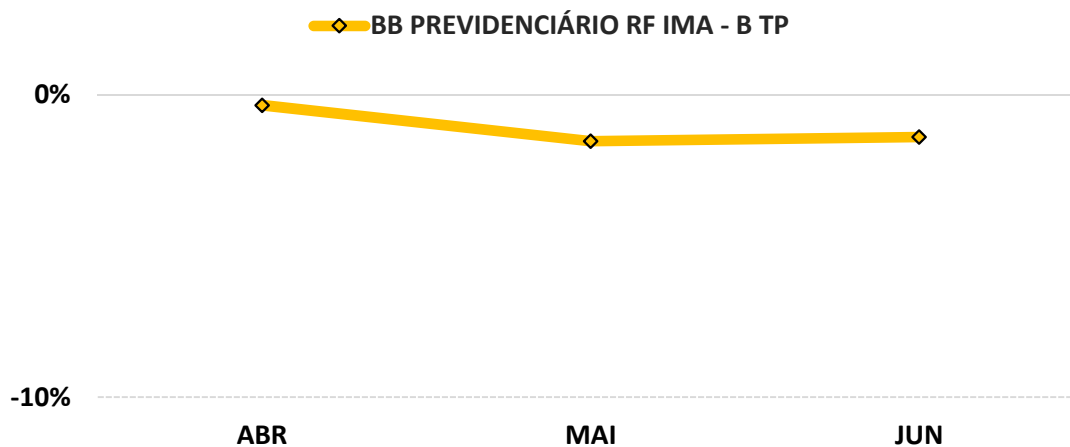
Comportamento MENSAL no Trimestre



COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDOS DE INVESTIMENTO	ABR	MAI	JUN
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP	-0,34%	-1,53%	-1,39%

Comportamento ACUMULADO no Trimestre





ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 2º TRIMESTRE - 2017

	ABR	MAI	JUN
MENSAL	0,55%	0,35%	0,89%
CDI	0,79%	0,93%	0,81%
IBOVESPA	0,64%	-4,12%	0,30%
META ATUARIAL	0,63%	0,80%	0,26%

	ABR	MAI	JUN
ACUMULADO DO TRIMESTRE	0,55%	0,90%	1,80%
CDI	0,79%	1,73%	2,55%
IBOVESPA	0,64%	-3,51%	-3,22%
META ATUARIAL	0,63%	1,43%	1,69%

RENTABILIDADE ACUMULADA DO TRIMESTRE do(a) CANAÃ PREVI: R\$ 379.332,56

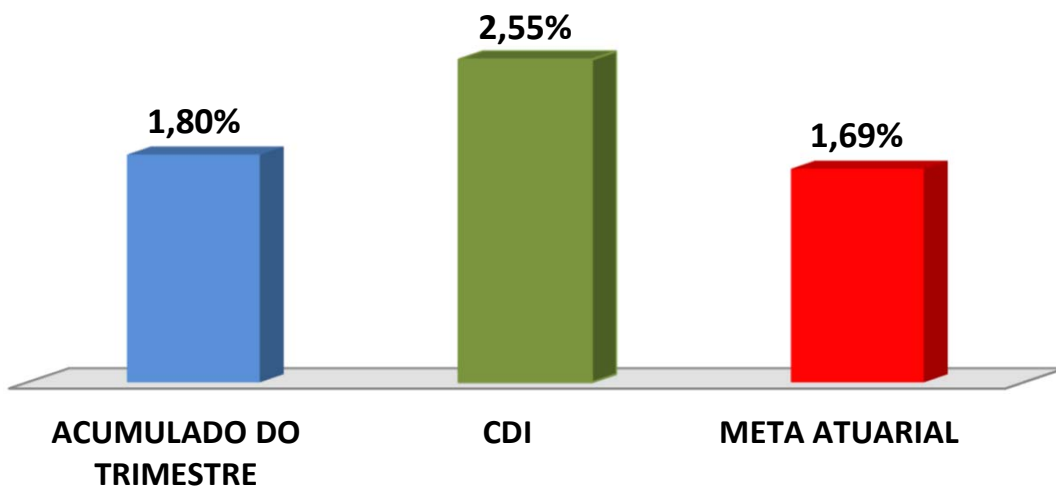
META ATUARIAL ACUMULADA DO TRIMESTRE: R\$ 353.466,69

GANHO SOBRE A META ATUARIAL R\$ 25.865,87



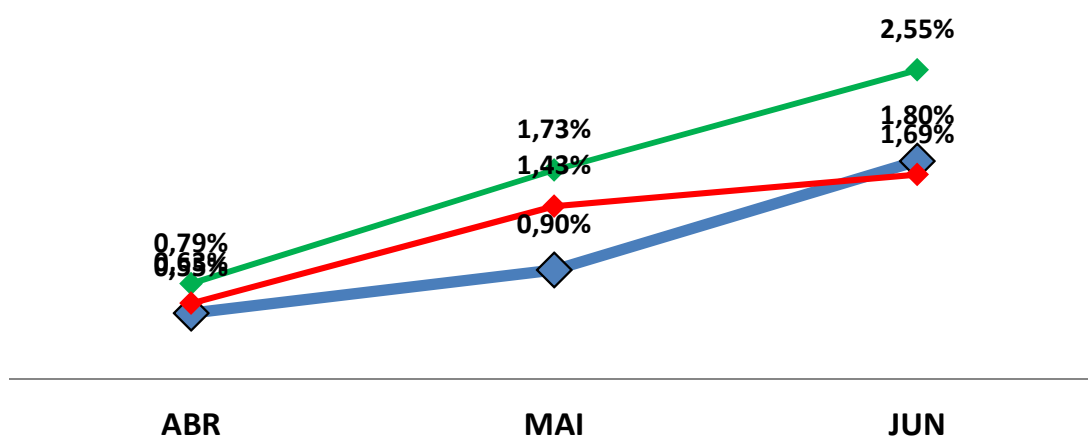
GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

Rentabilidade Acumulada no Trimestre



Rentabilidade Acumulada no Trimestre

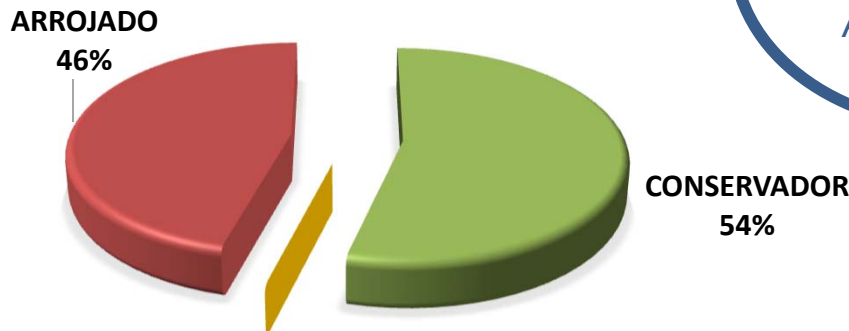
◆ ACUMULADO DO TRIMESTRE ◆ CDI ◆ META ATUARIAL





CLASSIFICAÇÃO DE PERFIL DE INVESTIDOR

PERFIL DOS INVESTIMENTOS



PERFIL 6
MODERADO
COM TENDÊNCIA
ARROJADA

Descrição do Perfil de Investidor

Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados, mas busca investir um pouco em ativos arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é o perfil mais indicado.

Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo é o perfil mais indicado, pois os investimentos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil é o mais equilibrado, entre cumprir a Meta Atuarial e se proteger um pouco das oscilações de mercado.

Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

CONSERVADOR	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
MODERADO	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
ARROJADO	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO



ANÁLISE DE RISCOS DOS INVESTIMENTOS

Ratings são classificações atribuídas às empresas, países ou fundos de investimento pelas agências de classificação de riscos. O mecanismo de ratings serve para classificar a opinião de uma agência sobre a capacidade da empresa ou país ou de um fundo de investimento de honrar seus compromissos financeiros.

As agências de classificação de risco possuem um papel fundamental no mercado, pois são consideradas opiniões isentas e de grande credibilidade. Cabe a essas agências analisar os países e empresas e classificá-los quanto ao grau de risco que os mesmos representam para seus investidores.

Para estabelecer os **ratings**, as agências levam em consideração todos os fatores que possam afetar a empresa, país ou os fundos de investimento, e conseqüentemente sua capacidade de honrar suas dívidas. No caso de fundos de investimento, são avaliados, por exemplo, a rentabilidade garantida pelo fundo, o nível de endividamento (inadimplência), a liquidez, participação de mercado, capacidade administrativa, regulamentação de mercado, e demais fatores que envolvam risco.

Os investimentos no qual o(a) CANAÃ PREVI, aplicou durante o 2º TRIMESTRE de 2017, são classificados como sendo de RENDA FIXA.

Os Investimentos de **RENDA FIXA** são classificados como **FUNDOS DE INVESTIMENTO EXCLUSIVOS EM TÍTULOS PÚBLICOS**.



Esses investimentos são isentos de classificação de riscos pelo mercado financeiro.

As recomendações e as análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 3.922/10**, alterada pela **Resolução CMN 4.392/2014**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez e transparência.

Atenciosamente,

Igor França Garcia

Atuário MIBA/RJ – 1.659

Certificação Profissional ANBID CPA 10 e CPA - 20

Consultor de Valores Mobiliários credenciado pela CVM