

GESTÃO ECONÔMICA E FINANCEIRA 2014
RPPS PONTÃO

JUNHO 2014

RPPS PONTÃO

2014

**RELATÓRIO DE GESTÃO ECONÔMICA E
FINANCEIRA**

JUNHO

Expectativas de Mercado ¹								
Mediana - agregado	2014				2015			
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comportamento semanal*	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comportamento semanal*
IPCA (%)	6,46	6,48	6,44	▼ (1)	6,10	6,10	6,12	▲ (1)
IGP-DI (%)	5,50	5,04	4,49	▼ (11)	5,50	5,50	5,50	= (34)
IGP-M (%)	5,94	5,04	5,01	▼ (11)	5,50	5,61	5,55	▼ (1)
IPC-Fipe	6,04	5,69	5,56	▼ (3)	5,00	5,00	5,13	▲ (2)
Taxa de câmbio – fim de período (R\$/US\$)	2,40	2,39	2,35	▼ (2)	2,50	2,50	2,50	= (7)
Taxa de câmbio – média do período (R\$/US\$)	2,32	2,29	2,29	= (2)	2,46	2,45	2,45	= (2)
Meta Taxa Selic – fim de período (% a.a)	11,00	11,00	11,00	= (7)	12,00	12,00	12,00	= (8)
Meta Taxa Selic – média do período (%a.a)	10,91	10,91	10,91	= (7)	11,91	11,88	11,81	▼ (1)
Dívida Líquida do Setor Público (% do PIB)	34,65	34,80	34,85	▲ (1)	35,00	35,00	35,00	= (5)
PIB (% do crescimento)	1,16	1,05	0,97	▼ (8)	1,60	1,50	1,50	= (3)
Produção Industrial (% do crescimento)	-0,14	-0,90	-1,15	▼ (3)	2,30	1,80	1,70	▼ (4)
▲ Conta Corrente (US\$ Bilhões)	-80,00	-81,50	-81,50	▼ (2)	-75,00	-75,00	-74,10	▲ (1)
Balança Comercial (US\$ Bilhões)	2,00	2,01	2,00	▼ (2)	10,00	9,40	9,80	▲ (1)
Invest. Estrangeiro Direto (US\$ Bilhões)	60,00	60,00	60,00	= (15)	55,40	55,00	55,00	= (2)
Preços Administrados	5,00	5,00	5,00	= (1)	7,00	6,50	6,50	= (1)

*comportamento dos indicadores desde o último Relatório de Mercado; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento

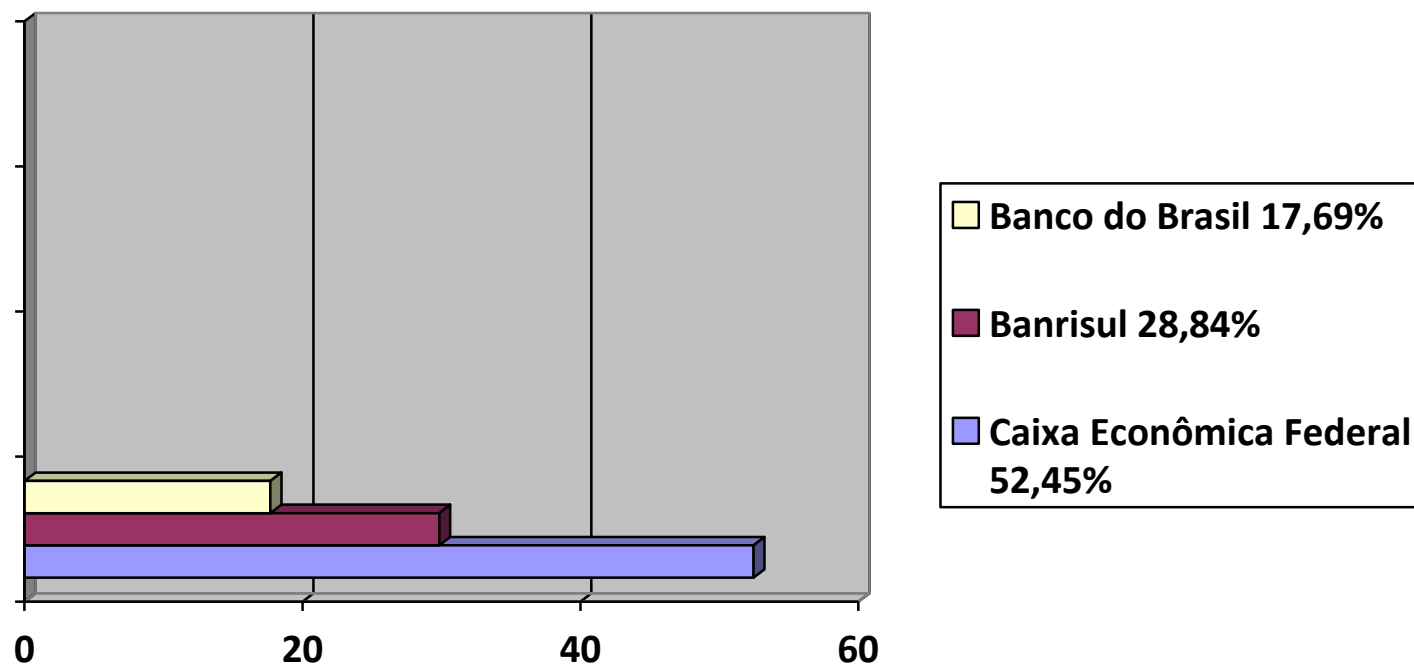
(▲ aumento, ▼ diminuição ou = estabilidade)

¹ BANCO CENTRAL DO BRASIL. Focus – Relatório de Mercado de 18 de julho de 2014. Disponível em: <http://www.bcb.gov.br/pec/GCI/PORT/readout/R20140718.pdf>. Acesso em julho 2014.

CARTEIRA DE INVESTIMENTO

ATIVOS	MAIO	JUNHO	%
FUNDOS DE RENDA FIXA	936558,87	9454127,36	99,67%
BB IRF-M1	924403,63	1006098,46	
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	667228,13	672721,49	
BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP	1338688,07	1346533,23	
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL III	912834,86	913480,01	
BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 24 – F.I.	307977,00	310704,00	
BANRISUL POUPANÇA	259516,11	228845,31	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	2407323,74	2406631,03	
FI BRASIL IRF-M 1	2489804,54	2511022,03	
CAIXA 25.251-4	0,00	58091,80	
CAIXA FI RS TP RF LP	57809,79	0,00	
SUB TOTAL	9365585,87	9454127,36	
CONTA CORRENTE	24403,90	31166,38	0,33%
BB 12116-9	0,00	0,00	
BANRISUL 04.013969.0-3 TAXA ADM	24403,90	26511,03	
BANRISUL 04.020450.0-4 FOLHA	0,00	4627,96	
CAIXA 006.00000046-6 INVESTIMENTOS	0,00	27,39	
CAIXA COMP FIN RGPS 006.00000051-2	0,00	0,00	
TOTAL	9389771,67	9485293,74	100%

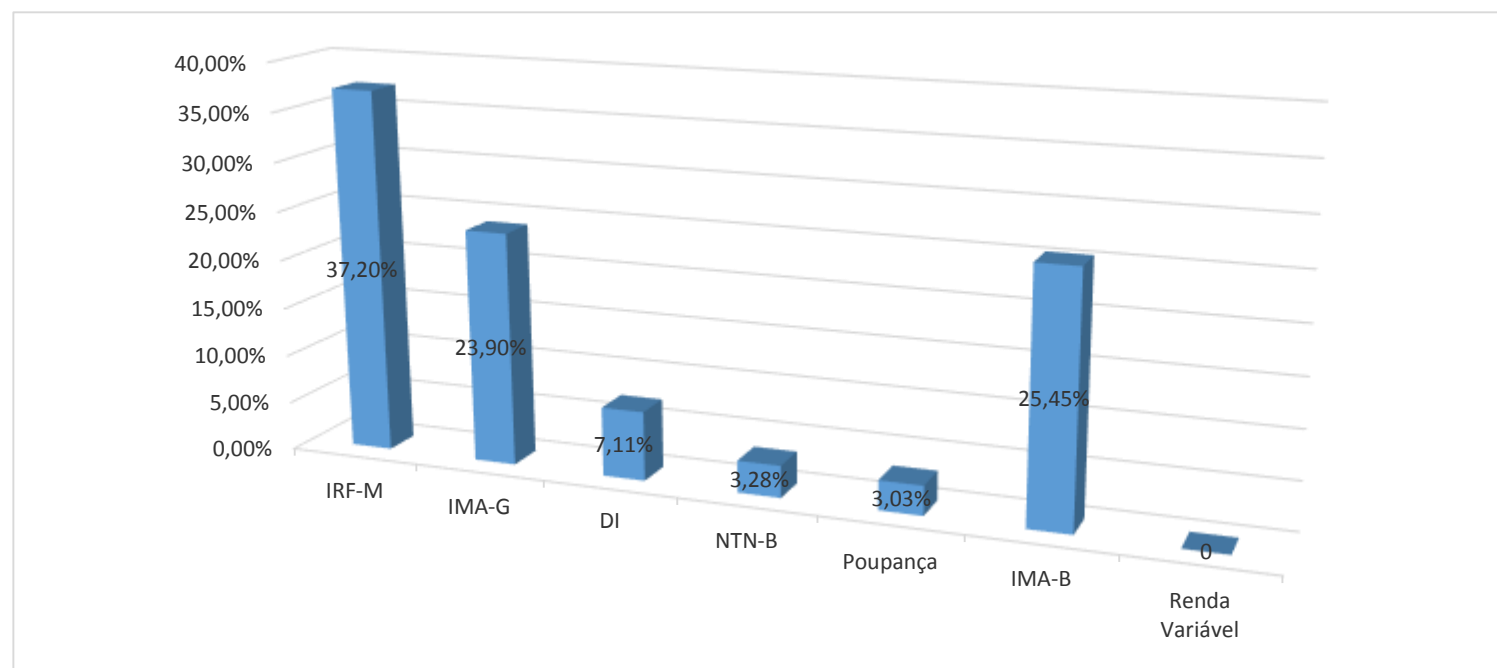
Distribuição por Instituição Financeira



Instituição Financeira

Banco do Brasil	1.678.819,95
Banrisul	2.830.701,54
Caixa Econômica Federal	4.975.772,25
Total	9.485.293,74

DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE



RENTABILIDADE

	ATIVOS							
FUNDOS DE RENDA FIXA	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2014	12 meses
BB RPPS RF IMA-B5+	-3,83%	5,48%						
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	0,80%	0,83%	0,77%	0,83%	1,31%	0,82%	5,06%	9,73%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1			0,75%	0,85%	1,52%	0,84%	4,88%	9,41%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP	-0,86%	2,62%	0,70%	1,57%	2,54%	0,58%	7,33%	8,61%
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL III	-2,27%	3,89%	0,79%	2,41%	4,06%	0,07%	9,14%	7,08%
BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 24 - F.I.			0,23%	1,35%	1,04%	0,88%	3,56%	3,56%
BANRISUL POUPANÇA			0,55%	0,54%	0,55%	0,56%	3,40%	6,69%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	-2,52%	4,36%	0,68%		4,30%	-0,02%	9,36%	6,46%
FI BRASIL IRF-M 1	0,35%	1,06%	0,75%	0,88%	0,94%	0,85%	4,95%	9,56%
CAIXA FI RS TP RF LP		0,88%	0,70%	0,81%	0,81%	0,81%	4,94%	9,60%

	BENCHMARKS								
PRINCIPAIS INDICADORES	JAN	FEV	MAR	ABRIL	MAIO	JUNHO	ANO	12 MESES	
IBOVESPA	-7,51%	-1,14%	7,05%	2,40%	-0,75%	3,76%	3,22%	12,00%	
IBrX	-8,15%	-0,31%	6,89%	2,88%	-1,12%	3,62%	3,01%	12,10%	
IMA GERAL	-0,88%	2,74%	0,64%	1,63%	2,52%	0,53%	7,40%	8,80%	
IMA B	-2,55%	4,43%	0,68%	2,42%	4,27%	0,06%	9,52%	6,90%	
IRF-M	-0,18%	2,17%	0,55%	1,28%	1,84%	0,92%	6,83%	10,00%	
CDI	0,84%	0,78%	0,76%	0,82%	0,86%	0,82%	5,70%	9,68%	
POUPANÇA	0,55%	0,61%	0,55%	0,55%	0,55%	0,56%	3,40%	6,69%	
SELIC	0,83%	0,77%	0,87%	0,82%	0,87%	0,82%	5,07%	10,38%	
IPCA	0,55%	0,69%	0,92%	0,67%	0,46%	0,40%	3,75%	6,52%	
INPC	0,63%	0,64%	0,82%	0,78%	0,60%	0,26%	3,79%	6,05%	
IGP-M	0,48%	0,38%	1,67%	0,78%	-0,13%	-0,74%	2,44%	6,24%	
META ATUARIAL(INPC+6%a.a.)	1,12%	1,13%	1,31%	1,27%	1,09%	0,75%	6,76%	12,06%	
META ATUARIAL	-1,88%	3,50%	0,68%	1,11%	1,49%	0,50%	6,04%		

SALDO E PERCENTUAL DE PARTICIPAÇÃO DOS FUNDOS – CLASSIFICAÇÃO CONFORME RESOLUÇÃO CMN 3922

ATIVOS	VALOR R\$	%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	672721,49	7,09%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	1006098,46	10,61%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP	1346533,23	14,20%
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL III	913480,01	9,63%
BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 24 – F.I.	310704,00	3,28%
BANRISUL POUPANÇA	228845,31	0,61%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	2406631,03	25,37%
FI BRASIL IRF-M 1	2511022,03	26,47%
CAIXA POUPANÇA	58091,80	2,41%
SUB TOTAL	9454127,36	99,67%
CONTA CORRENTE	31166,38	0,33%
TOTAL	9485293,82	100%

Classificação Res. CMN 3.922					Ativos	Fundo	Valor R\$	Valor R\$	%
ART. 7º	I	a	até 100%	0%	Títulos Tesouro Nacional - SELIC	TÍTULOS PÚBLICOS (Carteira Própria)			
		b	até 100%	90%	FI 100% Títulos TN	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP FI BRASIL IRF-M 1 CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	1006098,46 1346533,23 2511022,03 2406631,03	7270284,75	76,90%
	II		até 15%	0%	Operações Compromissadas				
	III		até 80%	10%	FI Renda Fixa/Referenciados RF	BANRISUL PREV MUNICIPAL III	913480,01	913480,01	9,66%
	IV		até 30%	15%	FI de renda fixa	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL BANRISUL PREV IPCA 24 – F.I.	672721,49 310704,00	983425,49	10,44%
	V		até 20%	5%	Poupança	BANRISUL POUPANÇA CAIXA POUPANÇA	228845,31 58091,80	286937,11	3,03%
	VI		até 15%	0%	FI em Direitos Creditórios - aberto				
	VII	a	até 5%	0%	FI em Direitos Creditórios - fechado				
		b	até 5%	0%	FI Renda Fixa "Crédito Privado"				
	I		até 30%	0%	FI/FIC em Ações indexados (Ibovespa, IBrX e IBR-X-50)				
	II		até 20%	0%	FI/FIC em Índices de Ações referenciados (exclusivamente Ibovespa, IBrX e IBR-X-50)				
	III		até 15%	0%	Outros FI/FIC em Ações				
	IV		até 5%	0%	FI / FIC Multimercado sem Alavancagem				
	V		até 5%	0%	FI em participações (fechados)				
	VI		até 5%	0%	FI imobiliário (em bolsa)				
	TOTAL							9454127,36	9454127,36

ACOMPANHAMENTO DAS APLICAÇÕES 2014

Janeiro 2014

	Saldo 31/12/2013	aplicações	resgates	rendimentos	Saldo
BB RPPS RF IMA-B5+	1076752,70		150.000,00	-36012,13	890740,57
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	329638,13	150000,00 21659,65		3901,36	505199,14
BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP	1254466,98			-10797,56	1243669,42
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL III	1229184,73			-27912,69	1201272,04
BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 24 - F.I.					
BANRISUL C/C	889,49				41507,32
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	3666314,46			-92677,40	3573637,06
FI BRASIL IRF-M I	936848,08			3383,43	1031258,81
CAIXA FI RS TP RF LP					
TOTAL	8494094,57	171659,65	150000,00	-160114,99	8487284,36

Fevereiro 2014

	Saldo 31/01/2014	aplicações	resgates	rendimentos	Saldo
BB RPPS RF IMA-B5+	890740,57		939597,87	48857,30	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	505199,14	948930,55		4203,54	1458333,23
BB C/C					19282,59
BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP	1243669,42			32638,98	1276308,40
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL III	1201272,04			46760,67	1248032,71
BANRISUL C/C	41507,32				1497,73
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	3573637,06		960,24 3723963,08	151286,26	0,00
FI BRASIL IRF-M I	1031258,81	3712826,32		13583,80	4757668,93
CAIXA FI RS TP RF LP	0,00	56702,03		127,52	56702,03
CAIXA C/C					11136,76
TOTAL	8487284,36	4718458,90	4664521,19	297458,07	8828962,38

Março 2014

	Saldo 28/02/2014	aplicações	resgates	rendimentos	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	0,00	875.000,00		2396,25	877396,25
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	1458333,23	19282,59	854403,30	9214,22	632426,74
BB C/C	19282,59				
BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP	1276308,40			8951,96	1285260,36
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL III	1248032,71		422000,00	2650,19	828682,90
BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 24 – F.I.	0,00	300000,00		696,00	300696,00
BANRISUL POUPANÇA	0,00	28312,77 21198,85 11581,07 61092,69 122000,00			183092,69
BANRISUL C/C	1497,73				20383,04
FI BRASIL IRF-M 1	4757688,93	11136,76	693,00	36035,54	4804148,23
CAIXA FI RS TP RF LP	56702,03		259,06	399,87	56842,84
CAIXA C/C	11136,76				
TOTAL	8828962,38	1449604,73	1277355,36	60344,03	8988929,05

Abril 2014

	Saldo 30/03/2014	aplicações	resgates	rendimentos	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	877396,25	23578,52		7533,58	884929,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	632426,74			5350,42	661355,68
BB C/C					
BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP	1285260,36			20252,88	1305513,24
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL III	828682,90		14000,00	19989,63	834672,53
BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 24 – F.I.	300696,00			4089,00	304785,00
BANRISUL POUPANÇA	183092,69	75535,95	38,56	175,85	258764,85
BANRISUL C/C	6,36				1315,98
FI BRASIL IRF-M 1	4804148,23			42496,14	4846644,37
CAIXA FI RS TP RF LP	56842,84			464,34	57307,18
CAIXA C/C					
TOTAL	8988929,05	99114,47	14038,56	100351,84	9155288,66

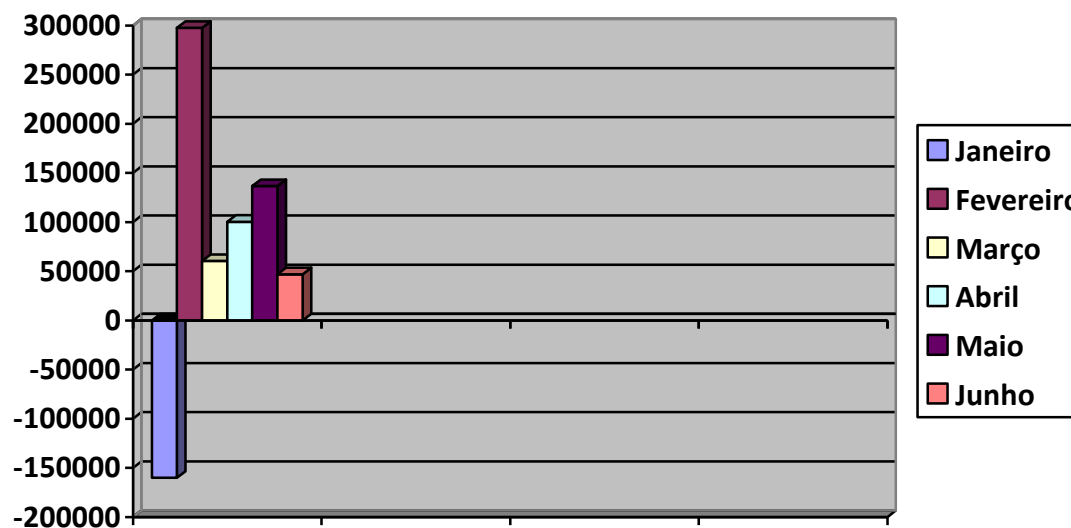
Maio 2014

	Saldo 30/04/2014	aplicações	resgates	rendimentos	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	884929,83	31176,65		8297,15	924403,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	661355,68			5872,45	667228,13
BB C/C					
BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP	1305513,24			33174,83	1338688,07
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL III	834672,53	44103,15		34059,18	912834,86
BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 24 – F.I.	304785,00			3192,00	307977,00
BANRISUL POUPANÇA	258764,85		-218,10	969,36	259516,11
BANRISUL C/C	1315,98				24403,90
FI BRASIL IRF-M 1	4846644,37		24000000,00	43160,17	2489804,54
CAIXA FI RS TP RF LP	57307,18			502,61	57809,79
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP		24000000,00		7323,74	2407323,74
CAIXA C/C					
TOTAL	9155288,66	24075279,80	23999781,90	136551,49	9389771,67

Junho 2014

	Saldo 30/05/2014	aplicações	resgates	rendimentos	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	924403,63	73802,29		7892,54	1006098,46
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	667228,13			5493,36	672721,49
BB C/C					
BANRISUL PATRIMONIAL FI RF LP	1338688,07			7845,16	1346533,23
BANRISUL PREVIDENCIA MUNICIPAL III	912834,86			645,15	913480,01
BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 24 – F.I.	307977,00			2727,00	310704,00
BANRISUL POUPANÇA	259516,11		32204,60	1533,80	228845,31
CAIXA POUPANÇA	0,00				58091,80
BANRISUL C/C	24403,90				26511,03
BANRISUL CONTA FOLHA					4627,96
FI BRASIL IRF-M 1	2489804,54			21217,49	2511022,03
CAIXA FI RS TP RF LP	57809,79		58119,19	309,40	0,00
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	2407323,74			-692,71	2406631,03
CAIXA C/C					27,39
TOTAL	9389771,67	73802,29	90323,79	46971,19	9485293,74

Rendimentos



Janeiro	-160.114,99
Fevereiro	297.458,07
Março	60.344,03
Abril	100.351,84
Mai	136.551,49
Junho	46.971,19
Total acumulado	481.562,44
Projeção atuarial 2014 (88,17%)	546.151,66

Fontes consultadas:

http://portal.anbima.com.br/informacoes-tecnicas/boletins/fundos-de-investimento/Documents/BoletimFI_201407.pdf

<http://portal.anbima.com.br/informacoes-tecnicas/Pages/default.aspx>

<http://www.bcb.gov.br/?FOCUS>

<http://www.portalbrasil.net/indices.htm>

<http://www.valor.com.br/valor-data/fundos>

Extratos bancários dos fundos.