

Assunto: Relatório de Atividades - Parcial

Data: 18 de Maio a 21 de Setembro/2018

Ente: Pouso Alegre - MG

Relatório de Atividades Desempenhadas.

- Recebimento dos extratos mensais dos investimentos referentes a carteira de aplicações do IPREM, desde Dezembro/2017;
- Impostação do histórico de aplicações e resgates efetivados pelo IPREM nos fundos de investimentos integrantes da carteira de aplicações;
- Disponibilização de relatórios via ferramenta WEB ON LINE denominada LIASYS GESTÃO DE INVESTIMENTOS, de acompanhamento e monitoramento da carteira de investimentos, em área restrita, com os seguintes módulos ON LINE:
- PRINCIPAIS MÓDULOS E FUNCIONALIDADES:

Visão Geral das carteiras - Posição Consolidada dos recursos, ativos e fundos integrantes da carteira de investimentos.

Comparação de Fundos - Amostra comparativa entre os fundos de investimentos de mercado.

Simulação Carteiras Ferramenta Simulação com base perfis de risco e retorno previamente definidos.

Elaboração de APR para formalização das operações de aplicação e resgates nos produtos e investimentos.

CADPREV - Relatório de acompanhamento dos investimentos (DPIN & DAIR).

Detalhamento Fundos Portfolio de fundos de investimentos mediante link de acesso à base de dados CVM.

Enquadramento Legal Acompanhamento da carteira com tabelas e gráficos aos limites da legislação e do DPIN.

Monitoramento Risco Relatório consolidado com indicadores de desempenho e risco dos investimentos.

Credenciamento de Instituições Financeiras, Administradores, Gestores e Fundos.

Atribuição Desempenho Identificação dos melhores fundos e índices para aplicação dos recursos.

Solvência e Liquidez Simulação do nível de utilização do fluxo de caixa do RPPS ao longo do tempo.

Pareceres Técnicos Área restrita com divulgação dos pareceres técnicos sobre os investimentos.

Relatório de Atividades Desempenhadas.

- Demais Relatórios Fornecidos:
 - a) Desempenho das Carteiras de Investimento Consolidadas;
 - b) Comentário Econômico;
 - c) Dados de Mercado e Ranking de Fundos;
 - d) Movimentações Financeiras;
 - e) Monitoramento de Riscos;
 - f) Lâminas Resumo.

- Visitas técnicas realizadas na cidade de Pouso Alegre nos meses de julho e setembro. Contato com técnicos do Ipem e com Sr. Secretário de Fazenda do Município;
- Cálculo de métricas de acompanhamento das aplicações, com ênfase no retorno, risco, liquidez e enquadramento, de acordo com a legislação vigente;
- Análise e diagnóstico dos investimentos dos recursos em moeda corrente que integram a carteira do RPPS, com base na posição dos investimentos (extratos);
- Fornecimento de mapa dos fundos de investimentos ilíquidos e a identificação de características e informações sobre os prestadores de serviços, ativos integrantes das carteiras de tais fundos, custos de taxa de administração e desempenho (performance), relatórios de auditoria e demais regras técnicas e regulamentares dos referidos fundos;
- Fornecimento de relatório fundamentalista com a identificação do “modus operandi” utilizado como diretriz para alocação em fundos com característica de iliquidez;
- Elaboração de comentário econômico com estabelecimento de cenários futuros para a alocação dos recursos;
- Estabelecimento de sugestões de realocação das carteiras para o mês em curso, em especial por conta do cenário eleitoral que se avizinha;
- Emissão de relatórios sobre a carteira de investimentos com periodicidade mensal e trimestral;
- Elaboração de relatório comparativo de rentabilidade histórica dos fundos integrantes da carteira do IPREM e comparativo com o mercado de fundos de investimentos, com envio para o Sr. Interventor;
- Acompanhamento da carteira própria de títulos públicos federais, com marcação de preços fornecidos pelo custodiante e pelo mercado secundário de títulos (portal Anbima);
- Elaboração de minuta da Política de investimentos 2019, DPIN – Demonstrativo da Política de Investimento e auxílio mensal na elaboração do DAIR – Demonstrativo das Aplicações e Investimentos dos Recursos;
- Participação em Assembleia Geral de Cotistas - AGC, na cidade de São Paulo para os seguintes fundos de Investimentos: Fundo de Investimento Multimercado Sculptor Crédito Privado; Fundo de Investimento Barcelona INX Renda Fixa; Aquilla Fundo de Investimento Imobiliário; Illuminati Fundo de Investimento

Relatório de Atividades Desempenhadas.

em Direitos Creditórios – 02 (duas) assembleias; Fundo de Investimento de Renda Fixa Pyxis Institucional IMA-B (reunião técnica);

- Assessoria e discussão prévia com Sr. Interventor para envio de votos de deliberação em Assembleia Geral de Cotistas – AGC, a exemplo dos fundos Fundo de Investimento Sicília Renda Fixa LP; Singapore Fundo de Investimento Renda Fixa; Fundo de Investimentos Participações Multiestratégia LA Shopping Centers; GGR PRIME I Fundo de Investimento em Direitos Creditórios; Fundo de Investimento Recuperação Brasil Renda Fixa LP; Conquest FIP;
- Auxílio da elaboração de notificação extrajudicial em contraponto a nota de débito encaminhada pelo Administrador do Fundo CAM THRONE FIP a título de cobrança de despesas ordinárias. Obtenção de ofício da CVM – Comissão de Valores Mobiliários que determinava a proibição de qualquer aporte em fundos de investimentos a títulos de pagamento de despesas;
- Reunião técnica realizada em Brasília (DF) no dia 02 de agosto, junto a técnicos da Secretaria de Previdência acerca de alternativas de desinvestimento para o Fundo de Investimento Pyxis Institucional IMA-B, com a conseqüente liberação de parcelas dos recursos para os cotistas do referido fundo, dentre os quais, o IPREM (item aguardando resposta de ofício por parte da Secretaria de Previdência);
- Atuações junto aos demais cotistas dos fundos de investimento Pyxis Institucional IMA-B e Illuminati Fundo de Investimento em Direitos Creditórios para angariar votos suficientes em assembleia geral de cotistas, cuja pauta consistia na substituição de prestador de serviços de Gestão para os fundos de Investimentos;
- Identificação de algumas operações realizadas dentro dos fundos de investimentos ilíquidos e fornecimento ao IPREM de documentos comprobatórios de tais operações;
- Identificação de operações irregulares e ativos vedados integrantes da carteira de fundo de investimento (Exemplo: Fundo de Investimento Barcelona INX);
- Estabelecimento, em conjunto com Sr. Interventor e técnicos do IPREM de nova filosofia para a carteira de investimentos, com implantação de melhores práticas de gestão dos pilares da teoria de investimentos: risco versus retorno versus liquidez;
- Definição de processo técnico de análise e seleção de fundos de investimento, com prestadores de serviços reconhecidamente como de primeiríssima linha, com diversificação da carteira em estratégias seguras, líquidas e aderentes ao perfil previdenciário. Exemplos: ITAU Alocação Dinâmica II Renda Fixa; CAIXA Brasil Gestão Estratégica Renda Fixa e BB Previdenciário Renda Fixa Alocação Ativa;
- Contatos periódicos remotos via correio eletrônico, telefone e aplicativo entre os técnicos do Iprem e da Consultoria, para sanar dúvidas e prestar esclarecimentos.



DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA

CNPJ 03.866.812/0001-02