

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
JANEIRO DE 2018



As informações utilizadas neste relatório de gestão de investimento são obtidas pelos extratos oficiais das instituições financeiras em que o RPPS aloca seus recursos.

Este Relatório visa a fornecer informações resumidas aos órgãos fiscalizadores, aos segurados e pensionistas da Guarujá Previdência e à população, em geral.

Este relatório contém, a composição atual da carteira do Instituto relatando a sua rentabilidade consolidada e detalhada por ativo, a comparação com a meta atuarial e seu enquadramento em relação à Resolução 3.922/2010 e alterações do Conselho Monetário Nacional.

• **Composição da Carteira da Guarujá Previdência – Janeiro de 2018**

PRODUTO / FUNDO	DISP. RESGATE	CARÊNCIA	SALDO	PARTICIP. S/ TOTAL	QTDE. COTISTA	% S/ PL DO FUNDO	RESOLUÇÃO - 3.922 / 4.392 / 4.604
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	8.453.875,75	2,20%	220	29,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.968.817,45	5,19%	70	25,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	4.397.478,43	1,14%	700	8,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	5.802.473,24	1,51%	11	6,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	27.975.933,10	7,27%	234	5,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.641.970,53	0,69%	1.083	4,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	2.016.746,67	0,52%	179	3,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	16.468.084,32	4,28%	2.694	3,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.912.916,88	0,76%	771	3,49%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	24.354.016,23	6,33%	56	3,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	4.351.620,40	1,13%	15	3,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	1.531.025,39	0,40%	18	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.194.638,12	1,35%	18.553	2,28%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.398.962,35	0,88%	46	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	21.984.395,83	5,71%	346	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	21.101.027,40	5,48%	648	1,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.803.005,46	0,47%	43	1,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	3.712.744,14	0,96%	26	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.949.699,45	5,18%	101	1,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	12.330.894,00	3,20%	90	1,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.601.694,23	4,05%	167	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.779.972,76	1,76%	94	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULT	D+2	Não há	1.121.457,03	0,29%	1.279	1,26%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.486.850,96	4,54%	63	1,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.242.691,58	0,84%	52	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.524.338,00	0,66%	100	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.747.500,00	0,45%		0,95%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	10.889.721,21	2,83%	100	0,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RF CRÉD PRIV	D+91	Não há	568.048,85	0,15%	2	0,88%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.417.819,46	0,89%	60	0,79%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	2.536.998,54	0,66%	193	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.523.652,46	0,40%	36	0,68%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.834.585,15	1,78%	72	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.261.094,49	1,11%	261	0,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.865.517,31	1,78%	13.704	0,50%	Artigo 8º, Inciso III

BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	19.113.251,23	4,96%	590	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	12.724.578,32	3,30%	223	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.665.410,58	0,43%	3.921	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	22.332.800,15	5,80%	707	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.322.026,52	0,34%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	961.064,38	0,25%	79	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.059.536,99	0,53%	122	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.367.007,67	0,61%	107	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.778.826,14	1,24%	309	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.059.559,43	0,53%	197	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.125.914,67	0,29%	5.328	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.060.683,07	1,83%	625	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.999.657,50	0,52%	163	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	563.741,18	0,15%	4.570	0,15%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.179.033,32	1,35%	1.403	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	666.399,51	0,17%	853	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.092.761,04	0,54%	736	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.201.807,90	0,31%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
			385.026.326,77				

• **Comparação com a Meta Atuarial – Janeiro de 2018**

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO NO MÊS	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	META (%)	GAP (%)	VAR (%)
JANEIRO	370.364.777,04	6.417.082,30	753.770,54	385.026.326,77	8.998.237,97	2,39%	0,74%	322,87%	1,72%
					8.998.237,97	2,39%	0,74%	322,87%	

- **Enquadramento – Janeiro 2018**

ARTIGOS - RENDA FIXA	RESOLUÇÃO%	CARTEIRA\$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2018			GAP SUPERIOR
				INFERIOR%	ALVO %	SUPERIOR %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	167.189.387,07	43,42%	30,00%	45,00%	70,00%	102.329.041,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0	0,00%	15,00%	15,00%	60,00%	231.015.796,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	152.066.496,84	39,50%	5,00%	10,00%	30,00%	-36.558.598,81
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	57.753.949,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	19.251.316,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.073.947,49	1,84%	2,00%	2,50%	5,00%	12.177.368,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.251.316,34
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	326.329.831,40	84,76%	59,00%	89,50%	190,00%	
ARTIGOS - RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO%	CARTEIRA\$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2018			GAP SUPERIOR
				INFERIOR%	ALVO %	SUPERIOR %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	5.194.638,12	1,35%	0,00%	2,00%	2,00%	2.505.888,42
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	41.041.922,55	10,66%	5,00%	13,00%	20,00%	35.963.342,80
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.510.626,80	2,47%	1,00%	4,00%	5,00%	9.740.689,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.201.807,90	0,31%	1,00%	3,00%	5,00%	18.049.508,44
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.747.500,00	0,45%	1,00%	3,00%	5,00%	17.503.816,34
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	58.696.495,37	15,24%	8,00%	25,00%	37,00%	
TOTAL CARTEIRA		385.026.326,77	100,00%				