

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
FEVEREIRO 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 – Fevereiro de 2018**

PRODUTO / FUNDO	DISPONIBILIDADE RESGATE	CARÊNCIA	SALDO	PARTICIP. S/ TOTAL	QTDE. COTISTAS	% S/ PL DO FUNDO	RESOLUÇÃO - 3.922 / 4.392 / 4.604
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RF	D+2	Não há	4.420.980,72	1,13%	717	8,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RF	D+3	Não há	2.025.577,20	0,52%	214	3,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	D+0	Não há	7.100.674,68	1,81%	632	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RF PREV	D+0	15/08/2022	1.293.321,90	0,33%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	D+0	Não há	22.451.560,41	5,73%	716	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.655.480,82	0,68%	1.043	4,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.252.461,44	3,89%	167	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	22.099.044,47	5,64%	347	1,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	1.498.574,40	0,38%	18	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	10.608.265,03	2,71%	99	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	12.415.277,54	3,17%	223	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.261.055,70	0,83%	52	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.321.376,70	0,59%	107	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	2.472.154,51	0,63%	192	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	19.214.462,00	4,91%	587	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.326.888,44	0,85%	46	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.694.573,74	1,71%	72	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	5.821.904,07	1,49%	11	6,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.640.095,10	1,70%	94	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TP FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.074.511,23	0,53%	203	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	3.633.440,36	0,93%	26	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TP IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.012.901,89	0,51%	122	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.958.013,00	0,50%	163	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.834.710,55	1,23%	321	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	671.452,50	0,17%	922	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.023.103,60	2,81%	70	16,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.101.989,16	0,54%	733	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RF	D+5	Não há	21.456.665,60	5,48%	100	2,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RF REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.214.656,89	1,33%	1.395	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	22.340.416,82	5,70%	655	1,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	24.544.855,59	6,27%	57	2,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	966.561,31	0,25%	81	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	37.744.637,24	9,64%	239	6,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	D+1	Não há	17.615.476,82	4,50%	63	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	20.058.999,73	5,12%	99	1,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.437.716,71	0,88%	60	0,79%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
WESTERN ASSET CRÉDITO CORP FI RF CRÉD PRIVADO	D+91	Não há	570.253,20	0,15%	2	0,88%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.534.972,40	0,65%	100	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	566.562,06	0,14%	4.658	0,15%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.208.810,26	1,07%	260	0,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.365.869,27	1,11%	853	5,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	16.507.252,24	4,21%	3.321	3,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.117.081,28	0,29%	7.189	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.738.993,03	0,44%	43	1,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	4.319.776,79	1,10%	15	3,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.690.157,09	0,43%	4.335	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.541.340,63	0,39%	34	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.317.945,63	1,10%	1.921	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.639.809,74	1,70%	13.782	0,51%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROT IBOV CÍCLICO I FIC MULTIM	D+2	Não há	1.126.362,59	0,29%	1.263	1,27%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	4.270.147,16	1,09%	20	1,04%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.228.700,31	0,31%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.707.000,00	0,44%		0,95%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
			391.714.871,55				

- Comparação com a Meta Atuarial – Fevereiro 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%
FEVEREIRO	385.026.326,77	42.232.155,15	36.739.594,47	391.714.871,55	1.195.984,10	0,31%	0,60%	51,23%	2,11%
TOTAL					10.194.222,07	2,71%	1,34%	201,47%	

- Enquadramento – Fevereiro 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%	166.087.305,90	42,40%	30,00%	45,00%	70,00%	108.113.104,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0	0,00%	15,00%	15,00%	60,00%	235.028.922,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	163.738.815,26	41,80%	5,00%	10,00%	30,00%	-46.224.353,80
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	58.757.230,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	19.585.743,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.109.504,37	1,81%	2,00%	2,50%	5,00%	12.476.239,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.585.743,58
Total Renda Fixa	100,00%	336.935.625,53	86,02%	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%	0	0,00%	0,00%	2,00%	2,00%	7.834.297,43
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	33.947.939,96	8,67%	5,00%	13,00%	20,00%	44.395.034,35
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	17.895.605,75	4,57%	1,00%	4,00%	5,00%	1.690.137,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.228.700,31	0,31%	1,00%	3,00%	5,00%	18.357.043,27
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.707.000,00	0,44%	1,00%	3,00%	5,00%	17.878.743,58
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	54.779.246,02	13,98%	8,00%	25,00%	37,00%	
TOTAL		391.714.871,55					