

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
MARÇO 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 – Março de 2018**

PRODUTO / FUNDO	DISP RESGATE	CARÊNCIA	SALDO	PARTICIP. S/ TOTAL	QTDE. COSTISTAS	% S/ PL DO FUNDO	RESOLUÇÃO - 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	D+0	Não há	22.810.690,90	5,70%	729	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.445.520,49	3,86%	167	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TPF FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	19.386.867,62	4,84%	590	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF	D+1	Não há	22.453.912,58	5,61%	346	1,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	15/08/2030	1.509.410,49	0,38%	18	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	10.669.223,49	2,67%	99	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	15/08/2018	12.486.759,32	3,12%	223	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	16/08/2020	2.359.396,08	0,59%	107	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	2.486.308,81	0,62%	192	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.394.994,85	0,85%	46	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	16/08/2018	1.972.353,00	0,49%	163	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	15/08/2024	6.841.281,47	1,71%	72	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+1	15/05/2019	5.880.113,70	1,47%	11	6,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.772.803,69	1,69%	94	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	D+0	Não há	9.102.049,02	2,27%	203	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	15/08/2030	3.659.785,24	0,91%	26	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.681.004,79	0,67%	1.005	4,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TP IPCA II FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.035.048,07	0,51%	122	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TP IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.326.669,09	0,83%	52	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP	D+0	Não há	7.208.318,85	1,80%	639	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TP IPCA IV FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.302.729,93	0,33%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.897.469,89	1,22%	343	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA LONGO FI RF	D+2	Não há	4.435.903,49	1,11%	736	4,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	2.057.291,12	0,51%	246	4,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RF	D+1	Não há	24.792.821,45	6,19%	57	2,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RF	D+5	Não há	21.677.309,31	5,42%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	22.439.472,24	5,61%	661	1,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	677.415,17	0,17%	1.021	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	D+0	Não há	11.391.243,22	2,85%	250	2,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	D+1	Não há	17.796.525,64	4,45%	63	1,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RF	D+1	Não há	20.253.513,21	5,06%	99	1,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.121.390,90	2,78%	70	15,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RF REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.491.617,46	2,37%	1.388	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	D+1	Não há	982.519,85	0,25%	83	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.112.814,18	0,53%	722	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RF PREV CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.499.920,92	0,87%	60	0,79%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	1.570.920,93	0,39%	4.770	0,39%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
WESTERN ASSET CRÉDITO CORP FI RF CRÉD PRIVADO	D+91	Não há	573.279,61	0,14%	2	0,88%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉD PRIV	D+0	3 anos	2.550.002,40	0,64%	100	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	20.682.349,93	5,17%	4.799	3,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.121.852,68	0,28%	7.475	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.705.172,94	0,43%	43	1,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.525.938,37	1,88%	4.931	1,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.048.925,74	2,01%	253	1,49%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	4.380.013,90	1,09%	16	3,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.136.935,01	1,53%	943	7,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEG IBOV CÍCLICO I FIC MULTIM	D+2	Não há	1.132.135,86	0,28%	1.248	1,27%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTI	D+1	Não há	6.456.134,94	1,61%	13.215	0,54%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	4.153.438,93	1,04%	21	1,05%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTI	D+5	Não há	3.553.726,04	0,89%	35	1,50%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTI	D+1	Não há	6.342.291,04	1,58%	2.042	0,27%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.222.008,41	0,31%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.740.000,00	0,43%		0,95%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL			400.307.596,26				

• **Comparação com a Meta Atuarial – Março 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%
MARÇO	391.714.871,55	38.732.327,38	33.972.525,88	400.307.596,26	3.832.923,21	0,97%	0,56%	173,53%	1,70%
					14.027.145,28	3,70%	1,91%	193,89%	

• **Enquadramento – Março 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%	175.175.905,98	43,76%	30,00%	45,00%	70,00%	105.039.411,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0	0,00%	15,00%	15,00%	60,00%	240.184.557,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	142.736.642,63	35,66%	5,00%	10,00%	30,00%	-22.644.363,75
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	60.046.139,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	20.015.379,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	8.194.123,86	2,05%	2,00%	2,50%	5,00%	11.821.255,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.015.379,81
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	326.106.672,47	81,46%	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%	8.006.151,93
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	49.601.188,57	12,39%	5,00%	13,00%	20,00%	30.460.330,68
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	21.637.726,81	5,41%	1,00%	4,00%	5,00%	-1.622.347,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.222.008,41	0,31%	1,00%	3,00%	5,00%	18.793.371,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.740.000,00	0,43%	1,00%	3,00%	5,00%	18.275.379,81
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	74.200.923,79	18,54%	8,00%	25,00%	37,00%	
TOTAL		400.307.596,26	100,00%				