

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
ABRIL 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 – Abril 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 2024 IV TP FI RF | D+0 | 15/08/2024 | 6.821.516,05 | 1,67% | 72 | 0,67% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TP FI RF LP | D+0 | Não há | 9.125.787,30 | 2,24% | 204 | 0,77% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TP X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2024 | 6.788.471,16 | 1,66% | 94 | 1,32% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP | D+0 | Não há | 7.264.789,77 | 1,78% | 654 | 0,14% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL TP FI RENDA FIXA | D+1 | 15/05/2019 | 5.903.117,55 | 1,45% | 11 | 6,44% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2018 I TP FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2018 | 1.985.503,50 | 0,49% | 163 | 0,15% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 13.934.095,58 | 3,42% | 371 | 0,37% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SANTANDER IMA-B 5 TP FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 29.456.410,54 | 7,22% | 337 | 2,26% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA-B TP FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 19.357.715,54 | 4,75% | 589 | 0,46% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 2.674.569,31 | 0,66% | 961 | 6,33% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TP IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2020 | 2.048.722,43 | 0,50% | 122 | 0,24% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RF | D+1 | Não há | 20.216.482,94 | 4,96% | 94 | 1,46% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2030 III TP FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2030 | 3.647.603,69 | 0,89% | 26 | 1,43% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BTG PACTUAL TESOUREO IPCA LONGO FI RF | D+2 | Não há | 4.407.052,14 | 1,08% | 702 | 3,63% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 26.409.860,84 | 6,48% | 742 | 0,33% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TP IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 16/05/2023 | 3.325.648,42 | 0,82% | 52 | 1,12% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+3 | Não há | 2.064.503,38 | 0,51% | 293 | 4,33% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TP IPCA IV FI RFPREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 1.311.359,98 | 0,32% | 116 | 0,26% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TP VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 15.534.080,79 | 3,81% | 167 | 1,33% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TP FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2020 | 2.381.302,02 | 0,58% | 107 | 0,24% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2018 II TP FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2018 | 12.538.586,46 | 3,07% | 223 | 0,39% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2030 II TP FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2030 | 1.504.362,75 | 0,37% | 18 | 2,73% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TP XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 18/08/2018 | 10.713.446,84 | 2,63% | 99 | 0,97% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TP XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 3.401.491,57 | 0,83% | 46 | 1,87% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TP IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2018 | 2.496.612,45 | 0,61% | 192 | 0,70% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5 | D+1 | Não há | 4.486.323,08 | 1,10% | 84 | 0,80% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RF | D+5 | Não há | 23.750.582,14 | 5,82% | 119 | 1,73% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF | D+1 | Não há | 17.854.492,90 | 4,38% | 61 | 1,19% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 15.533.890,29 | 3,81% | 654 | 1,29% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 9.101.980,16 | 2,23% | 70 | 13,33% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF | D+0 | Não há | 2.778.625,56 | 0,68% | 257 | 0,56% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RF | D+1 | Não há | 24.857.540,80 | 6,10% | 57 | 2,73% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 2.123.591,20 | 0,52% | 711 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| SANTANDER CORP FIC RF REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 2.115.499,02 | 0,52% | 1.387 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 681.094,69 | 0,17% | 1.136 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB IPCA III FI RF PREV CRÉDITO PRIVADO | D+30 ou D+30 a D+2880 | Não há | 3.516.604,95 | 0,86% | 67 | 0,76% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| WESTERN ASSET CRÉD CORP FI RF CRÉD PRIV | D+91 | Não há | 573.875,31 | 0,14% | 2 | 0,88% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RF CRÉD PRIV | D+0 | 3 anos | 2.561.166,00 | 0,63% | 90 | 1,22% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| RIO BRAVO FI RF CRÉDITO PRIVADO | D+1 | Não há | 1.579.155,98 | 0,39% | 4.945 | 0,44% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES | D+3 | Não há | 2.400.000,00 | 0,59% | 56 | 1,85% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " |

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

| | | | | | | | |
|--|---------------|---------------|-----------------------|-------|--------|-------|------------------------------------|
| SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 1.133.938,60 | 0,28% | 7.077 | 0,15% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 8.147.092,96 | 2,00% | 237 | 1,66% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 7.606.180,94 | 1,87% | 5.485 | 1,21% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES | D+4 | Não há | 4.449.026,43 | 1,09% | 16 | 2,84% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES | D+33 | Não há | 6.017.012,90 | 1,48% | 961 | 7,63% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC AÇÕES | D+4 ou D+33 | Não há | 20.482.078,20 | 5,02% | 5.211 | 3,26% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BB PIPE FIC AÇÕES | D+4 | 03/06/2018 | 1.665.752,14 | 0,41% | 43 | 1,47% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIM | D+1 | Não há | 6.362.069,31 | 1,56% | 2.128 | 0,25% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA CAPITAL PROTEG IBOV CÍCLICO I FIC MULTIM | D+2 | Não há | 1.136.096,62 | 0,28% | 1.232 | 1,28% | Artigo 8º, Inciso III |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIM | D+1 | Não há | 6.494.173,34 | 1,59% | 11.970 | 0,59% | Artigo 8º, Inciso III |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIM | D+5 | Não há | 3.595.790,20 | 0,88% | 35 | 1,43% | Artigo 8º, Inciso III |
| SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO | D+2 | Não há | 4.177.629,35 | 1,02% | 21 | 1,14% | Artigo 8º, Inciso III |
| LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP | Não se aplica | Não se aplica | 4.525.668,58 | 1,11% | | 0,00% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | Não se aplica | Não se aplica | 1.215.276,19 | 0,30% | | 0,00% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII | Não se aplica | Não se aplica | 1.575.000,00 | 0,39% | | 0,95% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " |
| | | | 407.810.300,84 | | | | |

- Comparação com a Meta Atuarial – Abril 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% |
| Abril | 400.307.596,26 | 41.895.584,70 | 36.681.846,96 | 407.810.300,84 | 2.288.966,84 | 0,56% | 0,70% | 80,89% | 1,56% |
| | | | | | 16.316.112,12 | 4,28% | 2,62% | 163,60% | |

- **Enquadramento – Abril de 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% | 215.313.093,00 | 52,80% | 30,00% | 45,00% | 70,00% | 70.154.117,59 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00% | 0 | 0,00% | 15,00% | 15,00% | 60,00% | 244.686.180,50 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 40,00% | 103.283.619,84 | 25,33% | 5,00% | 10,00% | 30,00% | 19.059.470,41 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a " | 15,00% | 0 | 0,00% | 7,00% | 15,00% | 15,00% | 61.171.545,13 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 0 | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 20.390.515,04 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 8.230.802,24 | 2,02% | 2,00% | 2,50% | 5,00% | 12.159.712,80 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c " | 5,00% | 0 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 20.390.515,04 |
| TOTAL RENDA FIXA | 100,00% | 326.827.515,08 | 80,14% | 59,00% | 89,50% | 190,00% | |
| ARTIGOS - VARIÁVEL | RESOLUÇÃO % | CARTEIRA \$ | CARTEIRA % | ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2018 | | | GAP SUPERIOR |
| | | | | INFERIOR | ALVO | SUPERIOR | |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " | 30,00% | 2.400.000,00 | 0,59% | 0,00% | 2,00% | 2,00% | 5.756.206,02 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 20,00% | 49.501.082,17 | 12,14% | 5,00% | 13,00% | 20,00% | 32.060.978,00 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 21.765.758,82 | 5,34% | 1,00% | 4,00% | 5,00% | -1.375.243,78 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 5,00% | 5.740.944,77 | 1,41% | 1,00% | 3,00% | 5,00% | 14.649.570,27 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 5,00% | 1.575.000,00 | 0,39% | 1,00% | 3,00% | 5,00% | 18.815.515,04 |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | 30,00% | 80.982.785,76 | 19,86% | 8,00% | 25,00% | 37,00% | |
| TOTAL | | 407.810.300,84 | | | | | |