

**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 "
			<b>407.810.300,84</b>				

- **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	<b>407.810.300,84</b>	2.288.966,84	0,56%	0,70%	80,89%	1,56%
					<b>16.316.112,12</b>	<b>4,28%</b>	<b>2,62%</b>	<b>163,60%</b>	

- **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
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>100,00%</b>	<b>326.827.515,08</b>	<b>80,14%</b>	<b>59,00%</b>	<b>89,50%</b>	<b>190,00%</b>	
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
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>30,00%</b>	<b>80.982.785,76</b>	<b>19,86%</b>	<b>8,00%</b>	<b>25,00%</b>	<b>37,00%</b>	
<b>TOTAL</b>		<b>407.810.300,84</b>					