

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

MAIO 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 – Maio de 2018**

SEGREGAÇÃO	FUNDOS DE INVESTIMENTOS	SALDO FINAL	ARTIGO
FUNDO FINANCEIRO	AZQUEST SMALL CAPS	8.061.186,21	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	AZQUEST SMALL CAPS	4.400.294,03	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	BB AÇÕES PIPE FI EM COTAS DE FI	939.418,33	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB AÇÕES PIPE FI EM COTAS DE FI	531.306,89	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FEM COTAS FI	7.385.447,82	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FEM COTAS FI	3.280.666,67	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TP	12.238.984,60	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TP	6.505.864,59	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	FI TITULOS PÚBLICOS IPCA II	2.048.853,82	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	BB PREVIDENCIÁRIO IPCA III	1.110.846,40	artigo 7 Inciso VII, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB PREVIDENCIÁRIO IPCA III	2.360.259,38	artigo 7 Inciso VII, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA IV	797.517,96	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA IV	522.876,01	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA VII	10.568.837,49	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA VII	4.886.778,06	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA IX	1.687.834,60	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA IX	828.600,50	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA X	4.219.716,14	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA X	2.402.506,44	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XI	2.094.309,23	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XI	1.212.494,82	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA XII	7.343.303,46	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA XII	3.455.672,21	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	FI TITULOS PÚBLICOS IPCA	3.136.756,28	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	ACTION FIC FIA	3.861.395,45	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	ACTION FIC FIA	3.586.487,04	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	FI RENDA FIXA IMA-B	11.395.627,00	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	FI RENDA FIXA IMA-B	8.149.712,38	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	FI RF IMA GERAL FI	14.468.796,33	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	FI RF IMA GERAL FI	9.993.345,02	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.370.779,34	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.038.518,71	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	IBOVESPA PLUS	1.286.625,02	artigo 8 Inciso I, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	IBOVESPA PLUS	851.765,99	artigo 8 Inciso I, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	DIVIDENDOS FIQ FIA	3.245.821,38	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	DIVIDENDOS FIQ FIA	2.104.509,35	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	FIQ FI AÇÕES ABSOLUTO	11.356.132,22	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	FIQ FI AÇÕES ABSOLUTO	7.273.008,80	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"

**PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES
DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ**

FUNDO FINANCEIRO	TESOURO IPCA LONGO RF	2.551.390,85	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	TESOURO IPCA LONGO RF	1.650.128,02	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	TIMBER FIQ FIP	1.208.379,40	artigo 8 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	1.332.853,00	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	666.426,50	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA BRASIL 2018 II TP RF	7.747.062,00	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA BRASIL 2018 II TP RF	4.891.812,96	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA BRASIL 2020 IV TP RF	1.433.490,44	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA BRASIL 2020 IV TP RF	928.497,43	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	3.623.100,30	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	2.972.138,02	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	873.671,40	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	571.789,76	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA BRASIL 2030 III TP RF	2.127.085,45	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA BRASIL 2030 III TP RF	1.377.751,34	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA FI BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	3.377.910,96	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA FI BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	2.155.171,70	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	5.772.880,72	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	3.216.725,14	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADE RF	1.529.524,82	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADE RF	717.130,03	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	16.814.382,26	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	9.176.342,95	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	9.146.136,25	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	4.521.321,64	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	1.281.413,31	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	852.799,38	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	CAIXA FIC CAPITAL PROT IBOV CÍCLICO	684.069,82	artigo 8 Inciso III
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	CAIXA FIC CAPITAL PROT IBOV CÍCLICO	456.046,55	artigo 8 Inciso III
FUNDO FINANCEIRO	FI CXBR IDKA 2A	5.638.244,72	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	FI CXBR IDKA 2A	4.109.322,07	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	RIO BRAVO FUNDO IMOBILIÁRIO	1.557.000,00	artigo 8 Inciso IV, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	FUNDO RF IMA B5	1.255.872,82	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	FUNDO RF IMA B5	775.125,77	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	JURO REAL IMA-B RF LP	1.557.787,94	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	JURO REAL IMA-B RF LP	1.019.865,41	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	LA SHOPPING CENTER	4.519.171,56	artigo 8 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	10.661.227,28	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	7.131.378,30	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	ALOCAÇÃO DINÂMICA II	14.302.907,63	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	ALOCAÇÃO DINÂMICA II	9.529.838,95	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	FUNDO ITAÚ RF IMA B ATIVO	5.729.308,47	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	FUNDO ITAÚ RF IMA B ATIVO	3.077.220,03	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.488.852,91	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

FUNDO PREVIDENCIÁRIO	TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.250.378,50	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	RIO BRAVO CREDITO PRIVADO	1.314.453,07	artigo 7 Inciso VII, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	RIO BRAVO CREDITO PRIVADO	849.449,45	artigo 7 Inciso VII, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	SAFRA PREMIUM	3.981.502,07	artigo 8 Inciso III
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	SAFRA PREMIUM	2.329.101,55	artigo 8 Inciso III
FUNDO FINANCEIRO	SAFRA S&P	2.760.165,17	artigo 8 Inciso III
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	SAFRA S&P	1.557.188,47	artigo 8 Inciso III
FUNDO FINANCEIRO	SANTANDER IMA B-5 TP RF	19.747.410,06	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	SANTANDER IMA B-5 TP RF	9.244.157,63	artigo 7 Inciso I, Alínea "b"
FUNDO FINANCEIRO	SANTANDER FIC FI CORPORATE REFERENCIADO DI	831.502,22	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	SANTANDER FIC FI CORPORATE REFERENCIADO DI	362.292,59	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	SANTANDER SELEÇÃO TOP	302.777,74	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	SANTANDER SELEÇÃO TOP	732.694,60	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	WESTERN MASTER VALUATION FIA	2.839.439,73	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	WESTERN MASTER VALUATION FIA	1.801.118,51	artigo 8 Inciso II, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	WESTERN US INDEX 500	3.519.595,07	artigo 8 Inciso III
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	WESTERN US INDEX 501	3.192.424,32	artigo 8 Inciso III
FUNDO FINANCEIRO	WESTERN RF ATIVO	409.729,64	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	WESTERN RF ATIVO	269.902,08	artigo 7 Inciso IV, Alínea "a"
FUNDO FINANCEIRO	WESTERN LONG&SHORT	2.188.212,25	artigo 8 Inciso III
FUNDO PREVIDENCIÁRIO	WESTERN LONG&SHORT	1.418.433,85	artigo 8 Inciso III
TOTAL		403.915.340,80	

- **Comparação com a Meta Atuarial – Maio de 2018**

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO NO MÊS	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	META (%)	GAP (%)
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%
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%
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%
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%
MAIO	407.810.300,84	24.032.318,42	18.422.103,42	403.915.340,80	-9.494.675,04	-2,30%	0,92%	-249,63%

- **Enquadramento – Maio 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%	213.978.249,85	52,98%	30,00%	45,00%	70,00%	68.762.488,71
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA " A "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA " A "	40,00%	101.756.811,28	25,19%	10,00%	27,50%	40,00%	59.809.325,04
ARTIGO 7º, INCISO VI, ALÍNEA " A "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00
ARTIGO 7º, INCISO VII, ALÍNEA " A "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.195.767,04
ARTIGO 7º, INCISO VII, ALÍNEA " B "	5,00%	5.635.008,30	1,40%	2,00%	2,50%	5,00%	14.560.758,74
ARTIGO 7º, INCISO VII, ALÍNEA " C "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.195.767,04
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	321.370.069,43	79,56%	42,00%	75,00%	125,00%	
ARTIGOS - VARIÁVEL	RESOLUÇÃO %	CARTEIRA \$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2018			GAP SUPERIOR
				INFERIOR	ALVO	SUPERIOR	
ARTIGO 8º, INCISO I, ALÍNEA " A "	30,00%	2.138.391,01	0,53%	0,00%	2,00%	2,00%	5.939.915,81
ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA " A "	20,00%	51.035.590,28	12,64%	5,00%	13,50%	20,00%	29.747.477,88
ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	22.086.739,12	5,47%	5,00%	6,00%	10,00%	18.304.794,96
ARTIGO 8º, INCISO IV, ALÍNEA " A "	5,00%	5.727.550,96	1,42%	1,00%	2,50%	5,00%	14.468.216,08
ARTIGO 8º, INCISO IV, ALÍNEA " B "	5,00%	1.557.000,00	0,39%	1,00%	1,00%	5,00%	18.638.767,04
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	82.545.271,37	20,44%	12,00%	25,00%	42,00%	
TOTAL		403.915.340,80	100,00%	54,00%	100,00%	167,00%	