

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

JUNHO 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 – Junho de 2018**

ATIVOS	VOL*	VAR	MÊS	% ÍNDICE	ANO	VALOR(R\$)	% CARTEIR A	PL DO FUNDO	% NO PL FI
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	4,54%	0,5	-0,35%	-0,03%	1,04%	18.679.016,28	4,58%	3.747.694.315,14	0,50%
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,35%	0,27	0,07%	-0,05%	2,17%	8.996.334,81	2,20%	1.067.499.604,04	0,84%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	2,66%	0,31	0,42%	-0,03%	2,68%	26.100.078,62	6,40%	7.668.949.035,88	0,34%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,66%	0,31	0,44%	-0,01%	2,70%	29.117.867,39	7,13%	1.137.325.220,38	2,56%
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,13%	0,26	0,21%	0,53%	3,27%	9.767.838,45	2,39%	4.897.194.284,25	0,20%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,87%	0,33	0,03%	-0,01%	2,30%	13.672.132,74	3,35%	2.475.197.893,01	0,55%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB XII FI	0,77%	0,11	1,13%	1,45%	4,27%	10.920.617,35	2,68%	1.128.277.719,46	0,97%
FI CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RF ..	4,13%	0,44	1,38%	-0,38%	5,29%	2.026.801,50	0,50%	1.354.827.398,95	0,15%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5,91%	0,63	-0,01%	0,31%	2,00%	6.594.735,06	1,62%	1.019.700.922,07	0,65%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,95%	0,42	1,13%	1,45%	4,28%	12.781.516,50	3,13%	3.288.223.579,63	0,39%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TP RF	0,00%	0	0,10%	0,42%	0,90%	2.364.361,91	0,58%	967.230.865,50	0,24%
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA	6,31%	0,66	-0,97%	-0,65%	-2,35%	3.470.714,32	0,85%	281.841.366,67	1,23%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	1,78%	0,22	0,58%	0,90%	3,59%	15.545.123,53	3,81%	1.136.332.229,99	1,37%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX	0,77%	0,11	1,12%	0,67%	4,25%	2.544.593,57	0,62%	361.105.310,94	0,70%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3,75%	0,43	0,14%	0,46%	2,43%	6.631.807,78	1,63%	491.063.496,51	1,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA FI	4,15%	0,45	0,80%	0,35%	0,48%	5.785.243,02	1,42%	89.897.833,64	6,44%
BB PREVIDENCIARIO XI TÍTULOS PÚBLICOS	4,04%	0,46	0,31%	-0,14%	2,03%	3.317.164,19	0,81%	172.944.163,60	1,92%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,32%	0,48	0,27%	-1,48%	1,78%	3.145.159,47	0,77%	290.475.645,84	1,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI	1,37%	0,18	0,63%	0,18%	3,95%	2.061.744,20	0,51%	835.579.481,77	0,25%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TPIPCA IV FI	0,32%	0,07	1,37%	-0,38%	5,26%	1.338.505,73	0,33%	517.525.117,60	0,26%
GER FUT JURO REAL IMA-B FI RF LONGO PRAZO	4,80%	0,52	-0,85%	-0,53%	0,02%	2.555.798,41	0,63%	16.235.154,03	15,74%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,29%	0,66	-0,97%	-0,65%	-2,34%	1.431.380,17	0,35%	52.435.598,91	2,73%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RF	6,42%	0,69	-1,11%	-0,03%	-0,88%	4.155.006,38	1,02%	83.460.816,93	4,98%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,69%	0,31	0,39%	-0,06%	2,38%	2.038.848,91	0,50%	46.731.832,29	4,36%

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,09%	0,04	0,19%	98,19%	0,19%	2.962.445,36	0,73%	5.005.435.641,69	0,06%
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,24%	0,16	0,01%	2,50%	2,82%	679.719,67	0,17%	1.838.282.032,52	0,04%
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,64%	0,51	-0,29%	-56,17%	0,96%	8.780.931,08	2,15%	70.005.489,34	12,54%
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,08%	0,04	0,50%	96,79%	3,07%	2.144.902,67	0,53%	7.788.517.695,73	0,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,60%	0,3	0,07%	-0,05%	2,33%	24.478.466,33	6,00%	673.076.050,17	3,64%
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II RF FICFI	1,82%	0,23	0,59%	-0,67%	3,89%	23.972.447,89	5,87%	1.674.150.820,35	1,43%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	4,71%	0,52	-0,43%	-0,11%	0,86%	19.462.115,14	4,77%	1.261.917.384,10	1,54%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,07%	0,03	0,43%	82,57%	2,62%	10.711.690,22	2,62%	1.295.491.674,26	0,83%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07%	0,03	0,45%	86,59%	2,75%	653.115,14	0,16%	555.192.188,33	0,12%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5	2,81%	0,33	0,38%	-0,07%	2,59%	4.426.091,18	1,08%	536.163.794,28	0,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	1,82%	0,23	0,59%	-0,67%	3,87%	17.896.793,03	4,39%	1.494.479.068,39	1,20%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,69%	0,21	0,45%	-0,81%	0,41%	5.557.974,15	1,36%	1.823.013.314,56	0,30%
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO F	0,09%	0,04	0,51%	98,23%	3,22%	4.128.738,58	1,01%	404.853.448,04	1,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,77%	0,33	0,12%	-1,63%	3,06%	3.475.278,79	0,85%	469.679.669,45	0,74%
BRADESCO FI EM AÇÕES IBOVESPA PLUS	18,50%	1,98	-5,21%	-0,01%	-15,54%	2.027.075,89	0,50%	107.204.853,28	1,89%
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	17,66%	1,9	-5,01%	0,19%	-6,09%	983.634,60	0,24%	618.984.997,25	0,16%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS	13,68%	1,45	-1,18%	-0,93%	-1,18%	1.531.698,70	0,38%	226.031.937,60	0,68%
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	14,54%	1,52	-4,67%	0,53%	-11,47%	5.100.321,20	1,25%	65.896.942,00	7,74%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	16,94%	1,88	-2,60%	2,60%	3,61%	12.137.615,84	2,97%	599.564.848,43	2,02%
WA ASSET VALUATION FIA	17,80%	1,89	-4,07%	1,13%	-4,94%	4.451.552,03	1,09%	137.554.482,26	3,24%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	15,89%	1,71	-1,91%	3,29%	-2,72%	18.274.212,72	4,48%	572.372.369,78	3,19%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	12,05%	1,25	-3,43%	1,77%	-10,23%	7.192.389,27	1,76%	365.291.311,24	1,97%
BB AÇÕES PIPE FIC de FI	17,13%	1,77	-4,14%	1,06%	-19,03%	1.409.771,59	0,35%	58.858.544,21	2,40%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,47%	0,19	0,69%	133,41%	5,41%	3.631.546,16	0,89%	310.002.476,40	1,17%
CAIXA FIC CAPITAL PROT IBOV CICLICO	2,45%	0,3	0,49%	94,01%	4,97%	1.145.663,07	0,28%	88.083.228,66	1,30%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,37%	0,17	0,30%	57,84%	0,28%	6.329.492,10	1,55%	2.190.466.594,26	0,29%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULT	12,06%	1,32	0,16%	31,35%	3,19%	6.722.909,22	1,65%	1.037.025.558,50	0,65%
SAFRA S P REAIS PB FI MULT	11,97%	1,31	0,13%	5,33%	1,78%	5.701.974,86	1,40%	370.025.491,81	1,54%

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

FI EM PARTICIPAÇÕES REALESIS SHOPPING CENTERS	0,00%	0	-0,17%	-32,25%	50,40%	4.511.630,25	1,11%	194.987.300,29	2,31%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,00%	0	-0,57%	-110,12%	-0,59%	1.201.493,10	0,29%	36.585.464,40	3,28%
CAIXA RIO BRAVO IMOBILIÁRIO	0,00%	0	-11,16%	-5,96%	-10,91%	1.374.000,00	0,34%	157.771.987,02	0,87%
TOTAL						408.100.080,12			

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

RENTABILIDADES DA CARTEIRA							
ANO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	RENT.ANO
2018	2,43	0,24	0,96	0,57	-2,36	-0,24	1,55
INPC + 6%	0,74	0,6	0,56	0,7	0,92	1,92	5,55
p.p. Indx	1,69	-0,35	0,41	-0,13	-3,28	-2,16	-4

- Enquadramento – Junho de 2018**

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA					
RENDA FIXA					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	193.003.541,38	47,29%	45,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% TP (IMA ou IDkA)	2.038.848,91	0,50%	45,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	121.726.691,86	29,83%	27,50%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	7.604.017,37	1,86%	2,50%	5,00%
Total Renda Fixa		324.373.099,52	79,48%		
RENDA VARIÁVEL					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	2.027.075,89	0,50%	2,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	51.081.195,95	12,52%	13,50%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	23.531.585,41	5,77%	6,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	5.713.123,35	1,40%	2,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.374.000,00	0,34%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		83.726.980,60	20,53%		
Total Carteira		408.100.080,12			