

# **RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS**

**JULHO 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 – Julho de 2018**

ATIVOS	VOL*	VAR	MÊS	% ÍNDICE	ANO	VALOR(R\$)	% CARTEIRA	PL DO FUNDO	% NO PL
						(31/07/2018)			DO FUNDO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	4,43%	0,48	2,29%	-0,02%	3,35%	19.107.433,59	4,53%	3.931.831.423,60	0,49%
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,32%	0,27	1,41%	-0,01%	3,61%	9.122.827,18	2,16%	1.056.773.048,68	0,86%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	2,58%	0,3	1,46%	-0,01%	4,18%	26.481.629,27	6,28%	7.322.766.489,39	0,36%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,58%	0,3	1,46%	-0,02%	4,19%	29.522.980,21	7,00%	1.191.348.011,53	2,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,06%	0,25	1,19%	-1,13%	4,50%	9.884.008,15	2,34%	5.028.426.826,17	0,20%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,90%	0,33	1,59%	0,11%	3,92%	13.889.214,14	3,29%	2.432.051.278,12	0,57%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB XII FI	0,65%	0,1	0,50%	-1,81%	4,80%	10.975.737,03	2,60%	1.133.972.481,58	0,97%
FI CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RF ..	3,99%	0,43	1,34%	0,50%	6,70%	2.054.040,00	0,49%	1.373.035.693,85	0,15%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RENDA FIXA..	5,84%	0,61	2,22%	-0,09%	4,26%	6.741.350,34	1,60%	1.042.370.443,28	0,65%
CAIXA BRASIL 2018 II TP FI RENDA FIXA	3,92%	0,41	0,51%	-1,81%	4,81%	12.846.121,24	3,05%	3.304.843.294,13	0,39%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TP RF	0,00%	0	1,10%	-1,21%	2,01%	2.390.387,75	0,57%	977.877.622,95	0,24%
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	6,26%	0,65	2,59%	0,28%	0,18%	3.560.720,78	0,84%	289.150.514,08	1,23%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP VII	1,65%	0,2	1,01%	-1,30%	4,64%	15.702.548,64	3,72%	1.147.839.840,70	1,37%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX	0,64%	0,1	0,50%	-0,97%	4,78%	2.557.416,46	0,61%	362.925.016,97	0,70%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3,64%	0,41	1,83%	-0,49%	4,30%	6.753.054,93	1,60%	500.041.447,73	1,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL TP RF FUNDO DE INVESTIMENTO	4,09%	0,43	0,66%	-0,82%	1,14%	5.823.243,33	1,38%	90.488.322,32	6,44%
BB PREVIDENCIARIO XI TÍTULOS PÚBLICOS	3,92%	0,44	1,97%	0,50%	4,05%	3.382.670,21	0,80%	176.359.395,35	1,92%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,22%	0,47	2,10%	1,26%	3,92%	3.211.289,75	0,76%	296.583.201,31	1,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI	1,23%	0,16	0,73%	-0,75%	4,71%	2.076.715,87	0,49%	632.369.166,26	0,33%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	3,77%	0,45	5,49%	4,65%	11,04%	1.411.996,53	0,33%	475.312.360,17	0,30%
GERAÇÃO FUTURO JURO REAL - IMA-B FI LONGO PRAZO	4,69%	0,51	2,23%	-0,09%	2,25%	2.612.764,37	0,62%	15.067.539,41	17,34%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,24%	0,65	2,59%	0,28%	0,19%	1.468.465,87	0,35%	53.794.179,41	2,73%
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA LONGO FI RF	6,37%	0,68	3,11%	-0,04%	2,20%	4.284.182,37	1,02%	75.211.985,77	5,70%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,62%	0,3	1,43%	-0,04%	3,85%	2.068.052,22	0,49%	46.724.294,20	4,43%
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,07%	0,04	0,53%	98,39%	0,73%	5.565.011,75	1,32%	4.768.481.983,25	0,12%
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,25%	0,16	0,96%	177,68%	3,81%	686.268,15	0,16%	1.775.270.811,48	0,04%
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,54%	0,49	2,31%	426,23%	3,29%	8.983.871,49	2,13%	74.811.017,87	12,01%
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,06%	0,03	0,52%	96,81%	3,61%	2.156.162,28	0,51%	8.037.505.203,48	0,03%

## PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,58%	0,3	1,54%	0,13%	3,91%	24.855.415,02	5,89%	800.764.051,75	3,10%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	4,60%	0,5	2,34%	0,03%	3,22%	19.918.147,68	4,72%	1.232.430.690,11	1,62%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,06%	0,03	0,45%	82,84%	3,08%	10.759.822,41	2,55%	1.135.822.818,10	0,95%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05%	0,03	0,47%	86,57%	3,24%	3.593.914,84	0,85%	500.288.162,58	0,72%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5	2,72%	0,31	1,50%	0,03%	4,13%	4.492.683,33	1,07%	541.139.680,03	0,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,65%	0,2	0,57%	0,24%	4,46%	17.999.009,72	4,27%	1.394.012.894,53	1,29%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,61%	0,19	0,95%	0,62%	1,36%	5.610.678,49	1,33%	1.941.557.842,39	0,29%
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II RF FICFI	1,66%	0,2	0,57%	0,24%	4,48%	24.108.970,63	5,72%	1.834.632.251,30	1,31%
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FI RF	0,07%	0,03	0,55%	101,22%	3,79%	4.151.397,76	0,98%	413.858.250,46	1,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,83%	0,33	2,64%	1,80%	5,78%	3.567.084,97	0,85%	484.115.830,48	0,74%
BRADESCO FI EM AÇÕES IBOVESPA PLUS	18,80%	2,03	8,89%	0,01%	-8,03%	2.207.284,42	0,52%	118.052.333,58	1,87%
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	18,31%	1,98	9,21%	0,34%	2,56%	1.074.252,06	0,25%	649.915.173,01	0,17%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS	13,90%	1,48	5,36%	-3,52%	4,12%	1.613.797,56	0,38%	242.076.496,26	0,67%
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	14,85%	1,56	6,45%	-2,43%	-5,76%	5.429.169,00	1,29%	62.002.694,46	8,76%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	17,28%	1,88	1,96%	-6,91%	5,64%	12.375.670,29	2,93%	610.160.821,70	2,03%
WA ASSET VALUATION FIA	18,29%	1,95	6,47%	-2,41%	1,21%	4.739.573,99	1,12%	144.387.967,07	3,28%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	16,24%	1,74	6,13%	-2,75%	3,25%	19.394.274,35	4,60%	591.745.488,89	3,28%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	12,73%	1,34	9,28%	0,40%	-1,90%	7.859.527,88	1,86%	353.798.520,91	2,22%
BB AÇÕES PIPE FIC de FI	17,53%	1,82	7,56%	-1,31%	12,91%	1.516.366,93	0,36%	52.474.198,53	2,89%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,50%	0,19	0,33%	61,22%	5,76%	3.643.600,54	0,86%	331.602.560,77	1,10%
CAIXA FIC CAPITAL PROT IBOV CICLICO	2,38%	0,29	0,14%	26,66%	5,12%	1.147.319,08	0,27%	87.794.229,48	1,31%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,36%	0,17	0,80%	147,20%	1,08%	6.380.010,87	1,51%	2.147.117.506,59	0,30%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12,25%	1,34	3,85%	709,71%	7,17%	6.981.622,44	1,66%	1.054.214.856,05	0,66%
SAFRA S P REAIS PB FI MULT	12,14%	1,33	3,80%	-5,08%	5,64%	5.918.634,34	1,40%	376.740.575,72	1,57%
FI EM PARTICIPAÇÕES REALESIS SHOPPING CENTERS	0,00%	0	-0,17%	-31,93%	50,14%	4.503.819,28	1,07%	194.987.300,29	2,31%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,00%	0	-0,62%	-113,60%	-1,21%	1.194.092,20	0,28%	36.360.108,69	3,28%
CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	0	7,78%	-1,10%	-3,99%	1.469.805,00	0,35%	158.824.852,30	0,93%
<b>TOTAL</b>								<b>421.826.108,98<sup>1</sup></b>	

<sup>1</sup> Diferença de R\$0,54 com o sistema da empresa de consultoria (LDB) devido a regras de arredondamento.

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

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	JUROS	RETORNO (R\$)	SALDO NO MÊS	RETORNO (%)	META (%)
Janeiro	R\$ 370.364.777,04	R\$ 6.417.082,30	R\$ 753.770,54	R\$ 12.300,00	R\$ 8.998.237,97	R\$ 385.026.326,77	2,39%	0,74%
Fevereiro	R\$ 385.026.326,77	R\$ 42.232.155,15	R\$ 35.973.946,43	R\$ 765.648,04	R\$ 1.195.984,10	R\$ 391.714.871,55	0,31%	0,60%
Março	R\$ 391.714.871,55	R\$ 38.732.327,38	R\$ 33.962.025,88	R\$ 10.500,00	R\$ 3.832.923,21	R\$ 400.307.596,26	0,97%	0,56%
Abril	R\$ 400.307.596,26	R\$ 41.895.584,70	R\$ 36.671.346,96	R\$ 10.500,00	R\$ 2.288.966,84	R\$ 407.810.300,84	0,56%	0,70%
Maiο	R\$ 407.810.300,84	R\$ 24.032.318,42	R\$ 18.422.103,42	R\$ 10.500,00	-R\$ 9.494.675,04	R\$ 403.915.340,80	-2,30%	0,92%
Junho	R\$ 403.915.340,80	R\$ 15.479.164,46	R\$ 10.429.421,93	R\$ 10.500,00	-R\$ 854.502,73	R\$ 408.100.080,60	-0,21%	0,92%
Julho	R\$ 408.100.080,60	R\$ 35.035.376,76	R\$ 29.535.033,38	R\$ 10.500,00	R\$ 8.236.185,54	<b>R\$ 421.826.109,52</b>	1,99%	0,74%
Acumulado					R\$ 14.203.119,89		3,60%	6,36%

- **Enquadramento – Julho de 2018**

ENQUADRAMENTO CARTEIRA					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política	Limite Res.
				Investimento	3.922/10
<b>RENDA FIXA</b>					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	195.860.798,01	46,43%	45,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% TP (IMA ou IDkA)	2.068.052,22	0,49%	45,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	128.729.955,79	30,52%	27,50%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	7.718.482,73	1,83%	2,50%	5,00%
Total Renda Fixa		<b>334.377.288,75</b>	79,27%		
<b>RENDA VARIÁVEL</b>					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	2.207.284,42	0,52%	2,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	54.002.632,06	12,80%	13,50%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	24.071.187,27	5,71%	6,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	5.697.911,48	1,35%	2,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.469.805,00	0,35%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		<b>87.448.820,23</b>	20,73%		
<b>Total Carteira</b>		<b>421.826.108,98<sup>2</sup></b>	100,00%		

<sup>2</sup> Diferença de R\$0,54 com o sistema da empresa de consultoria (LDB) devido a regras de arredondamento.