

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
AGOSTO 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 – Agosto de 2018**

Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL
						(31/08/2018)			do Fundo
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	4,81%	0,52	-0,46%	-0,01%	2,88%	19.019.143,53	4,53%	3.764.381.114,94	0,51%
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,51%	0,28	-0,30%	-0,09%	3,30%	9.095.457,37	2,17%	1.039.260.067,76	0,88%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	2,83%	0,32	-0,27%	-0,01%	3,90%	26.410.060,31	6,29%	8.138.580.047,05	0,32%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,83%	0,32	-0,28%	-0,02%	3,90%	29.441.712,07	7,01%	1.243.901.746,15	2,37%
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,23%	0,26	0,01%	0,45%	4,50%	9.884.526,21	2,35%	6.077.575.260,09	0,16%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,19%	0,35	-1,08%	-0,15%	2,80%	13.739.014,33	3,27%	2.252.259.991,20	0,61%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF.	6,37%	0,66	-0,63%	-0,18%	3,61%	6.521.614,85	1,55%	1.040.857.431,46	0,63%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	0,00%	0	0,05%	0,50%	2,72%	1.429.234,66	0,34%	281.384.456,29	0,51%
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TP RF	0,00%	0	0,16%	0,60%	4,87%	2.328.508,47	0,55%	962.562.976,73	0,24%
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA	6,85%	0,71	0,05%	0,50%	2,74%	3.465.087,04	0,83%	281.384.456,29	1,23%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IX	0,62%	0,09	0,61%	0,86%	5,41%	2.572.899,65	0,61%	179.086.197,93	1,44%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	3,99%	0,44	-0,44%	0,01%	3,84%	6.543.404,32	1,56%	484.517.511,70	1,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL TP RF FI	4,09%	0,43	0,37%	0,62%	1,51%	5.844.519,21	1,39%	90.818.934,19	6,44%
BB Previdenciario XI Títulos Públicos	4,25%	0,46	-0,67%	-0,42%	3,35%	3.269.110,96	0,78%	170.438.853,02	1,92%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB XII FI	0,63%	0,09	0,61%	1,05%	5,43%	11.042.309,53	2,63%	177.410.310,59	6,22%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,65%	0,5	-0,40%	-0,84%	3,51%	3.198.459,24	0,76%	295.398.221,44	1,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,31%	0,17	0,18%	0,43%	4,89%	694.158,45	0,17%	211.425.283,76	0,33%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	3,96%	0,47	-0,55%	-1,00%	10,42%	1.363.894,97	0,32%	459.120.247,98	0,30%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RF	6,89%	0,73	-0,49%	0,03%	1,70%	4.263.253,25	1,02%	61.266.177,68	6,96%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP VII	1,84%	0,22	-0,05%	0,40%	4,58%	8.951.201,94	2,13%	629.013.509,37	1,42%

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,86%	0,32	-0,34%	-0,09%	3,49%	2.060.978,24	0,49%	47.402.301,58	4,35%
SANTANDER FIC FI INST REFERENCIADO DI	0,05%	0,03	0,55%	97,48%	1,28%	822.613,09	0,20%	4.825.752.877,70	0,02%
WESTERN ASSET RF ATIVO FI	1,32%	0,16	0,17%	30,02%	3,99%	687.436,08	0,16%	1.772.275.754,82	0,04%
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,90%	0,53	-0,52%	-92,43%	2,75%	8.936.793,69	2,13%	76.558.667,15	11,67%
CAIXA FIC PRÁTICO CP	0,04%	0,01	0,08%	19,10%	0,08%	2.730.453,18	0,65%	15.321.727.130,89	0,02%
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,05%	0,03	0,56%	98,13%	4,19%	2.168.157,94	0,52%	8.386.412.784,17	0,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,77%	0,31	-0,35%	-0,13%	3,55%	24.769.509,62	5,90%	764.957.487,86	3,24%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,68%	0,2	0,14%	0,23%	1,50%	7.621.374,50	1,81%	2.363.020.349,90	0,32%
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II RF FICFI	1,54%	0,19	0,37%	0,46%	4,87%	24.198.778,19	5,76%	2.165.446.758,25	1,12%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	5,04%	0,54	-0,64%	-0,19%	2,56%	19.790.480,54	4,71%	1.177.680.960,87	1,68%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,04%	0,03	0,47%	82,54%	3,57%	19.296.157,31	4,59%	1.278.234.772,66	1,51%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,04%	0,03	0,49%	86,53%	3,74%	3.037.379,76	0,72%	623.778.145,51	0,49%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5	2,98%	0,33	-0,34%	-0,08%	3,78%	4.477.474,99	1,07%	536.397.492,78	0,83%
ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	1,54%	0,19	0,37%	0,46%	4,85%	18.066.271,01	4,30%	1.520.634.782,97	1,19%
CAIXA FI RF SIMPLES LP	0,04%	0,03	0,36%	76,42%	0,36%	161.575,98	0,04%	6.233.369.370,42	0,00%
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FI RENDA	0,06%	0,03	0,57%	99,82%	4,38%	5.177.343,55	1,23%	476.260.841,41	1,09%
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,96%	0,34	-0,36%	-0,81%	5,40%	3.554.073,58	0,85%	509.890.681,17	0,70%
BRADESCO FI EM AÇÕES IBOVSPA PLUS	19,74%	2,08	-3,16%	0,05%	10,94%	2.137.487,64	0,51%	123.083.597,69	1,74%
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	19,83%	2,09	-5,72%	-2,51%	-3,31%	1.012.815,87	0,24%	598.029.169,60	0,17%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS	14,92%	1,57	-1,49%	1,72%	2,56%	1.589.755,42	0,38%	236.494.630,61	0,67%
BTG PACTUAL INST DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	15,74%	1,61	-4,85%	-1,64%	10,33%	5.166.030,47	1,23%	58.573.487,49	8,82%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	18,21%	1,92	-4,67%	-1,46%	0,71%	11.797.980,82	2,81%	580.486.356,58	2,03%
WA ASSET VALUATION FIA	19,67%	2,04	-5,14%	-1,93%	-3,99%	4.495.830,34	1,07%	136.487.759,40	3,29%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI DE AÇÕES	17,15%	1,8	-4,65%	-1,44%	-1,55%	18.493.202,20	4,40%	562.645.481,14	3,29%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14,34%	1,46	-9,09%	-5,88%	10,82%	7.145.038,82	1,70%	314.242.254,33	2,27%
BB AÇÕES PIPE FIC de FI	18,41%	1,86	-5,11%	-1,90%	17,36%	1.438.935,58	0,34%	49.250.117,29	2,92%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,53%	0,19	-0,43%	-76,55%	5,30%	3.627.787,85	0,86%	335.447.335,26	1,08%

CAIXA FIC CAPITAL PROT IBOV CICLICO	2,26%	0,27	0,40%	70,43%	5,54%	1.151.899,98	0,27%	87.794.339,44	1,31%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,38%	0,17	0,55%	97,60%	1,64%	6.415.312,28	1,53%	2.143.096.683,11	0,30%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12,16%	1,35	3,71%	653,68%	11,14%	9.999.242,35	2,38%	1.185.451.140,43	0,84%
SAFRA S P REAIS PB FI MULT	12,03%	1,34	3,67%	6,88%	9,53%	6.136.133,30	1,46%	432.767.405,01	1,42%
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIM	0,00%	0	0,81%	0,27%	0,81%	15.625.781,66	3,72%	437.336.034,99	3,57%
FIP LA SHOPPING CENTERS	0,00%	0	-0,22%	-38,28%	49,81%	4.494.045,05	1,07%	194.987.300,29	2,30%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,00%	0	-0,64%	-113,07%	-1,84%	1.186.437,83	0,28%	36.360.108,69	3,26%
CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	0	-2,73%	0,48%	-6,61%	1.419.750,00	0,34%	--	0,00%
TOTAL						419.967.889,07¹			

• **Comparação com a Meta Atuarial – Agosto 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	R\$ 421.826.109,52	1,99%	0,74%
Agosto	R\$ 421.826.109,52	R\$ 52.700.571,07	R\$ 51.545.258,20	R\$ 395.117,08	-R\$ 2.618.415,83	R\$ 419.967.889,48	-0,62%	0,53%

¹ Diferença de R\$0,41 devido a arredondamentos do sistema da empresa de consultoria LDB.

• **Enquadramento – Agosto de 2018**

ENQUADRAMENTO CARTEIRA					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica	Limite Res.
				Investimento	3.922/10
RENDA FIXA					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	190.929.029,06	45,46%	45,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	116.973.975,47	27,85%	27,50%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	8.731.417,11	2,08%	2,50%	5,00%
Total Renda Fixa		316.634.421,64	75,39%		
RENDA VARIÁVEL					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	2.137.487,64	0,51%	2,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	51.139.589,54	12,18%	13,50%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	42.956.157,79	10,23%	6,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	5.680.482,87	1,35%	2,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.419.750,00	0,34%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		103.333.467,84	24,61%		
TOTAL CARTEIRA		419.967.889,48	100,00%		