

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
SETEMBRO 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 – Setembro de 2018**

Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL
						(28/09/2018)			do Fundo
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	4,86%	0,51	-0,16%	-0,01%	2,71%	18.988.408,50	4,40%	3.646.686.495,81	0,52%
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,55%	0,28	0,58%	-0,06%	3,90%	9.148.179,06	2,12%	991.151.416,44	0,92%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	2,90%	0,32	0,86%	-0,03%	4,79%	26.636.336,66	6,18%	8.106.459.151,64	0,33%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,90%	0,32	0,87%	-0,02%	4,80%	29.696.899,44	6,89%	1.229.629.546,20	2,42%
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,27%	0,26	1,15%	1,30%	5,71%	9.998.426,80	2,32%	6.494.582.562,75	0,15%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,25%	0,36	1,18%	-0,11%	4,01%	13.901.513,60	3,22%	2.057.423.262,98	0,68%
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA	6,91%	0,7	-0,94%	-0,79%	1,77%	3.432.552,16	0,80%	278.742.378,70	1,23%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,26%	0,52	0,89%	-0,03%	11,40%	1.376.009,27	0,32%	463.198.217,32	0,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO	4,09%	0,43	0,90%	0,02%	2,43%	5.897.182,60	1,37%	91.637.276,08	6,44%
BB Previdenciario XI Títulos Públicos	4,32%	0,47	0,83%	-0,05%	4,21%	3.296.289,29	0,76%	171.855.826,79	1,92%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB XII FI	0,61%	0,09	0,45%	0,60%	5,91%	11.092.059,57	2,57%	147.362.884,68	7,53%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA..	6,45%	0,66	-0,26%	-0,11%	3,33%	6.504.514,61	1,51%	1.166.108.062,18	0,56%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	0,00%	0	-0,94%	-0,79%	1,76%	1.415.788,78	0,33%	51.864.437,71	2,73%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	4,42%	0,47	1,22%	1,37%	6,15%	2.356.900,64	0,55%	964.178.377,16	0,24%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,75%	0,51	0,35%	-0,57%	3,88%	3.209.792,48	0,74%	296.444.918,54	1,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI	1,38%	0,17	1,22%	0,33%	6,17%	702.603,85	0,16%	213.997.564,38	0,33%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RF	6,94%	0,72	-1,03%	0,01%	0,66%	4.219.423,69	0,98%	43.486.022,16	9,70%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	1,92%	0,23	1,09%	1,24%	5,73%	9.048.861,00	2,10%	635.876.147,99	1,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX	0,60%	0,09	0,45%	-0,43%	5,89%	2.584.499,38	0,60%	119.615.081,57	2,16%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	4,05%	0,44	0,56%	0,71%	4,43%	6.580.306,52	1,53%	487.249.998,09	1,35%

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,92%	0,33	0,83%	-0,05%	4,35%	2.078.120,58	0,48%	40.772.920,34	5,10%
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,03%	0,03	0,47%	99,39%	1,76%	2.772.261,51	0,64%	4.677.542.364,69	0,06%
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO	1,33%	0,16	0,66%	141,12%	4,68%	3.699.222,22	0,86%	1.675.844.637,98	0,22%
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,95%	0,52	-0,15%	-32,83%	2,59%	8.923.060,78	2,07%	67.431.520,44	13,23%
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,04%	0,03	0,44%	94,96%	4,65%	3.408.618,51	0,79%	8.348.473.002,20	0,04%
BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,80%	0,31	0,62%	-0,02%	4,19%	24.923.264,92	5,78%	770.042.793,85	3,24%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,69%	0,2	0,66%	0,18%	2,17%	7.671.393,41	1,78%	2.463.089.662,35	0,31%
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II RF FICFI	1,40%	0,17	0,42%	-0,06%	5,31%	33.953.156,98	7,87%	2.286.042.286,58	1,49%
BRABESCO INST FIC FI RF IMA B	5,10%	0,54	-0,22%	-0,07%	2,33%	19.746.205,78	4,58%	1.114.469.037,25	1,77%
ICATU VANGUARDA INFLACAO CURTA FI RF	2,95%	0,33	1,40%	-0,01%	1,40%	2.658.485,98	0,62%	207.197.990,72	1,28%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,03%	0,02	0,39%	82,81%	3,97%	10.899.939,58	2,53%	1.316.299.879,59	0,83%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03%	0,03	0,40%	86,50%	4,16%	1.791.528,93	0,42%	617.015.482,84	0,29%
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5	3,04%	0,34	0,86%	-0,03%	4,67%	4.515.944,55	1,05%	532.135.371,32	0,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	1,40%	0,17	0,42%	-0,06%	5,29%	18.141.577,23	4,21%	1.526.589.464,95	1,19%
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,06%	0,03	0,53%	113,80%	4,93%	11.215.149,99	2,60%	482.961.823,25	2,32%
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,91%	0,33	0,89%	-0,04%	6,33%	3.585.581,93	0,83%	512.371.845,43	0,70%
BRABESCO FI EM AÇÕES IBOVESPA PLUS	20,24%	2,13	3,48%	0,00%	-7,84%	2.211.777,56	0,51%	134.821.249,26	1,64%
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	20,06%	2,11	3,97%	0,50%	0,54%	1.053.074,45	0,24%	579.828.286,30	0,18%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS	15,30%	1,6	0,50%	-2,98%	3,07%	1.597.657,98	0,37%	237.205.362,33	0,67%
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	16,23%	1,66	3,25%	-0,22%	-7,41%	5.334.134,00	1,24%	60.120.341,74	8,87%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	18,36%	1,92	-0,59%	-4,06%	0,12%	11.728.479,13	2,72%	574.412.633,23	2,04%
WA ASSET VALUATION FIA	20,14%	2,08	0,31%	-3,17%	-3,69%	4.509.764,47	1,05%	115.978.555,83	3,89%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	17,77%	1,85	2,19%	-1,28%	0,61%	18.899.110,15	4,38%	580.684.215,66	3,25%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14,75%	1,48	-1,97%	-5,44%	-12,58%	7.004.489,32	1,62%	294.240.232,10	2,38%
BB AÇÕES PIPE FIC de FI	18,85%	1,9	1,85%	-1,62%	-15,83%	1.465.578,50	0,34%	43.946.318,27	3,33%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,48%	0,18	0,56%	120,62%	5,90%	3.648.272,42	0,85%	331.723.704,84	1,10%
CAIXA FIC CAPITAL PROT IBOV CICLICO	2,14%	0,25	0,32%	68,01%	5,88%	1.155.567,03	0,27%	87.714.502,68	1,32%

WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	12,21%	1,34	0,47%	99,92%	11,66%	10.046.014,23	2,33%	1.216.325.834,54	0,83%
SAFRA S P REAIS PB FI MULT	12,08%	1,33	0,47%	-3,00%	10,05%	9.431.833,88	2,19%	451.807.986,08	2,09%
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,00%	0	0,67%	-2,80%	1,49%	15.731.008,55	3,65%	440.281.136,36	3,57%
FIP LA SHOPPING CENTERS	0,00%	0	0,74%	158,93%	50,93%	4.527.478,77	1,05%	194.987.300,29	2,32%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,00%	0	2,64%	564,46%	0,75%	1.440.762,29	0,33%	43.871.213,02	3,28%
RIO BRAVO FUNDO IMOBILIÁRIO	0,00%	0	1,65%	-1,83%	-5,06%	1.432.500,00	0,33%	155.937.860,77	0,92%
						431.287.563,51¹	100%		

• **Comparação com a Meta Atuarial – Setembro 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%
Mai	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%
Setembro	R\$ 419.967.889,48	R\$ 40.293.859,55	R\$ 31.399.072,42	R\$ 10.500,00	R\$ 2.435.387,27	R\$ 431.287.563,88	0,58%	0,74%
Total ano					R\$ 14.020.091,33		3,60%	7,72%

¹ Diferença de R\$0,37 devido ao sistema de arredondamento da empresa de consultoria LDB.

• **Enquadramento – Setembro de 2018**

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	172.164.668,37	39,92%	45,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	143.104.660,42	33,18%	27,50%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	14.800.731,92	3,43%	2,50%	5,00%
Total Renda Fixa		330.070.060,71	76,53%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	2.211.777,57	0,51%	2,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	51.592.287,99	11,96%	13,50%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	40.012.696,56	9,28%	6,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	5.968.241,05	1,38%	2,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.432.500,00	0,33%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		101.217.503,17	23,47%		
Total Carteira		431.287.563,88	100,00%		