

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
OUTUBRO 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 – Outubro de 2018**

ATIVOS	VOL*	VAR	MÊS	% ÍNDICE	ANO	VALOR(R\$) 31/10/2018	% CARTEIRA	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	5,48%	0,61	7,07%	-0,07%	9,97%	20.330.893,60	4,49%	3.596.631.650,04	0,57%
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,79%	0,32	3,51%	0,05%	7,55%	9.469.559,70	2,09%	1.050.318.195,51	0,90%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	3,05%	0,35	3,10%	0,00%	8,03%	27.461.337,72	6,06%	9.298.896.034,42	0,30%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,05%	0,35	3,10%	0,00%	8,05%	30.617.897,96	6,76%	1.428.751.490,64	2,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP	2,33%	0,28	2,08%	0,14%	7,91%	12.797.622,48	2,82%	6.974.089.248,73	0,18%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,50%	0,4	3,86%	0,26%	8,02%	14.437.656,63	3,19%	2.871.544.266,78	0,50%
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	7,51%	0,8	9,10%	1,97%	11,04%	3.745.083,29	0,83%	304.121.803,89	1,23%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,47%	0,56	3,76%	2,80%	15,59%	1.427.761,06	0,32%	480.619.130,13	0,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL TP RF FI	4,07%	0,43	0,74%	-2,35%	3,19%	5.941.102,01	1,31%	92.319.746,31	6,44%
BB PREVIDENCIARIO XI TÍTULOS PÚBLICOS	4,52%	0,5	4,10%	1,00%	8,48%	3.431.531,15	0,76%	178.906.816,12	1,92%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB XII FI	0,56%	0,08	0,52%	-6,62%	6,46%	11.149.743,91	2,46%	118.853.331,90	9,38%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF.	6,77%	0,72	6,15%	-0,99%	9,69%	6.904.362,34	1,52%	1.237.791.535,98	0,56%
F I CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	0,00%	0	9,10%	1,96%	11,02%	1.544.645,12	0,34%	56.584.827,17	2,73%
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TP RENDA FIXA	4,42%	0,47	1,71%	-5,43%	7,96%	2.397.224,68	0,53%	980.674.362,97	0,24%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	5,01%	0,56	4,99%	4,02%	9,05%	3.369.835,15	0,74%	311.225.885,64	1,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,44%	0,18	1,71%	-1,39%	7,98%	714.609,71	0,16%	217.654.284,38	0,33%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RF	7,96%	0,87	10,59%	-0,08%	11,31%	4.666.134,93	1,03%	80.957.741,55	5,76%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	2,05%	0,25	2,49%	-4,65%	8,35%	9.273.825,05	2,05%	651.684.687,04	1,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX	0,55%	0,08	0,52%	-2,58%	6,44%	2.597.953,18	0,57%	119.614.221,81	2,17%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	4,25%	0,48	4,15%	-2,99%	8,76%	6.853.349,21	1,51%	507.467.908,19	1,35%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3,07%	0,35	3,03%	-0,07%	7,51%	2.141.030,12	0,47%	42.031.178,02	5,09%

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFER DI	0,02%	0,03	0,54%	99,45%	2,31%	2.611.235,63	0,58%	4.574.398.315,18	0,06%
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,37%	0,17	1,42%	261,95%	6,17%	3.751.839,09	0,83%	1.667.035.789,20	0,23%
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,56%	0,61	7,13%	1312,35%	9,90%	9.558.929,09	2,11%	74.381.527,10	12,85%
CAIXA FI BRASIL Referenciado DI LP	0,03%	0,03	0,53%	97,99%	5,21%	3.717.456,30	0,82%	8.101.441.130,94	0,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3,03%	0,35	3,62%	0,15%	7,96%	27.638.773,49	6,10%	735.536.085,15	3,76%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	5,75%	0,63	7,43%	0,29%	9,93%	21.212.658,87	4,68%	1.195.772.333,52	1,77%
ITAÚ INST ALOCACAO DINAMICA II FIC RF	1,19%	0,15	0,51%	0,06%	5,84%	34.125.913,92	7,53%	2.358.100.059,21	1,45%
ICATU VANGUARDA INFLACAO CURTA FI RF	3,10%	0,36	3,15%	0,05%	4,60%	2.742.137,77	0,61%	225.219.234,83	1,22%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,02%	0,02	0,45%	82,80%	4,43%	10.948.987,48	2,42%	1.120.973.032,49	0,98%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	0,02%	0,02	0,47%	86,53%	4,65%	1.034.329,69	0,23%	641.747.198,77	0,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5	3,19%	0,37	3,17%	0,07%	7,99%	4.659.087,47	1,03%	542.007.087,77	0,86%
ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	1,19%	0,15	0,51%	0,06%	5,82%	18.233.950,92	4,02%	1.492.081.353,77	1,22%
CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF	1,73%	0,21	1,69%	1,24%	3,90%	7.801.317,66	1,72%	2.578.996.952,13	0,30%
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FI RENDA	0,06%	0,03	0,58%	105,98%	5,54%	11.279.688,64	2,49%	472.814.833,93	2,39%
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,01%	0,35	2,89%	1,92%	9,40%	3.689.067,60	0,81%	528.180.347,94	0,70%
BRADESCO FI EM AÇÕES IBOVESPA PLUS	21,94%	2,34	10,17%	-0,02%	1,53%	2.436.677,42	0,54%	197.224.605,27	1,24%
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	21,47%	2,29	11,43%	1,25%	12,03%	1.173.493,22	0,26%	624.811.716,66	0,19%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS	16,83%	1,81	13,18%	3,00%	16,66%	3.015.361,22	0,67%	267.324.235,30	1,13%
BTG PACTUAL INST DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	17,80%	1,86	9,09%	-1,10%	1,00%	5.818.884,54	1,28%	61.110.273,79	9,52%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	21,62%	2,31	14,87%	4,69%	15,01%	15.187.815,95	3,35%	665.178.792,91	2,28%
WA ASSET VALUATION FIA	21,90%	2,29	9,75%	-0,43%	5,70%	4.949.617,68	1,09%	133.043.571,63	3,72%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI DE AÇÕES	19,22%	2,06	13,00%	2,81%	13,69%	21.355.711,89	4,71%	655.541.782,55	3,26%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	16,14%	1,67	9,68%	-0,51%	-4,11%	7.682.467,67	1,70%	267.499.506,61	2,87%
BB AÇÕES PIPE FIC de FI	20,46%	2,12	13,28%	3,09%	-4,65%	1.660.148,09	0,37%	49.780.613,36	3,33%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,54%	0,19	1,41%	259,46%	7,39%	3.699.672,05	0,82%	356.678.946,82	1,04%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13,70%	1,46	-6,70%	-1233,93%	4,18%	9.372.898,22	2,07%	1.090.030.015,04	0,86%
SAFRA S P REAIS PB FI MULT	13,54%	1,44	-6,65%	-16,83%	2,73%	8.805.005,66	1,94%	423.607.921,85	2,08%
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEG BOLSA DE VALORES MULTIM	0,00%	0	3,11%	-7,08%	4,64%	16.219.468,19	3,58%	453.952.196,66	3,57%

FIP LA SHOPPING CENTERS	0,00%	0	-0,18%	-32,30%	50,66%	4.519.539,16	1,00%	195.672.254,84	2,31%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,00%	0	-0,49%	-90,37%	0,26%	1.433.692,18	0,32%	43.871.213,02	3,27%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO IMOBILIÁRIO	0,00%	0	3,38%	-6,80%	-1,85%	1.470.000,00	0,32%	161.411.333,44	0,91%
						453.078.985,76¹	100%		

- **Comparação com a Meta Atuarial – Outubro 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%
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%
Outubro	R\$ 431.287.563,88	R\$ 19.713.037,94	R\$ 14.344.923,93	R\$ 10.500,00	R\$ 16.433.808,13	R\$ 453.078.986,02	3,79%	0,91%
Total ano					R\$ 30.453.899,46		7,54%	8,70%

¹ Diferença de R\$0,26 devido ao arredondamento do sistema LDB.

• **Enquadramento – Outubro de 2018**

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA					
ARTIGO	CLASSE	VALOR(R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA INVESTIMENTO	LIMITE 3922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	181.273.159,00	40,01%	45,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	148.036.617,38	32,67%	27,50%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	14.968.756,24	3,30%	2,50%	5,00%
Total Renda Fixa		344.278.532,62	75,98%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	2.436.677,42	0,54%	2,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	60.843.500,26	13,43%	13,50%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	38.097.044,12	8,41%	6,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	5.953.231,34	1,31%	2,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.470.000,00	0,32%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		108.800.453,14	24,01%		
Total Carteira		453.078.985,76			