

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
NOVEMBRO 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 – Novembro de 2018**

ATIVOS	VOL*	VAR	MÊS	% ÍNDICE	ANO	VALOR(R\$) (30/11/2018)	% CARTEIRA	PL DO FUNDO	% NO FUNDO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	5,45%	0,61	0,91%	0,00%	10,97%	22.289.603,37	4,82%	3.733.451.663,62	0,60%
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,77%	0,32	0,78%	0,02%	8,38%	9.543.135,84	2,06%	1.108.812.053,77	0,86%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	3,05%	0,35	0,13%	-0,01%	8,18%	27.498.345,29	5,95%	9.736.339.713,88	0,28%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,05%	0,35	0,13%	-0,02%	8,19%	30.656.776,03	6,63%	1.586.321.267,86	1,93%
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	2,35%	0,28	0,13%	-0,04%	8,05%	12.814.569,39	2,77%	7.304.520.055,18	0,18%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,49%	0,4	0,99%	0,00%	9,10%	14.581.068,21	3,15%	3.055.495.179,05	0,48%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7,52%	0,81	0,92%	0,02%	12,06%	3.779.551,01	0,82%	306.920.747,56	1,23%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,53%	0,56	0,27%	0,01%	15,90%	1.431.570,80	0,31%	481.901.582,18	0,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF FI	4,13%	0,43	-3,00%	-3,14%	0,09%	5.762.751,24	1,25%	89.548.324,98	6,44%
BB PREVIDENCIARIO XI TÍTULOS PÚBLICOS	4,48%	0,5	0,29%	0,15%	8,80%	3.441.538,24	0,74%	179.428.547,68	1,92%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB XII FI	0,53%	0,08	0,47%	-0,43%	6,96%	11.202.172,10	2,42%	119.412.202,55	9,38%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	6,75%	0,72	0,12%	-0,79%	9,82%	6.912.537,59	1,50%	1.239.257.055,89	0,56%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	0,00%	0	0,92%	0,01%	12,04%	1.558.827,61	0,34%	57.104.389,88	2,73%
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	4,42%	0,47	0,10%	-0,80%	8,08%	2.399.725,91	0,52%	981.697.236,02	0,24%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,99%	0,56	0,13%	-0,13%	9,19%	3.285.048,29	0,71%	303.395.274,74	1,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI	1,46%	0,19	0,11%	-0,04%	8,10%	715.373,21	0,15%	217.886.829,19	0,33%
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA LONGO FI RF	7,93%	0,87	1,51%	-0,01%	12,99%	4.736.525,51	1,02%	81.436.491,75	5,82%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	2,07%	0,25	0,17%	-0,74%	8,53%	9.289.329,66	2,01%	652.774.217,87	1,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX	0,52%	0,08	0,47%	0,33%	6,94%	2.610.204,24	0,56%	120.025.855,37	2,17%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	4,22%	0,47	0,18%	-0,72%	8,96%	6.866.019,81	1,49%	508.406.124,79	1,35%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3,07%	0,35	0,09%	-0,05%	7,61%	2.142.911,00	0,46%	42.188.018,88	5,08%
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,02%	0,03	0,49%	99,96%	2,81%	2.142.286,04	0,46%	4.253.254.685,69	0,05%
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,39%	0,17	0,74%	149,98%	6,95%	3.779.611,03	0,82%	1.538.322.445,34	0,25%
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,53%	0,62	0,75%	152,52%	10,73%	9.630.886,83	2,08%	74.007.078,28	13,01%
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	0,03%	0,03	0,49%	98,36%	5,72%	3.350.726,23	0,72%	7.127.166.322,62	0,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3,00%	0,35	0,76%	0,00%	8,77%	29.608.429,78	6,41%	778.933.682,67	3,80%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	5,73%	0,64	0,95%	0,04%	10,97%	21.414.034,67	4,63%	1.222.626.591,32	1,75%
ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RF	1,30%	0,16	0,75%	0,96%	6,63%	34.380.890,94	7,44%	2.413.070.507,67	1,42%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF	3,11%	0,36	0,14%	0,00%	4,74%	2.745.923,04	0,59%	229.367.847,87	1,20%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,01%	0,02	0,41%	82,55%	4,86%	11.082.909,29	2,40%	1.226.386.944,30	0,90%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	0,01%	0,02	0,43%	86,44%	5,10%	1.037.183,60	0,22%	558.746.629,44	0,19%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5	3,19%	0,36	0,15%	0,01%	8,15%	4.666.020,82	1,01%	551.934.907,42	0,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	1,30%	0,16	0,74%	0,95%	6,61%	18.368.660,46	3,97%	1.460.666.930,50	1,26%
CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF	1,78%	0,21	0,37%	0,58%	4,29%	7.830.559,89	1,69%	2.776.261.068,71	0,28%

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FI RENDA	0,06%	0,03	0,50%	101,80%	6,07%	11.336.362,44	2,45%	447.212.983,63	2,53%
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,01%	0,35	0,33%	0,08%	9,76%	3.701.292,20	0,80%	531.133.263,06	0,70%
BRDESCO FI EM AÇÕES IBOVESPA PLUS	21,82%	2,35	2,37%	-0,01%	3,94%	2.494.519,73	0,54%	209.710.338,36	1,19%
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	21,17%	2,27	2,18%	-0,20%	14,48%	1.199.087,35	0,26%	627.746.064,20	0,19%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS	16,93%	1,84	5,30%	2,92%	22,85%	4.843.304,16	1,05%	290.087.182,94	1,67%
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	17,97%	1,9	4,52%	2,14%	5,57%	6.081.961,63	1,32%	56.915.518,33	10,69%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	21,57%	2,33	5,00%	2,62%	20,76%	15.947.458,02	3,45%	722.270.544,76	2,21%
WA ASSET VALUATION FIA	21,86%	2,33	4,18%	1,80%	10,12%	5.156.675,50	1,12%	135.726.645,82	3,80%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	19,31%	2,09	3,42%	1,04%	17,58%	22.086.697,61	4,78%	776.617.618,93	2,84%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	16,86%	1,77	5,13%	2,75%	0,81%	8.076.917,34	1,75%	275.775.526,09	2,93%
BB AÇÕES PIPE FIC de FI	20,42%	2,13	3,43%	1,05%	-1,38%	1.717.085,56	0,37%	42.702.871,07	4,02%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,54%	0,19	0,07%	13,80%	7,46%	3.702.191,95	0,80%	349.268.035,55	1,06%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	14,35%	1,53	1,88%	381,20%	6,14%	9.549.240,74	2,07%	1.069.212.580,85	0,89%
SAFRA S P REAIS PB FI MULT	14,19%	1,51	1,80%	-0,58%	4,58%	8.963.563,32	1,94%	424.783.488,33	2,11%
FIC FI CAIXA CAP PROTEG BOLSA VALORES MULT	0,00%	0	0,80%	-1,58%	5,48%	16.349.708,66	3,54%	456.887.249,44	3,58%
FIP LA SHOPPING CENTERS	0,00%	0	-0,16%	-33,22%	50,42%	4.512.129,37	0,98%	195.672.254,84	2,31%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,00%	0	-0,45%	-91,52%	-0,19%	1.427.216,28	0,31%	43.458.737,66	3,28%
CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	0	4,41%	2,03%	2,48%	1.524.000,00	0,33%	163.878.008,51	0,93%
TOTAL CARTEIRA						462.225.118,83¹			

¹ Diferença de R\$0,42 devido ao arredondamento do sistema LDB.

- **Comparação com a Meta Atuarial – Novembro 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	2,40%	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	0,57%	0,70%
MAIO	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	2,00%	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	-0,61%	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	0,57%	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%
NOVEMBRO	R\$ 453.078.986,02	R\$ 9.587.343,64	R\$ 5.358.822,40	R\$ 10.500,00	R\$ 4.928.111,99	R\$ 462.225.119,25	1,08%	0,21%
TOTAL ANO					R\$ 35.382.011,45		8,78%	8,54%

- **Enquadramento – Novembro de 2018**

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA					
ARTIGO	CLASSE	VALOR(R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA INVESTIMENTO	LIMITE RES. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% TP - Referenciado, IMA ou IDkA	183.517.584,4	39,70%	45,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	150.038.122,62	32,46%	27,50%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	15.037.654,64	3,25%	2,50%	5,00%
Total Renda Fixa		348.593.361,61	75,42%		
RENDA VARIÁVEL					
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	2.494.519,73	0,54%	2,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	65.109.187,17	14,09%	13,50%	20,00%
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	38.564.704,67	8,34%	6,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.939.345,65	1,28%	2,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.524.000,00	0,33%	1,00%	5,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL		113.631.757,22	24,58%		
TOTAL CARTEIRA		462.225.118,83²	100,00%		

² Diferença de R\$0,42 devido ao arredondamento do sistema LDB.