

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
DEZEMBRO 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 – Dezembro de 2018**

ATIVOS	VOL*	VAR	MÊS	% ÍNDICE	ANO	VALOR(R\$) 31/12/2018 (31/12/2018)	% CARTEIRA	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO do Fundo
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	5,44%	0,61	1,62%	-0,03%	12,76%	22.649.669,06	4,80%	3.870.963.791,60	0,59%
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,77%	0,32	1,16%	-0,01%	9,63%	9.653.431,38	2,04%	1.121.031.482,25	0,86%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	3,05%	0,35	1,38%	0,02%	9,67%	27.877.376,29	5,90%	11.498.930.142,73	0,24%
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,05%	0,35	1,34%	-0,02%	9,65%	31.068.968,29	6,58%	1.414.957.092,19	2,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP	2,35%	0,28	1,16%	-0,10%	9,30%	12.962.979,93	2,74%	7.593.758.539,71	0,17%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,50%	0,4	1,48%	-0,06%	10,71%	14.796.484,29	3,13%	2.378.694.859,16	0,62%
CAIXA BRASIL 2030 III TP FI RENDA FIXA	7,50%	0,81	1,43%	-0,22%	13,66%	3.833.499,43	0,81%	311.301.647,07	1,23%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	4,51%	0,56	1,53%	0,92%	17,68%	1.453.493,85	0,31%	489.281.411,86	0,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL TP RF FI	4,13%	0,43	0,39%	-0,98%	0,48%	5.785.012,75	1,22%	89.894.254,75	6,44%
BB PREVIDENCIARIO XI TÍTULOS PÚBLICOS	4,47%	0,5	1,63%	0,26%	10,57%	3.497.550,31	0,74%	182.348.800,76	1,92%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB XII FI	0,52%	0,08	0,47%	-1,18%	7,46%	11.254.697,00	2,38%	119.952.099,52	9,38%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RENDA FIXA..	6,75%	0,72	1,80%	0,15%	11,80%	7.037.158,78	1,49%	1.261.598.283,87	0,56%
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	0,00%	0	1,42%	-0,23%	13,63%	1.581.031,40	0,33%	57.917.780,87	2,73%
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TP RENDA FIXA	4,41%	0,47	0,93%	-0,72%	9,08%	2.422.119,38	0,51%	990.858.153,90	0,24%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,98%	0,56	1,91%	1,30%	11,28%	3.347.781,57	0,71%	309.189.095,47	1,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,46%	0,19	0,93%	-0,43%	9,10%	722.044,38	0,15%	219.918.719,92	0,33%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RF	7,91%	0,88	1,85%	-0,03%	15,08%	4.824.268,92	1,02%	81.535.970,11	5,92%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP VII	2,08%	0,25	1,16%	-0,49%	9,80%	9.397.251,76	1,99%	660.358.054,98	1,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IX	0,52%	0,08	0,47%	-0,89%	7,44%	2.622.486,89	0,56%	120.401.118,20	2,18%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	4,20%	0,48	1,51%	-0,14%	10,61%	6.969.540,29	1,48%	516.071.474,60	1,35%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3,07%	0,35	1,30%	-0,06%	9,01%	2.170.762,25	0,46%	43.548.852,78	4,98%
SANTANDER FIC FI INST REFERENCIADO DI	0,02%	0,03	0,50%	102,25%	3,33%	1.712.943,73	0,36%	4.372.026.164,61	0,04%
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,42%	0,18	1,11%	224,13%	8,14%	3.821.420,70	0,81%	1.528.650.474,30	0,25%
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,52%	0,62	1,73%	351,52%	12,65%	9.797.976,81	2,07%	75.373.329,40	13,00%
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	0,02%	0,03	0,48%	97,45%	6,23%	3.772.098,42	0,80%	6.777.682.965,68	0,06%
BRASESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3,00%	0,35	1,17%	0,00%	10,04%	29.953.381,71	6,34%	769.535.094,75	3,89%
BRASESCO INST FIC FI RF IMA B	5,72%	0,64	1,70%	0,05%	12,86%	21.778.851,75	4,61%	1.220.981.481,89	1,78%
ITAÚ INST ALOCACAO DINAMICA II FIC RF	1,40%	0,18	1,50%	1,35%	8,23%	35.066.386,05	7,42%	2.536.010.521,38	1,38%
ICATU VANGUARDA INFLACAO CURTA FI RF	3,10%	0,36	1,38%	0,02%	6,19%	2.783.842,16	0,59%	276.902.782,05	1,01%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,01%	0,02	0,41%	82,32%	5,29%	11.127.938,16	2,36%	1.157.483.382,72	0,96%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	0,01%	0,02	0,43%	86,46%	5,55%	995.347,52	0,21%	658.051.553,40	0,15%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5	3,18%	0,37	1,36%	0,00%	9,62%	4.729.675,31	1,00%	556.904.316,48	0,85%
ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	1,39%	0,18	1,51%	1,36%	8,22%	18.646.581,73	3,95%	1.172.042.980,66	1,59%
CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF	1,81%	0,22	1,33%	1,18%	5,67%	7.934.391,27	1,68%	3.163.516.828,54	0,25%
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FI RENDA	0,06%	0,03	0,55%	111,72%	6,65%	11.398.872,54	2,41%	489.715.878,55	2,33%
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,01%	0,35	1,10%	0,49%	10,97%	3.742.062,83	0,79%	536.359.812,27	0,70%
BRASESCO FI EM AÇÕES IBOVESA PLUS	21,98%	2,34	-1,74%	0,06%	2,13%	2.451.018,79	0,52%	249.766.399,94	0,98%
SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	21,41%	2,28	0,41%	2,22%	14,95%	1.204.023,39	0,25%	610.979.792,78	0,20%

**PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES
DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ**

ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS	17,09%	1,85	2,28%	4,09%	25,65%	10.110.722,66	2,14%	319.834.336,36	3,16%
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FIA	18,31%	1,93	0,51%	2,31%	6,10%	6.112.845,10	1,29%	51.557.706,83	11,86%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	21,45%	2,32	4,70%	6,51%	26,44%	16.697.637,26	3,54%	767.259.119,02	2,18%
WA ASSET VALUATION FIA	22,14%	2,34	-0,01%	1,80%	10,12%	5.156.414,01	1,09%	135.477.497,93	3,81%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIA	19,67%	2,12	2,88%	4,69%	20,97%	22.723.512,99	4,81%	878.200.709,46	2,59%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	17,07%	1,78	1,07%	2,88%	1,89%	8.163.707,88	1,73%	275.727.897,86	2,96%
BB AÇÕES PIPE FIC de FI	20,77%	2,16	1,89%	3,70%	0,48%	1.749.523,07	0,37%	20.648.213,12	8,47%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,52%	0,19	0,82%	166,45%	8,35%	3.732.606,46	0,79%	366.126.986,48	1,02%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIM	15,58%	1,61	-8,07%	-1634,26%	-2,43%	8.779.002,30	1,86%	897.727.915,92	0,98%
SAFRA S P REAIS PB FI MULT	15,44%	1,59	-8,22%	-6,41%	-5,59%	8.226.904,06	1,74%	367.342.065,53	2,24%
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEG BOLSA DE VALORES MULTIM	0,00%	0	1,39%	3,19%	6,94%	16.576.255,29	3,51%	463.218.020,84	3,58%
FIP LA SHOPPING CENTERS	0,00%	0	-0,16%	-32,18%	50,18%	4.504.962,60	0,95%	194.699.132,45	2,31%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,00%	0	-0,46%	-93,00%	-0,65%	1.420.664,95	0,30%	43.259.246,29	3,28%
CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	0	0,04%	1,85%	2,52%	1.514.040,00	0,32%	166746479,7	0,91%
TOTAL						472.313.219,70¹	100%		

¹Diferença de R\$0,16 devido ao arredondamento do sistema LBD.

• **Comparação com a Meta Atuarial – Dezembro 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%
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%	1,92%
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%	0,76%
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%
Dezembro	R\$ 462.225.119,25	R\$ 12.652.531,92	R\$ 7.569.493,34	R\$ 10.500,00	R\$ 5.005.061,71	R\$ 472.313.219,54	1,07%	0,60%
Total Ano					R\$ 40.387.073,16		9,94%	9,58%

• **Enquadramento – Dezembro de 2018**

Enquadramento da Carteira					
ARTIGO	CLASSE	VALOR(R\$)	% CARTEIRA	POLITICA INVESTIMENTO	LIMITE RES. 3.922/10
RENDA FIXA					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos -	R\$ 185.927.608,15	39,37%	45,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	R\$ 152.120.835,17	32,21%	27,50%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	R\$ 15.140.935,39	3,21%	2,50%	5,00%
TOTAL RENDA FIXA		R\$353.189.378,71	74,78%		
RENDA VARIÁVEL					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	2.451.018,80	0,52%	2,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	71.918.386,41	15,23%	13,50%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	37.314.768,06	7,90%	6,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	5.925.627,56	1,25%	2,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.514.040,00	0,32%	1,00%	5,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL		119.123.840,83	25,22%		
TOTAL CARTEIRA		472.313.219,54	100,00%		