

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
AGOSTO DE 2017



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 do Conselho Monetário Nacional.

• **Composição da Carteira da Guarujá Previdência – Agosto de 2017**

ATIVOS RENDA FIXA	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	(%) INSTIT	VAR - MÊS
CAIXA BRASIL FI RF REFERENCIADO DI LP	1.732.907,34	0	0	1.746.625,88	13.718,54	0,79%	0,79%	0,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RF PREVIDENCIÁRIO	11.717.395,01	6.144.585,51	0	18.016.954,00	154.973,48	0,87%	1,32%	1,81%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RF	17.312.133,07	686.271,45	0	18.242.505,45	244.100,93	1,36%	1,39%	1,87%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RF	9.536.122,96	12.366.694,77	0	22.029.618,80	126.801,07	0,58%	1,08%	0,97%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RF	18.808.122,20	0	0	19.055.186,74	247.064,54	1,31%	1,31%	1,87%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	1.960.943,74	0	0	1.981.094,76	20.151,02	1,03%	1,03%	0,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	21.257.957,96	0	0	21.521.481,17	263.523,21	1,24%	1,24%	0,72%
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	2.896.284,05	17.785.860,23	0	20.706.758,50	24.614,22	0,12%	0,70%	0,00%
SANTANDER CORPORATE FIC RF REFERENCIADO DI	6.042.066,45	801.184,30	789.896,35	6.100.966,25	47.611,85	0,70%	0,84%	0,04%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RF PREVIDENCIÁRIO	16.204.649,43	0	16.421.465,58	0	216.816,15	1,34%	1,34%	2,65%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RF	20.919.931,45	0	0	21.178.473,40	258.541,95	1,24%	1,24%	0,72%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RF	12.543.503,80	1.070.000,00	13.729.138,94	0	115.635,14	0,85%	1,33%	2,66%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RF	5.329.640,75	0	5.378.217,68	0	48.576,93	0,91%	1,32%	2,65%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF PREVIDENCIÁRIO	6.295.027,98	0	6.360.197,33	0	65.169,35	1,04%	1,04%	3,99%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	4.543.121,72	0	0	4.588.870,23	45.748,51	1,01%	1,01%	0,99%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	6.566.901,77	7.607.660,83	6.258.127,95	7.986.245,97	69.811,32	0,49%	0,72%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	6.350.370,94	0	0	6.411.587,23	61.216,29	0,96%	0,96%	0,49%
BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.232.790,69	0	0	3.277.208,86	44.418,17	1,37%	1,37%	0,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.150.248,61	0	0	3.202.874,76	52.626,15	1,67%	1,67%	1,27%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	1.958.878,50	0	54.796,28	1.922.502,00	18.419,78	0,94%	-1,86%	4,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.295.652,00	0	36.440,65	1.271.313,79	12.102,44	0,93%	0,95%	0,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RF PREVIDENCIÁRIO	2.027.656,44	0	54.717,88	1.990.240,80	17.302,24	0,85%	0,87%	0,45%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	1.466.285,19	0	37.652,94	1.450.243,59	21.611,34	1,47%	-1,09%	4,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	0	919.728,55	0	926.695,46	6.966,91	0,76%	1,33%	0,78%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	6.623.261,15	0	174.063,02	6.561.690,02	112.491,89	1,70%	-0,93%	4,25%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RF	2.490.824,80	0	0	2.521.934,33	31.109,53	1,25%	1,25%	1,91%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	12.593.478,17	0	342.395,88	12.335.838,32	84.756,03	0,67%	-2,05%	4,29%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	3.556.798,00	0	92.737,68	3.516.539,88	52.479,56	1,48%	-1,13%	4,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	15.340.923,05	0	424.804,18	15.065.522,23	149.403,36	0,97%	0,99%	0,55%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RF CRÉDITO PRIVADO	2.434.825,80	0	0	2.448.952,20	14.126,40	0,58%	0,58%	0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	16.615.995,52	0	0	16.812.146,98	196.151,46	1,18%	1,18%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RF PREVIDENCIÁRIO	2.512.576,47	0	69.643,25	2.459.790,98	16.857,76	0,67%	0,68%	0,29%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RF	4.112.353,77	0	0	4.166.765,40	54.411,63	1,32%	1,32%	2,66%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	2.317.987,13	0	61.567,11	2.280.486,13	24.066,11	1,04%	-1,62%	4,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RF PREVIDENCIÁRIO	6.595.570,74	0	173.259,43	6.518.783,23	96.471,92	1,46%	1,49%	1,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	5.703.360,37	0	0	5.753.067,82	49.707,45	0,87%	0,87%	0,41%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RF	1.924.256,12	0	0	1.946.896,35	22.640,23	1,18%	1,18%	0,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.305.351,71	0	88.067,70	3.268.297,69	51.013,68	1,54%	1,57%	1,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RF PREVIDENCIÁRIO	10.786.978,30	0	301.849,74	10.557.529,54	72.400,98	0,67%	0,68%	0,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RF	3.889.566,08	803.000,00	0	4.743.270,87	50.704,79	1,08%	1,18%	1,01%
TOTAL RENDA FIXA	283.952.699,23	48.184.985,64	50.849.039,57	284.564.959,61	3.276.314,31			

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

ATIVOS RENDA VARIÁVEL	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	(%) INSTIT	VAR - MÊS
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOV ATIVO FI AÇÕES	8.615.291,17	0	4.000.000,00	4.758.681,80	143.390,63	1,66%	1,62%	5,55%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.739.637,57	0	0	1.840.096,93	100.459,36	5,77%	5,77%	4,06%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.961.890,93	0	0	8.160.090,79	198.199,86	2,49%	2,49%	5,67%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTIT FIC AÇÕES	12.122.675,95	428.000,00	0	13.314.324,67	763.648,72	6,08%	6,21%	4,09%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.523.756,97	0	0	1.629.350,78	105.593,81	6,93%	6,93%	4,97%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.648.500,00	0	10.725,00	1.528.500,00	-109.275,00	-6,63%	-7,28%	12,12%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.400.764,43	0	0	1.415.868,19	15.103,76	1,08%	1,08%	4,31%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	454.575,45	0	0	484.473,66	29.898,21	6,58%	6,58%	4,61%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.019.662,91	120.000,00	0	1.115.180,22	-24.482,69	-2,15%	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.098.012,70	481.000,00	0	3.684.246,04	105.233,34	2,94%	3,24%	3,43%
CAIXA CAPITAL PROT IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULT	1.032.254,86	0	0	1.054.049,29	21.794,43	2,11%	2,11%	1,16%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.943.598,01	428.000,00	0	2.550.396,40	178.798,39	7,54%	8,29%	3,94%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	42.560.620,95	1.457.000,00	4.010.725,00	41.535.258,77	1.528.362,82			
TOTAL INVESTIMENTOS	326.513.320,18	49.641.985,64	54.859.764,57	326.100.218,38	4.804.677,13			

- **Comparação com a Meta Atuarial – Agosto de 2017**

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO NO MÊS	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	META (%)	GAP (%)	VAR (%)
JANEIRO	261.108.868,73	21.089.482,35	10.275.126,48	276.910.825,38	4.987.600,78	1,83%	0,93%	196,77%	2,94%
FEVEREIRO	276.910.825,38	13.599.502,76	8.670.949,49	288.966.546,61	7.127.167,96	2,53%	0,66%	384,27%	2,44%
MARÇO	288.966.546,61	13.233.603,61	8.406.201,94	296.818.508,24	3.024.559,96	1,03%	0,85%	120,42%	2,23%
ABRIL	296.818.508,24	11.352.821,18	6.449.644,87	302.193.691,37	472.006,82	0,16%	0,40%	39,59%	1,88%
MAIO	302.193.691,37	12.701.226,88	7.200.816,15	304.904.527,97	-2.789.574,13	-0,91%	0,87%	-103,99%	9,60%
JUNHO	304.904.527,97	13.784.904,33	8.658.620,03	311.736.959,56	1.706.147,29	0,55%	0,19%	296,99%	2,08%
JULHO	311.736.959,56	10.705.529,18	5.660.510,55	326.513.320,18	9.731.341,99	3,07%	0,66%	467,16%	1,96%
AGOSTO	326.513.320,18	49.641.985,64	54.859.764,57	326.100.218,38	4.804.677,13	1,47%	0,50%	292,50%	1,69%
TOTAL					29.063.927,80	10,10%	5,17%	195,36%	

- **Enquadramento – Agosto de 2017**

ARTIGOS - RENDA FIXA	RESOLUÇÃO %	CARTEIRA \$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2017			GAP SUPERIOR
				INFERIOR	ALVO	SUPERIOR	
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA " B "	100,00%	154.092.087,10	46,30%	30,00%	35,00%	70,00%	78.896.529,07
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA " A "	80,00%	60.254.006,45	18,10%	15,00%	20,00%	60,00%	139.450.521,69
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA " A "	30,00%	64.492.705,00	19,38%	5,00%	5,00%	30,00%	35.359.559,07
ARTIGO 7º, INCISO VI	15,00%	0	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	49.926.132,04
ARTIGO 7º, INCISO VII, ALÍNEA " A "	5,00%	0	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	16.642.044,01
ARTIGO 7º, INCISO VII, ALÍNEA " B "	5,00%	5.726.161,06	1,72%	0,00%	2,50%	5,00%	10.915.882,95
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	284.564.959,61	85,50%	55,00%	75,00%	185,00%	
ARTIGOS - RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO %	CARTEIRA \$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2017			GAP SUPERIOR
				INFERIOR	ALVO	SUPERIOR	
ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	4.758.681,80	1,43%	0,00%	0,00%	4,00%	8.554.953,41
ARTIGO 8º, INCISO III	15,00%	31.662.979,27	9,51%	5,00%	10,00%	15,00%	18.263.152,77
ARTIGO 8º, INCISO IV	5,00%	2.469.917,48	0,74%	2,00%	5,00%	5,00%	14.172.126,53
ARTIGO 8º, INCISO V	5,00%	1.115.180,22	0,34%	2,00%	5,00%	5,00%	15.526.863,79
ARTIGO 8º, INCISO VI	5,00%	1.528.500,00	0,46%	2,00%	5,00%	5,00%	15.113.544,01
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	41.535.258,77	12,48%	11,00%	25,00%	34,00%	
TOTAL INVESTIMENTOS		326.100.218,38					