

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
SETEMBRO 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 – Setembro de 2017**

ATIVOS RENDA FIXA	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	(%) INSTIT	VAR - MÊS
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.746.625,88	524.621,61	0	2.283.109,76	11.862,27	0,52%	0,63%	0,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.016.954,00	215.611,82	0	18.557.248,23	324.682,41	1,78%	1,78%	1,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	18.242.505,45	0	0	18.575.529,38	333.023,93	1,83%	1,83%	1,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	22.029.618,80	1.362.444,18	0	23.713.379,86	321.316,88	1,37%	1,37%	0,82%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.055.186,74	0	0	19.402.010,80	346.824,06	1,82%	1,82%	1,38%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA L...	1.981.094,76	0	0	2.006.502,02	25.407,26	1,28%	1,28%	0,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.521.481,17	0	0	21.734.938,27	213.457,10	0,99%	0,99%	0,65%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.706.758,50	0	215.611,82	20.605.088,89	113.942,21	0,55%	0,56%	0,01%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.100.966,25	800.000,00	835.807,56	6.101.653,68	36.494,99	0,53%	0,65%	0,03%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	21.178.473,40	0	0	21.388.961,62	210.488,22	0,99%	0,99%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.588.870,23	0	0	4.654.948,50	66.078,27	1,44%	1,44%	1,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.986.245,97	10.474.822,56	10.413.067,02	8.108.609,04	60.607,53	0,33%	0,57%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.411.587,23	0	0	6.468.758,28	57.171,05	0,89%	0,89%	0,49%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVAD...	3.277.208,86	0	0	3.318.327,02	41.118,16	1,25%	1,25%	0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.202.874,76	0	0	3.244.431,80	41.557,04	1,30%	1,30%	1,19%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.922.502,00	0	0	1.932.060,00	9.558,00	0,50%	0,50%	0,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	1.271.313,79	0	0	1.277.577,79	6.264,00	0,49%	0,49%	0,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	1.990.240,80	0	0	2.006.300,03	16.059,23	0,81%	0,81%	0,42%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.450.243,59	0	0	1.478.560,33	28.316,74	1,95%	1,95%	1,58%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0	650.000,00	0	650.853,43	853,43	0,13%	0,76%	0,21%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	926.695,46	0	0	936.103,10	9.407,64	1,02%	1,02%	0,71%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.561.690,02	0	0	6.657.369,18	95.679,16	1,46%	1,46%	1,29%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.521.934,33	0	0	2.566.817,24	44.882,91	1,78%	1,78%	1,39%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.335.838,32	0	0	12.397.440,86	61.602,54	0,50%	0,50%	0,28%

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.516.539,88	0	0	3.585.266,01	68.726,13	1,95%	1,95%	1,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.065.522,23	0	0	15.197.426,19	131.903,96	0,88%	0,88%	0,49%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0	550.000,00	0	550.654,65	654,65	0,12%	0,64%	0,02%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.448.952,20	0	0	2.461.397,40	12.445,20	0,51%	0,51%	0,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.812.146,98	0	0	17.065.684,63	253.537,65	1,51%	1,51%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.459.790,98	0	0	2.472.066,18	12.275,20	0,50%	0,50%	0,28%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.166.765,40	0	0	4.265.839,30	99.073,90	2,38%	2,38%	2,01%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.280.486,13	0	0	2.306.107,29	25.621,16	1,12%	1,12%	0,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.518.783,23	0	0	6.602.180,52	83.397,29	1,28%	1,28%	0,96%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO...	0	550.000,00	0	551.173,27	1.173,27	0,21%	0,75%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.753.067,82	0	0	5.795.330,99	42.263,17	0,73%	0,73%	0,40%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.946.896,35	0	0	1.965.488,81	18.592,46	0,95%	0,95%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.268.297,69	0	0	3.308.251,76	39.954,07	1,22%	1,22%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.557.529,54	0	0	10.610.206,64	52.677,10	0,50%	0,50%	0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	4.743.270,87	6.178.217,68	0	11.075.782,81	154.294,26	1,41%	1,51%	1,03%
TOTAL RENDA FIXA	284.564.959,61	21.305.717,85	11.464.486,40	297.879.435,56	3.473.244,50			
ATIVOS RENDA VARIÁVEL	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	(%) INSTIT	VAR - MÊS
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.758.681,80	0	0	4.924.681,45	165.999,65	3,49%	3,49%	6,20%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.840.096,93	0	0	1.932.008,23	91.911,30	4,99%	4,99%	4,85%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	8.160.090,79	0	0	8.354.149,64	194.058,85	2,38%	2,38%	5,21%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.314.324,67	466.414,41	0	14.472.166,79	691.427,71	5,02%	5,23%	5,13%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.629.350,78	0	0	1.743.192,26	113.841,48	6,99%	6,99%	6,16%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.528.500,00	0	11.250,00	1.649.955,00	132.705,00	8,68%	7,95%	11,30%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.415.868,19	4.000.000,00	0	5.543.559,96	127.691,77	2,36%	2,06%	2,22%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	484.473,66	500.000,00	0	1.019.028,17	34.554,51	3,51%	8,32%	7,28%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.115.180,22	0	0	1.127.722,60	12.542,38	1,12%	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.684.246,04	400.000,00	0	4.183.084,42	98.838,38	2,42%	2,79%	3,07%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMER...	1.054.049,29	0	0	1.071.767,92	17.718,63	1,68%	1,68%	1,24%

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

WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	2.550.396,40	650.000,00	0	3.324.679,52	124.283,12	3,88%	5,32%	6,36%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	41.535.258,77	6.016.414,41	11.250,00	49.345.995,96	1.805.572,78			
TOTAL GERAL	83.070.517,54	12.032.828,82	22.500,00	98.691.991,92	3.611.145,56			

- Comparação com a Meta Atuarial – Setembro 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%	0,50%	31,45%	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%
SETEMBRO	326.100.218,38	27.322.132,26	11.475.736,40	347.225.431,52	5.278.817,28	1,54%	0,44%	348,14%	1,37%
TOTAL					34.342.745,08	11,80%	5,74%	205,43%	

- **Enquadramento – Setembro de 2017**

ARTIGOS - RENDA FIXA	RESOLUÇÃO %	CARTEIRAB \$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2017		
				INFERIOR %	ALVO %	SUPERIOR %
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	156.026.008,25	44,94%	30,00%	35,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	62.627.023,14	18,04%	15,00%	20,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	72.344.851,83	20,84%	5,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	6.881.552,34	1,98%	0,00%	2,50%	5,00%
Total Renda Fixa	100,00%	297.879.435,56	85,79%	55,00%	75,00%	185,00%
ARTIGOS - RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO %	CARTEIRAB \$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2017		
				INFERIOR %	ALVO %	SUPERIOR %
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	4.924.681,45	1,42%	0,00%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	35.028.309,03	10,09%	5,00%	10,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	6.615.327,88	1,91%	2,00%	5,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.127.722,60	0,32%	2,00%	5,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.649.955,00	0,48%	2,00%	5,00%	5,00%
Total Renda Variável	30,00%	49.345.995,96	14,21%	11,00%	25,00%	34,00%
TOTAL		347.225.431,52				