

**RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS**  
**OUTUBRO 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 – Outubro de 2017**

<b>ATIVOS RENDA FIXA</b>	<b>SALDO ANTERIOR</b>	<b>APLICAÇÕES</b>	<b>RESGATES</b>	<b>SALDO ATUAL</b>	<b>RETORNO (R\$)</b>	<b>RETORNO (%)</b>	<b>(%) INSTIT</b>	<b>VAR - MÊS</b>
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.283.109,76	0	238.626,86	2.058.686,52	14.203,62	0,62%	0,65%	0,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.557.248,23	0	0	18.482.514,41	-74.733,82	-0,40%	-0,40%	1,82%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	18.575.529,38	800.000,00	0	19.291.103,59	-84.425,79	-0,44%	-0,42%	1,85%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	23.713.379,86	0	0	23.720.109,49	6.729,63	0,03%	0,03%	1,04%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.402.010,80	0	0	19.311.666,39	-90.344,41	-0,47%	-0,47%	1,88%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA L...	2.006.502,02	0	0	2.008.555,37	2.053,35	0,10%	0,10%	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.734.938,27	0	0	21.835.243,49	100.305,22	0,46%	0,46%	0,90%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.605.088,89	0	0	20.720.299,61	115.210,72	0,56%	0,56%	0,01%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.101.653,68	1.116.032,99	1.157.748,62	6.096.906,99	36.968,94	0,51%	0,65%	0,01%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	21.388.961,62	0	0	21.488.372,72	99.411,10	0,46%	0,46%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.654.948,50	0	0	4.654.837,86	-110,64	0,00%	0,00%	1,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	8.108.609,04	6.372.217,69	5.983.373,14	8.554.937,34	57.483,75	0,40%	0,58%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.468.758,28	400.000,00	0	6.917.847,06	49.088,78	0,71%	0,74%	0,59%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVAD...	3.318.327,02	0	0	3.332.816,38	14.489,36	0,44%	0,44%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.244.431,80	0	0	3.243.639,32	-792,48	-0,02%	-0,02%	1,58%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.932.060,00	0	0	1.948.794,00	16.734,00	0,87%	0,87%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	1.277.577,79	0	0	1.288.586,44	11.008,65	0,86%	0,86%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	2.006.300,03	0	0	2.022.686,87	16.386,84	0,82%	0,82%	0,52%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.478.560,33	0	0	1.469.261,78	-9.298,55	-0,63%	-0,63%	2,22%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	650.853,43	0	0	653.827,82	2.974,39	0,46%	0,46%	0,28%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	936.103,10	0	0	939.656,57	3.553,47	0,38%	0,38%	0,97%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.657.369,18	0	0	6.650.215,83	-7.153,35	-0,11%	-0,11%	1,83%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.566.817,24	0	0	2.555.307,55	-11.509,69	-0,45%	-0,45%	1,87%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.397.440,86	0	0	12.522.422,30	124.981,44	1,01%	1,01%	0,37%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.585.266,01	0	0	3.562.775,95	-22.490,06	-0,63%	-0,63%	2,22%

## PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.197.426,19	0	0	15.298.986,50	101.560,31	0,67%	0,67%	0,68%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	550.654,65	0	0	554.205,18	3.550,53	0,64%	0,64%	0,01%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.461.397,40	0	0	2.480.824,80	19.427,40	0,79%	0,79%	0,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	17.065.684,63	0	0	17.072.016,03	6.331,40	0,04%	0,04%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.472.066,18	0	0	2.496.826,26	24.760,08	1,00%	1,00%	0,37%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.265.839,30	0	0	4.221.291,53	-44.547,77	-1,04%	-1,04%	2,55%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.306.107,29	0	0	2.320.168,49	14.061,20	0,61%	0,61%	0,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.602.180,52	0	0	6.610.750,14	8.569,62	0,13%	0,13%	1,37%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO...	551.173,27	0	0	555.637,27	4.464,00	0,81%	0,81%	0,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.795.330,99	0	0	5.847.556,51	52.225,52	0,90%	0,90%	0,46%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.965.488,81	0	0	1.974.024,07	8.535,26	0,43%	0,43%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.308.251,76	0	0	3.308.588,56	336,8	0,01%	0,01%	1,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.610.206,64	0	0	10.716.963,42	106.756,78	1,01%	1,01%	0,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	11.075.782,81	800.000,00	0	11.877.883,75	2.100,94	0,02%	0,04%	1,21%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>297.879.435,56</b>	<b>9.488.250,68</b>	<b>7.379.748,62</b>	<b>300.666.794,16</b>	<b>678.856,54</b>			
<b>ATIVOS RENDA VARIÁVEL</b>	<b>SALDO ANTERIOR</b>	<b>APLICAÇÕES</b>	<b>RESGATES</b>	<b>SALDO ATUAL</b>	<b>RETORNO (R\$)</b>	<b>RETORNO (%)</b>	<b>(%) INSTIT</b>	<b>VAR - MÊS</b>
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.924.681,45	0	0	4.900.397,53	-24.283,92	-0,49%	-0,49%	7,61%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.932.008,23	800.000,00	0	2.673.105,70	-58.902,53	-2,16%	-1,57%	7,10%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	8.354.149,64	0	0	8.434.247,94	80.098,30	0,96%	0,96%	6,37%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.472.166,79	800.000,00	0	14.879.571,10	-392.595,69	-2,57%	-2,49%	7,65%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.743.192,26	0	0	1.696.368,67	-46.823,59	-2,69%	-2,69%	8,61%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.649.955,00	0	11.250,00	1.619.955,00	-18.750,00	-1,14%	-1,82%	16,35%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.543.559,96	500.000,00	0	6.199.883,28	156.323,32	2,59%	2,74%	2,25%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	1.019.028,17	0	0	1.008.985,35	-10.042,82	-0,99%	-0,99%	8,30%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.127.722,60	0	0	1.121.332,74	-6.389,86	-0,57%	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.183.084,42	0	0	4.158.570,57	-24.513,85	-0,59%	-0,59%	3,82%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMER...	1.071.767,92	0	0	1.075.982,10	4.214,18	0,39%	0,39%	1,51%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	3.324.679,52	800.000,00	0	4.103.743,68	-20.935,84	-0,51%	0,11%	7,87%

TOTAL RENDA VARIÁVEL	49.345.995,96	2.900.000,00	11.250,00	51.872.143,66				
TOTAL GERAL	347.225.431,52	12.388.250,68	7.390.998,62	352.538.937,82				

- **Comparação com a Meta Atuarial – Outubro 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%
Mai	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%
Outubro	347.225.431,52	12.388.250,68	7.390.998,62	<b>352.538.937,82</b>	316.254,24	0,09%	0,86%	10,46%	1,83%
TOTAL					<b>34.658.999,32</b>	<b>11,90%</b>	<b>6,65%</b>	<b>178,90%</b>	

