

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
NOVEMBRO 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 – Novembro de 2017**

PRODUTO / FUNDO	DISP.	CARÊNCIA	SALDO	PARTICIP. S/ TOTAL	QTDE. COTISTAS	% S/ PL DO FUNDO	RESOLUÇÃO - 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	15/08/2030	3.527.041,41	0,99%	26	1,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	D+1	Não há	17.094.241,95	4,81%	62	1,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	940.399,27	0,26%	79	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FII RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	2.502.161,86	0,70%	193	0,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RF	D+1	Não há	23.709.421,38	6,67%	55	3,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.142.857,52	0,88%	52	1,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.534.665,15	0,71%	1.462	3,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	D+0	Não há	4.658.854,80	1,31%	295	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.299.098,62	0,37%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.947.928,20	2,80%	236	2,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.305.401,50	0,93%	46	1,87%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RF	D+1	Não há	21.512.742,77	6,05%	352	1,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	20.905.146,75	5,88%	644	1,83%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	D+0	Não há	2.008.116,63	0,56%	199	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.587.951,92	1,85%	94	1,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	656.167,20	0,18%	823	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.306.498,87	4,30%	167	1,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	10.739.651,55	3,02%	100	0,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RF	D+2	Não há	4.160.796,34	1,17%	621	5,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	12.054.386,15	3,39%	80	1,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.070.101,01	0,58%	758	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.134.698,33	5,38%	104	1,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	15/08/2018	12.548.902,04	3,53%	223	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.024.394,17	0,57%	122	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	16/08/2018	1.964.790,00	0,55%	163	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	15/08/2030	1.454.504,47	0,41%	18	2,73%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+1	Não há	5.717.464,15	1,61%	11	6,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP	D+0	Não há	6.933.636,87	1,95%	613	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	D+0	Não há	21.854.745,51	6,14%	713	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.155.283,00	5,39%	71	23,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	16/08/2020	2.318.885,12	0,65%	107	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.974.937,58	0,56%	170	3,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	D+0	15/08/2024	6.592.757,99	1,85%	72	0,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RF REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.889.996,02	1,94%	1.414	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	18.339.268,11	5,16%	602	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	557.431,83	0,16%	4.131	0,15%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RF CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.489.436,00	0,70%	100	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RF CRÉDITO PRIVADO	D+91	Não há	559.830,48	0,16%	2	0,88%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.337.894,64	0,94%	60	0,79%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	3.853.162,03	1,08%	13	3,74%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.676.011,41	0,47%	43	1,47%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	992.728,94	0,28%	3.715	0,23%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	14.557.916,21	4,09%	1.697	3,49%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.972.203,66	1,12%	265	0,65%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	7.804.063,22	2,19%	251	24,64%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAM IBOV ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.580.328,52	1,29%	19.198	2,24%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.451.929,57	0,41%	3.253	0,39%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.634.508,79	0,74%	538	4,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIBOVESPA CÍCLICO I FIC MULT	D+2	Não há	1.074.847,53	0,30%	1.309	1,23%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.498.238,37	0,42%	33	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.405.253,85	1,80%	7.578	0,88%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.114.967,44	0,31%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.582.500,00	0,44%		0,94%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL			355.711.146,70				

- **Comparação com a Meta Atuarial – Novembro 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%
OUTUBRO	347.225.431,52	12.388.250,68	7.390.998,62	352.538.937,82	316.254,24	0,09%	0,86%	10,46%	1,83%
NOVEMBRO	352.538.937,82	11.480.615,88	6.234.614,36	355.711.146,70	-2.073.792,64	-0,58%	0,64%	-90,57%	2,08%
TOTAL					32.585.206,68	11,25%	7,33%	153,40%	

• **Enquadramento – Novembro de 2017**

ARTIGOS - RENDA FIXA	RESOLUÇÃO %	CARTEIRA \$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2017		
				INFERIOR %	ALVO%	SUPERIOR%
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA " B "	100,00%	0	0,00%	30,00%	35,00%	70,00%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA " A "	80,00%	0	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA " A "	30,00%	295.567.894,21	83,09%	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%	6.944.592,95	1,95%	0,00%	2,50%	5,00%
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	302.512.487,16	85,04%	55,00%	75,00%	185,00%
ARTIGOS - RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO %	CARTEIRA \$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2017		
				INFERIOR %	ALVO %	SUPERIOR %
ARTIGO 8º, INCISO I	0,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	4,00%
ARTIGO 8º, INCISO I, ALÍNEA " A "	30,00%	38.888.343,56	10,93%	0,00%	0,00%	0,00%
ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA " A "	20,00%	2.634.508,79	0,74%	0,00%	0,00%	0,00%
ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	8.978.339,75	2,52%	5,00%	10,00%	15,00%
ARTIGO 8º, INCISO IV	0,00%	0	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%
ARTIGO 8º, INCISO IV, ALÍNEA " A "	5,00%	1.114.967,44	0,31%	0,00%	0,00%	0,00%
ARTIGO 8º, INCISO IV, ALÍNEA " B "	5,00%	1.582.500,00	0,44%	0,00%	0,00%	0,00%
ARTIGO 8º, INCISO V	0,00%	0	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%
ARTIGO 8º, INCISO VI	0,00%	0	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	53.198.659,54	14,96%	11,00%	25,00%	34,00%
TOTAL		355.711.146,70				