

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
JANEIRO DE 2016



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 - Janeiro de 2016**

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR	Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.955.066,40	0	0	2.030.095,80	75.029,40	3,84%	2,12%	3,84%	
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.033.114,72	1.000.000,00	0	3.130.148,41	97.033,69	3,20%	2,70%	3,88%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.355.677,76	0	0	2.424.834,29	69.156,53	2,94%	1,83%	2,94%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.626.203,88	0	0	1.672.873,17	46.669,29	2,87%	1,67%	2,87%	
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	9.666.195,78	1.400.000,00	0	11.374.267,85	308.072,07	2,78%	1,70%	2,96%	
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.341.829,63	0	0	1.378.651,30	36.821,67	2,74%	2,29%	2,74%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.561.735,87	0	0	5.696.052,48	134.316,61	2,42%	2,35%	2,42%	
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.119.842,76	0	0	1.146.608,91	26.766,15	2,39%	3,34%	2,39%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.185.199,78	0	0	26.807.435,20	622.235,42	2,38%	1,34%	2,38%	
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.015.794,91	1.400.000,00	0	2.468.333,60	52.538,69	2,17%	1,69%	2,91%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.142.022,64	0	0	10.341.574,31	199.551,67	1,97%	1,27%	1,97%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	6.982.563,99	0	0	7.119.388,25	136.824,26	1,96%	1,28%	1,96%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.558.736,85	0	0	2.607.360,19	48.623,34	1,90%	2,47%	1,90%	
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	10.638.556,25	0	0	10.839.960,72	201.404,47	1,89%	2,12%	1,89%	
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0	1.000.000,00	0	1.018.761,34	18.761,34	1,88%	2,15%	3,22%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.591.750,70	0	0	15.873.416,04	281.665,34	1,81%	0,72%	1,81%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	8.014.648,50	0	0	8.156.073,25	141.424,75	1,76%	2,13%	1,76%	
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	1.009.070,72	0	0	1.026.697,00	17.626,28	1,75%	2,15%	1,75%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0	1.000.000,00	0	1.016.820,30	16.820,30	1,68%	2,54%	3,56%	
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0	1.000.000,00	0	1.016.701,51	16.701,51	1,67%	3,32%	2,36%	
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.797.339,00	0	0	1.824.207,00	26.868,00	1,49%	0,12%	1,49%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.191.027,22	0	0	1.208.514,34	17.487,12	1,47%	0,11%	1,47%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.964.487,32	0	0	1.992.164,04	27.676,72	1,41%	0,50%	1,41%	
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.583.169,43	1.000.000,00	0	3.626.412,48	43.243,05	1,21%	2,52%	1,57%	
ITAÚ IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	2.706.637,19	0	0	2.738.016,25	31.379,06	1,16%	3,14%	1,16%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	5.341.630,19	0	0	5.400.951,98	59.321,79	1,11%	3,16%	1,11%	
BB IMAB 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.943.130,01	0	0	1.964.618,44	21.488,43	1,11%	3,15%	1,11%	
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	2.445.803,55	0	0	2.470.519,26	24.715,71	1,01%	3,20%	1,01%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.249.788,55	0	0	3.281.723,37	31.934,82	0,98%	0,01%	0,98%	
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.092.997,96	600.000,00	686.586,25	2.025.800,63	19.388,92	0,72%	0,01%	1,05%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0	4.401.053,52	0	4.421.541,87	20.488,35	0,47%	0,01%	1,05%	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.365.426,89	10.053.970,93	14.441.879,52	24.704,59	47.186,29	0,33%	0,00%	0,99%	
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.083.227,35	0	0	4.081.778,16	-1.449,19	-0,04%	4,72%	-0,04%	
DAYCOVAL IDKA20 FI RENDA FIXA	1.365.403,84	0	0	1.364.281,44	-1.122,40	-0,08%	4,70%	-0,08%	
Total Renda Fixa					2.916.649,45	1,94%	1,74%		

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR	Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	1.940.802,53	0	1.962.521,34	21.718,81	1,12%	0,08%		1,12%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.079.380,25	0	1.075.296,57	-4.083,68	-0,38%	9,07%		-0,38%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.529.385,69	0	6.496.582,69	-32.803,00	-0,50%	10,77%		-0,50%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.017.258,58	0	1.011.026,00	-6.232,58	-0,61%	10,28%		-0,61%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	774.615,04	0	768.909,36	-5.705,68	-0,74%	-		-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	4.879.855,95	1.000.000,00	5.560.159,46	-319.696,49	-5,44%	13,53%		-7,02%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	6.526.998,60	0	6.003.405,55	-523.593,05	-8,02%	14,55%		-8,02%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.200.000,00	0	1.080.000,00	-107.604,48	-8,97%	-		-10,00%
			Total					
			Renda Variável	-978.000,15	-3,92%	11,44%		

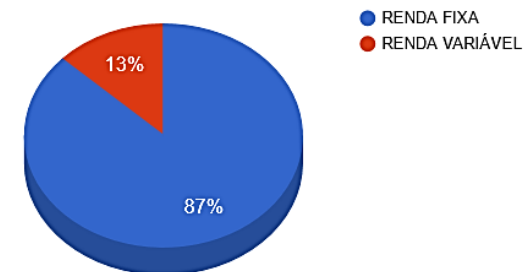
• **Comparação com a Meta Atuarial – Janeiro de 2016**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	166.876.376,28	23.855.024,45	15.140.861,29	177.529.188,74	1.938.649,30	1,10%	1,98%	55,75%	2,96%
Acumulado no ano					1.938.649,30	1,10%	1,98%	55,75%	

• **Enquadramento – Janeiro de 2016**

Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	20,00%	0,00	0,00%	50.113.995,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	136.861.279,60	54,62%	38.537.703,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	41.842.990,46	16,70%	58.385.000,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	35.515.397,75	14,17%	39.655.595,16
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.528.498,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.528.498,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.819.826,49	1,52%	8.708.672,33
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	218.039.494,30	87,02%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	9.108.113,30	3,63%	15.948.884,34
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	21.052.939,95	8,40%	16.532.556,50
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.528.498,82
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	794.908,80	0,32%	11.733.590,02
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.574.520,00	0,63%	10.953.978,82
Total Renda Variável	30,00%	40,00	32.530.482,05	12,98%	

Distribuição por Artigo / Resolução

