

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
FEVEREIRO 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 - Fevereiro de 2016**

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|------------------|------------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3.626.412,48 | 1.000.000,0 0 | 121.996,80 | 4.655.697,56 | 151.281,88 | 3,27% | 6,66% | 0,36% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.696.052,48 | 0 | 299.562,97 | 5.567.334,53 | 170.845,02 | 3,00% | 3,09% | 3,06% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.607.360,19 | 0 | 0 | 2.685.094,09 | 77.733,90 | 2,98% | 3,19% | 2,98% |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1.378.651,30 | 0 | 0 | 1.416.108,26 | 37.456,96 | 2,72% | 2,57% | 2,72% |
| ITAÚ IMAB 5+ FIC RENDA FIXA | 2.738.016,25 | 0 | 0 | 2.811.972,27 | 73.956,02 | 2,70% | 4,39% | 2,70% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA | 5.400.951,98 | 0 | 0 | 5.543.448,53 | 142.496,55 | 2,64% | 4,38% | 2,64% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.964.618,44 | 0 | 0 | 2.016.046,52 | 51.428,08 | 2,62% | 4,30% | 2,62% |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.146.608,91 | 0 | 35.980,87 | 1.140.595,44 | 29.967,40 | 2,61% | 6,50% | -0,52% |
| BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA | 2.470.519,26 | 0 | 0 | 2.533.371,80 | 62.852,54 | 2,54% | 4,35% | 2,54% |
| GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA | 1.026.697,00 | 0 | 0 | 1.050.624,23 | 23.927,23 | 2,33% | 3,30% | 2,33% |
| ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA | 10.839.960,72 | 0 | 0 | 11.080.485,61 | 240.524,89 | 2,22% | 3,11% | 2,22% |
| BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4.081.778,16 | 0 | 0 | 4.171.927,08 | 90.148,92 | 2,21% | 5,74% | 2,21% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA | 8.156.073,25 | 0 | 0 | 8.333.399,46 | 177.326,21 | 2,17% | 3,10% | 2,17% |
| DAYCOVAL IDKA20 FI RENDA FIXA | 1.364.281,44 | 0 | 0 | 1.393.933,64 | 29.652,20 | 2,17% | 5,73% | 2,17% |
| CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.016.701,51 | 1.000.000,0 0 | 34.253,29 | 2.019.596,77 | 37.148,55 | 1,84% | 6,80% | -0,77% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.424.834,29 | 0 | 70.552,74 | 2.395.801,49 | 41.519,94 | 1,71% | 1,69% | 1,73% |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.016.820,30 | 1.000.000,0 0 | 30.999,21 | 2.020.010,05 | 34.188,96 | 1,70% | 5,94% | -0,41% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1.992.164,04 | 0 | 0 | 2.025.480,43 | 33.316,39 | 1,67% | 1,12% | 1,67% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA | 7.119.388,25 | 0 | 0 | 7.236.461,89 | 117.073,64 | 1,64% | 1,56% | 1,64% |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.341.574,31 | 0 | 0 | 10.511.624,62 | 170.050,31 | 1,64% | 1,56% | 1,64% |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.824.207,00 | 0 | 51.520,44 | 1.802.401,50 | 29.714,94 | 1,63% | 4,87% | -1,20% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.208.514,34 | 0 | 35.284,75 | 1.192.528,51 | 19.298,92 | 1,60% | 0,27% | 1,62% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 26.807.435,20 | 0 | 775.789,24 | 26.440.281,61 | 408.635,65 | 1,52% | 1,33% | 1,54% |

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

| | | | | | | | | |
|---|---------------|------------|------------|-------------------------|---------------------|--------------|--------------|--------|
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 11.374.267,85 | 0 | 0 | 11.547.268,29 | 173.000,44 | 1,52% | 1,45% | 1,52% |
| CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2.468.333,60 | 0 | 0 | 2.505.672,29 | 37.338,69 | 1,51% | 1,44% | 1,51% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3.130.148,41 | 0 | 0 | 4.190.521,46 | 60.373,05 | 1,46% | 2,17% | 1,81% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.672.873,17 | 0 | 0 | 1.695.824,83 | 22.951,66 | 1,37% | 1,37% | 1,37% |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.018.761,34 | 0 | 30.111,88 | 1.002.445,28 | 13.795,82 | 1,35% | 5,50% | -1,60% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 2.030.095,80 | 0 | 0 | 2.051.303,40 | 21.207,60 | 1,04% | 1,34% | 1,04% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 15.873.416,04 | 0 | 452.425,38 | 15.580.862,47 | 159.871,81 | 1,01% | 0,58% | 1,02% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 4.421.541,87 | 0 | 0 | 1.456.208,20 | 34.666,33 | 0,78% | 0,01% | 0,99% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.281.723,37 | 8 | 0 | 4.952.959,96 | 37.621,51 | 0,77% | 0,01% | 0,91% |
| SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 2.025.800,63 | 600.000,00 | 681.652,66 | 1.960.884,86 | 16.736,89 | 0,64% | 0,01% | 0,98% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 24.704,59 | 6 | 1 | 3.553.541,44 | 32.233,90 | 0,61% | 0,00% | 0,94% |
| | | | | Total Renda Fixa | 2.860.342,80 | 1,81% | 2,32% | |

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%)) | VaR | Mês (%) | Instituição(%)) |
|---|---------------|------------|-----------|-----------------------------|-------------------|---------------|-----|--------------|------------------|
| BB PIPE FIC AÇÕES | 1.075.296,57 | 0 | 0 | 1.120.889,57 | 45.593,00 | 4,24% | | 6,43% | 4,24% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11 | 1.080.000,00 | 0 | 11.250,00 | 1.110.000,00 | 41.250,00 | 3,82% | - | | 2,78% |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES | 5.560.159,46 | 0 | 0 | 5.682.615,14 | 122.455,68 | 2,20% | | 10,06% | 2,20% |
| GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESA ATIVO FI AÇÕES | 6.003.405,55 | 0 | 0 | 6.132.343,90 | 128.938,35 | 2,15% | | 11,17% | 2,15% |
| BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES | 1.011.026,00 | 0 | 0 | 1.031.854,22 | 20.828,22 | 2,06% | | 9,19% | 2,06% |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 6.496.582,69 | 0 | 0 | 6.601.278,47 | 104.695,78 | 1,61% | | 9,39% | 1,61% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO | 1.962.521,34 | 0 | 0 | 1.982.993,42 | 20.472,08 | 1,04% | | 0,13% | 1,04% |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | 768.909,36 | 40.000,00 | 0 | 742.808,72 | -66.100,64 | -8,17% | - | | - |
| | | | | Total Renda Variável | 418.132,47 | 1,74% | | 9,07% | |

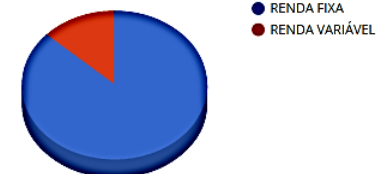
- **Comparação com a Meta Atuarial – Fevereiro de 2016**

| 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% |
| Fevereiro | 177.529.188,74 | 11.525.355,54 | 7.386.517,74 | 184.946.501,81 | 3.278.475,27 | 1,80% | 1,39% | 129,41% | 3,15% |
| Acumulado no ano | | | | | 5.217.124,57 | 2,93% | 3,40% | 86,07% | |

• **Enquadramento –Fevereiro de 2016**

| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-------------------------------------|----------------|----------------|-----------------------|---------------|---------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " | 100,00% | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 36.989.300,36 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 70,00% | 105.251.412,23 | 56,91% | 24.211.139,04 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00% | 40,00% | 32.193.795,49 | 17,41% | 41.784.805,23 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 30,00% | 30,00% | 19.629.098,99 | 10,61% | 35.854.851,55 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 9.247.325,09 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 9.247.325,09 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 5,00% | 3.467.411,66 | 1,87% | 5.779.913,43 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 175,00% | 160.541.718,37 | 86,80% | |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável | Resolução | Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-----------------------------|---------------|---------------|----------------------|---------------|---------------|
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 10,00% | 6.132.343,90 | 3,32% | 12.362.306,28 |
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 15,00% | 14.436.637,40 | 7,81% | 13.305.337,87 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 5,00% | 1.982.993,42 | 1,07% | 7.264.331,67 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 5,00% | 742.808,72 | 0,40% | 8.504.516,37 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 5,00% | 1.110.000,00 | 0,60% | 8.137.325,09 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 40,00% | 24.404.783,44 | 13,20% | |

Distribuição por Artigos

