

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
MARÇO 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 - Março de 2016**

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR	Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.171.927,08		0	4.708.132,15	536.205,07	12,85%		14,39%	12,85%
DAYCOVAL IDKA20 FI RENDA FIXA	1.393.933,64		0	1.571.903,07	177.969,43	12,77%		14,35%	12,77%
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	2.533.371,80		0	2.750.783,53	217.411,73	8,58%		10,28%	8,58%
BB IMAB 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.016.046,52		0	2.185.070,89	169.024,37	8,38%		10,26%	8,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	5.543.448,53		0	6.000.735,49	457.286,96	8,25%		10,24%	8,25%
ITAÚ IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	2.811.972,27		0	3.043.228,42	231.256,15	8,22%		10,21%	8,22%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.140.595,44		0	1.229.936,17	89.340,73	7,83%		9,37%	7,83%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.019.596,77	800.000,00		2.994.345,29	174.748,52	6,20%		9,31%	7,77%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	11.080.485,61		0	11.676.431,85	595.946,24	5,38%		6,93%	5,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	8.333.399,46		0	8.756.779,99	423.380,53	5,08%		6,87%	5,08%
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	1.050.624,23		0	1.101.042,02	50.417,79	4,80%		7,35%	4,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.025.480,43		0	2.102.780,84	77.300,41	3,82%		3,79%	3,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.685.094,09		0	2.786.534,09	101.440,00	3,78%		6,00%	3,78%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.655.697,56	800.000,00		5.655.731,72	200.034,16	3,67%		6,69%	4,05%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.511.624,62		0	10.862.482,35	350.857,73	3,34%		3,14%	3,34%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	7.236.461,89		0	7.476.137,30	239.675,41	3,31%		3,26%	3,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.567.334,53		0	5.721.814,30	154.479,77	2,77%		5,48%	2,77%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.051.303,40		0	2.100.630,60	49.327,20	2,40%		1,28%	2,40%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.416.108,26		0	1.441.067,37	24.959,11	1,76%		3,99%	1,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.192.528,51		0	1.206.695,40	14.166,89	1,19%		0,12%	1,19%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.802.401,50		0	1.823.649,00	21.247,50	1,18%		0,13%	1,18%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.456.208,20		0	1.473.365,59	17.157,39	1,18%		0,04%	1,18%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.020.010,05		0	2.042.548,05	22.538,00	1,12%		3,86%	1,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.952.959,96		0	5.005.179,17	52.219,21	1,05%		0,01%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.440.281,61		0	26.709.861,57	269.579,96	1,02%		1,83%	1,02%

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.580.862,47	0	0	15.711.170,21	130.307,74	0,84%	0,55%	0,84%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.960.884,86	596.535,51	612.867,84	1.965.595,95	21.043,42	0,82%	0,01%	1,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.395.801,49	0	0	2.414.823,07	19.021,58	0,79%	2,27%	0,79%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	11.547.268,29	0	0	11.633.242,43	85.974,14	0,74%	1,84%	0,74%
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.505.672,29	0	0	2.524.081,95	18.409,66	0,73%	1,83%	0,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.695.824,83	0	0	1.706.294,31	10.469,48	0,62%	1,84%	0,62%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.553.541,44	5.585.227,86	4.260.000,00	4.932.339,04	53.569,74	0,59%	0,00%	1,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.190.521,46	1.000.000,00	0	5.216.648,86	26.127,40	0,50%	2,67%	0,63%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.002.445,28	0	0	1.006.575,45	4.130,17	0,41%	2,21%	0,41%
Total Renda Fixa					5.087.023,59	3,09%	4,13%	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR	Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.110.000,00	0	11.625,00	1.229.970,00	131.595,00	11,86%	-	-	9,76%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.031.854,22	0	0	1.134.799,42	102.945,20	9,98%	-	10,35%	9,98%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.601.278,47	0	0	7.205.047,94	603.769,47	9,15%	-	11,26%	9,15%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.120.889,57	0	0	1.212.758,27	91.868,70	8,20%	-	8,29%	8,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	1.982.993,42	0	0	2.008.780,77	25.787,35	1,30%	-	0,28%	1,30%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	742.808,72	0	0	736.862,62	-5.946,10	-0,80%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	5.682.615,14	300.000,00	0	5.677.785,84	-304.829,30	-5,10%	-	13,52%	-5,27%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	6.132.343,90	300.000,00	0	6.102.454,14	-329.889,76	-5,13%	-	12,88%	-5,29%
Total Renda Variável					315.300,56	1,26%		11,09%	

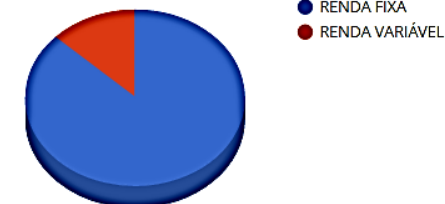
- **Comparação com a Meta Atuarial – Março de 2016**

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%
Março	184.946.501,81	9.381.763,37	4.884.492,84	194.846.096,49	5.402.324,15	2,85%	0,95%	299,47%	4,97%
Acumulado no ano					10.619.448,72	5,86%	4,39%	133,66%	

• **Enquadramento – Março 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%	38.969.219,30
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	110.789.715,81	56,86%	25.602.551,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	33.910.084,63	17,40%	44.028.353,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	21.296.139,08	10,93%	37.157.689,87
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	9.742.304,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	9.742.304,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.541.697,97	1,82%	6.200.606,85
Total Renda Fixa	100,00%	175,00%	169.537.637,49	87,01%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução	Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	6.102.454,14	3,13%	13.382.155,51
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	15.230.391,47	7,82%	13.996.523,00
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	2.008.780,77	1,03%	7.733.524,05
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	736.862,62	0,38%	9.005.442,20
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.229.970,00	0,63%	8.512.334,82
Total Renda Variável	30,00%	40,00%	25.308.459,00	12,99%	

Distribuição por Artigos

