

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS

ABRIL 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 - Abril 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	4.708.132,15	0	0	5.045.089,79	336.957,64	7,16%	7,16%	7,16%
DAYCOVAL IDKA20 FI RENDA FIXA	1.571.903,07	0	0	1.683.399,77	111.496,70	7,09%	7,23%	7,09%
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	2.750.783,53	0	0	2.900.362,48	149.578,95	5,44%	5,55%	5,44%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.185.070,89	0	0	2.302.224,38	117.153,49	5,36%	5,53%	5,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	6.000.735,49	0	0	6.315.111,79	314.376,30	5,24%	5,47%	5,24%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.229.936,17	0	0	1.283.824,21	53.888,04	4,38%	5,27%	4,38%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.994.345,29	0	0	3.125.376,47	131.031,18	4,38%	5,25%	4,38%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3.043.228,42	0	3.170.151,62	0	126.923,20	4,17%	5,55%	5,31%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	8.756.779,99	0	0	9.113.655,21	356.875,22	4,08%	4,06%	4,08%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.655.731,72	0	0	5.881.023,49	225.291,77	3,98%	4,76%	3,98%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	11.676.431,85	0	0	12.139.743,91	463.312,06	3,97%	3,92%	3,97%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1.101.042,02	0	0	1.144.686,04	43.644,02	3,96%	4,02%	3,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.786.534,09	0	0	2.886.736,71	100.202,62	3,60%	4,18%	3,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.721.814,30	0	0	5.911.380,34	189.566,04	3,31%	3,76%	3,31%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	7.476.137,30	0	0	7.700.353,11	224.215,81	3,00%	2,15%	3,00%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.441.067,37	0	0	1.477.454,78	36.387,41	2,53%	2,67%	2,53%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.042.548,05	0	0	2.089.410,33	46.862,28	2,29%	2,73%	2,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.216.648,86	0	0	5.321.598,46	104.949,60	2,01%	1,89%	2,01%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.006.575,45	0	0	1.026.031,75	19.456,30	1,93%	1,34%	1,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.102.780,84	4.170.151,62	0	6.392.931,77	119.999,31	1,91%	2,36%	3,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.414.823,07	0	0	2.457.170,78	42.347,71	1,75%	1,50%	1,75%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.862.482,35	0	10.700.000,00	345.195,60	182.713,25	1,68%	2,03%	2,93%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.706.294,31	0	0	1.733.890,14	27.595,83	1,62%	1,22%	1,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.709.861,57	0	0	27.120.862,07	411.000,50	1,54%	1,19%	1,54%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	11.633.242,43	0	0	11.810.521,54	177.279,11	1,52%	1,24%	1,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.473.365,59	0	0	1.489.060,97	15.695,38	1,07%	0,02%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.524.081,95	11.700.000,00	0	14.361.791,15	137.709,20	0,97%	1,25%	1,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.005.179,17	0	0	5.051.389,23	46.210,06	0,92%	0,03%	0,92%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.823.649,00	0	0	1.840.251,00	16.602,00	0,91%	0,07%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.206.695,40	0	0	1.217.678,04	10.982,64	0,91%	0,06%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.711.170,21	0	0	15.849.072,57	137.902,36	0,88%	0,35%	0,88%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.965.595,95	0	710.480,70	1.269.930,20	14.814,95	0,75%	0,01%	1,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.932.339,04	6.138.755,55	3.945.093,64	7.202.804,09	76.803,14	0,69%	0,00%	0,99%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.100.630,60	0	0	2.114.227,80	13.597,20	0,65%	1,59%	0,65%
Total Renda Fixa					4.583.421,27	2,65%	2,36%	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.205.047,94	440.000,00	0	8.016.601,62	371.553,68	4,86%	10,97%	5,12%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.134.799,42	0	0	1.179.997,15	45.197,73	3,98%	9,09%	3,98%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	5.677.785,84	220.000,00	0	6.086.733,96	188.948,12	3,20%	10,86%	3,23%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.212.758,27	0	0	1.248.879,89	36.121,62	2,98%	7,94%	2,98%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	6.102.454,14	220.000,00	0	6.484.602,08	162.147,94	2,56%	11,41%	2,59%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.229.970,00	0	0	1.255.500,00	25.530,00	2,08%	-	3,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	2.008.780,77	0	0	2.032.958,90	24.178,13	1,20%	0,18%	1,20%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	736.862,62	0	0	731.440,84	-5.421,78	-0,74%	-	-
Total Renda Variável					848.255,44	3,24%	9,94%	

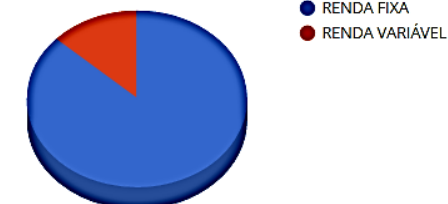
- Comparação com a Meta Atuarial – Abril de 2016**

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%
Abril	194.846.096,49	22.888.907,17	18.525.725,96	204.640.954,41	5.431.676,71	2,73%	1,11%	246,42%	3,30%
Acumulado no ano					16.051.125,43	8,75%	5,54%	157,88%	

• **Enquadramento – Abril 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%	40.928.190,88
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	111.392.911,36	54,43%	31.855.756,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	35.268.864,02	17,23%	46.587.517,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	27.350.782,01	13,37%	34.041.504,31
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	10.232.047,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	10.232.047,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.591.682,58	1,76%	6.640.365,14
Total Renda Fixa	100,00%	175,00%	177.604.239,97	86,79%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução	Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	6.484.602,08	3,17%	13.979.493,36
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	16.532.212,62	8,08%	14.163.930,54
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	2.032.958,90	0,99%	8.199.088,82
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	731.440,84	0,36%	9.500.606,88
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.255.500,00	0,61%	8.976.547,72
Total Renda Variável	30,00%	40,00%	27.036.714,44	13,21%	

Distribuição por Artigos

