

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
MAIO 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 - Maio 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	2.114.227,80	0	0	2.145.726,00	31.498,20	1,49%	0,85%	1,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.849.072,57	0	0	16.061.813,21	212.740,64	1,34%	0,20%	1,34%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.840.251,00	0	0	1.862.991,00	22.740,00	1,24%	1,88%	1,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.217.678,04	0	0	1.232.546,13	14.868,09	1,22%	0,17%	1,22%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.489.060,97	0	0	1.505.511,01	16.450,04	1,10%	0,01%	1,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.051.389,23	82.653,76	0	5.188.506,33	54.463,34	1,06%	0,04%	1,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.120.862,07	0	0	27.381.697,43	260.835,36	0,96%	0,85%	0,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.361.791,15	0	0	14.473.445,70	111.654,55	0,78%	0,91%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.457.170,78	0	0	2.475.877,15	18.706,37	0,76%	2,00%	0,76%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.026.031,75	0	0	1.033.152,86	7.121,11	0,69%	0,96%	0,69%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.202.804,09	5.851.399,00	5.840.712,63	7.300.461,90	86.971,44	0,67%	0,04%	1,04%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	11.810.521,54	1.610.000,00	0	13.508.749,54	88.228,00	0,66%	1,40%	0,78%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.269.930,20	700.000,00	742.865,84	1.238.775,37	11.711,01	0,59%	0,01%	1,12%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.881.023,49	0	0	5.913.837,47	32.813,98	0,56%	-	0,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.886.736,71	0	82.653,76	2.818.528,06	14.445,11	0,50%	4,26%	0,45%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	7.700.353,11	0	0	7.736.274,45	35.921,34	0,47%	1,96%	0,47%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.477.454,78	0	0	1.484.337,19	6.882,41	0,47%	2,85%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.911.380,34	0	0	5.935.606,71	24.226,37	0,41%	2,94%	0,41%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	345.195,60	0	0	346.522,92	1.327,32	0,38%	1,79%	0,38%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.089.410,33	0	0	2.096.492,01	7.081,68	0,34%	-	0,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.733.890,14	1.610.000,00	0	3.354.078,22	10.188,08	0,30%	1,28%	0,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.392.931,77	0	0	6.400.629,65	7.697,88	0,12%	-	0,12%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1.144.686,04	0	0	1.143.669,76	-1.016,28	-0,09%	4,56%	-0,09%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.125.376,47	0	0	3.122.554,67	-2.821,80	-0,09%	-	-0,09%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.283.824,21	0	0	1.282.609,26	-1.214,95	-0,09%	6,41%	-0,09%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	9.113.655,21	0	0	9.099.645,71	-14.009,50	-0,15%	3,66%	-0,15%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.139.743,91	0	0	12.114.098,93	-25.644,98	-0,21%	3,52%	-0,21%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.302.224,38	0	0	2.286.410,36	-15.814,02	-0,69%	6,45%	-0,69%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	6.315.111,79	0	0	6.264.509,70	-50.602,09	-0,80%	6,48%	-0,80%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	2.900.362,48	0	0	2.876.829,33	-23.533,15	-0,81%	5,03%	-0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.321.598,46	3.139.653,65	3.139.653,65	5.200.251,51	-121.346,95	-1,43%	4,84%	-2,28%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.045.089,79	0	0	4.951.417,50	-93.672,29	-1,86%	8,75%	-1,86%
DAYCOVAL IDKA20 FI RENDA FIXA	1.683.399,77	0	0	1.650.968,44	-32.431,33	-1,93%	10,18%	-1,93%
Total Renda Fixa					696.464,98	0,39%	2,25%	

**PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES
DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ**

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.255.500,00	0	0	1.395.000,00	139.500,00	11,11%	16,57%	9,60%	
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	2.032.958,90	0	0	2.053.474,59	20.515,69	1,01%	0,11%	1,01%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	731.440,84	0	0	725.550,25	-5.890,59	-0,81%	-	-	
BB PIPE FIC AÇÕES	1.248.879,89	0	0	1.228.943,46	-19.936,43	-1,60%	6,78%	-1,60%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.179.997,15	0	0	1.156.440,25	-23.556,90	-2,00%	6,37%	-2,00%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.016.601,62	500.000,00	0	8.282.715,54	-233.886,08	-2,75%	7,36%	-2,69%	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	6.086.733,96	0	0	5.610.384,58	-476.349,38	-7,83%	8,67%	-7,83%	
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	6.484.602,08	500.000,00	0	6.428.354,56	-56.247,52	-7,96%	8,67%	-8,11%	
Total Renda Variável					-1.155.851,21	-4,12%	7,82%		

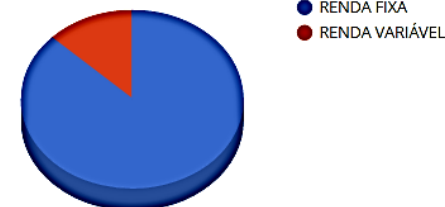
- Comparação com a Meta Atuarial – Maio de 2016**

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%
Maio	204.640.954,41	13.993.706,41	9.805.885,88	208.369.388,71	-459.386,23	-0,22%	1,47%	-14,95%	3,01%
Acumulado no ano					15.591.739,20	8,51%	7,10%	119,95%	

• **Enquadramento – Maio 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%	41.673.877,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	115.095.984,05	55,24%	30.762.588,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	35.214.528,79	16,90%	48.133.226,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	27.547.949,45	13,22%	34.962.867,16
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	10.418.469,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	10.418.469,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.630.063,19	1,74%	6.788.406,25
Total Renda Fixa	100,00%	175,00%	181.488.525,48	87,10%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução	Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	6.428.354,56	3,09%	14.408.584,31
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	16.278.483,83	7,81%	14.976.924,48
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	2.053.474,59	0,99%	8.364.994,85
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	725.550,25	0,35%	9.692.919,19
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.395.000,00	0,67%	9.023.469,44
Total Renda Variável	30,00%	40,00%	26.880.863,23	12,90%	

Distribuição por Artigos

