

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
JUNHO 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 - Junho 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 | 4.951.417,50 | 0 | 0 | 5.161.790,34 | 210.372,84 | 4,25% | 3,87% | 4,25% |
| BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA | 2.876.829,33 | 0 | 0 | 2.957.773,40 | 80.944,07 | 2,81% | 3,04% | 2,81% |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.282.609,26 | 0 | 0 | 1.317.640,90 | 35.031,64 | 2,73% | 2,66% | 2,73% |
| CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3.122.554,67 | 0 | 0 | 3.207.795,61 | 85.240,94 | 2,73% | 2,65% | 2,73% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | 6.264.509,70 | 0 | 0 | 6.429.717,25 | 165.207,55 | 2,64% | 3,15% | 2,64% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.286.410,36 | 0 | 0 | 2.344.781,00 | 58.370,64 | 2,55% | 3,15% | 2,55% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 9.099.645,71 | 0 | 0 | 9.276.555,30 | 176.909,59 | 1,94% | 2,41% | 1,94% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 6.400.629,65 | 500.000,00 | 0 | 7.033.268,64 | 132.638,99 | 1,92% | 1,58% | 2,01% |
| DAYCOVAL IDKA20 FI RENDA FIXA | 1.650.968,44 | 0 | 0 | 1.682.360,25 | 31.391,81 | 1,90% | 3,41% | 1,90% |
| ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA | 12.114.098,93 | 153.741,02 | 0 | 12.495.859,89 | 228.019,94 | 1,86% | 2,28% | 1,88% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA | 7.736.274,45 | 0 | 0 | 7.880.042,29 | 143.767,84 | 1,86% | 1,33% | 1,86% |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 346.522,92 | 0 | 0 | 352.618,51 | 6.095,59 | 1,76% | 1,22% | 1,76% |
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA | 1.143.669,76 | 0 | 0 | 1.162.887,81 | 19.218,05 | 1,68% | 2,63% | 1,68% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 16.061.813,21 | 0 | 0 | 16.265.369,74 | 203.556,53 | 1,27% | 0,26% | 1,27% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.188.506,33 | 0 | 0 | 5.249.211,90 | 60.705,57 | 1,17% | 0,11% | 1,17% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1.505.511,01 | 0 | 0 | 1.522.904,36 | 17.393,35 | 1,16% | 0,01% | 1,16% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.232.546,13 | 0 | 0 | 1.246.381,49 | 13.835,36 | 1,12% | 0,09% | 1,12% |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.862.991,00 | 0 | 0 | 1.883.712,00 | 20.721,00 | 1,11% | 0,10% | 1,11% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 2.145.726,00 | 0 | 0 | 2.169.298,80 | 23.572,80 | 1,10% | 0,73% | 1,10% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 27.381.697,43 | 0 | 0 | 27.662.540,37 | 280.842,94 | 1,03% | 0,94% | 1,03% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 14.473.445,70 | 0 | 0 | 14.606.322,97 | 132.877,27 | 0,92% | 1,11% | 0,92% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.475.877,15 | 0 | 0 | 2.498.343,25 | 22.466,10 | 0,91% | 1,21% | 0,91% |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1.484.337,19 | 0 | 0 | 1.497.629,06 | 13.291,87 | 0,90% | 2,18% | 0,90% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3.354.078,22 | 0 | 0 | 3.383.514,15 | 29.435,93 | 0,88% | 1,11% | 0,88% |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.033.152,86 | 0 | 0 | 1.041.646,39 | 8.493,53 | 0,82% | 1,27% | 0,82% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 5.200.251,51 | 0 | 0 | 5.242.648,63 | 42.397,12 | 0,82% | 1,56% | 0,82% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 7.300.461,90 | 6.012.624,86 | 3.960.000,00 | 9.459.206,94 | 106.120,18 | 0,80% | 0,00% | 1,09% |
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA | 13.508.749,54 | 2.300.000,00 | 0 | 15.926.075,68 | 117.326,14 | 0,74% | 1,11% | 0,92% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 5.913.837,47 | 0 | 0 | 5.957.322,40 | 43.484,93 | 0,74% | 3,24% | 0,74% |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2.096.492,01 | 0 | 0 | 2.110.801,78 | 14.309,77 | 0,68% | 2,10% | 0,68% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.935.606,71 | 0 | 0 | 5.974.213,06 | 38.606,35 | 0,65% | 2,76% | 0,65% |
| SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.238.775,37 | 700.276,85 | 707.204,34 | 1.244.119,77 | 12.271,89 | 0,63% | 0,01% | 1,18% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.818.528,06 | 0 | 0 | 2.832.795,74 | 14.267,68 | 0,51% | 3,19% | 0,51% |
| Total Renda Fixa | | | | | 2.589.185,80 | 1,39% | 1,51% | |

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|------------|-----------|--------------|---------------------|--------------|---------------|----------------|
| BB PIPE FIC AÇÕES | 1.228.943,46 | 0 | 0 | 1.316.327,93 | 87.384,47 | 7,11% | 8,66% | 7,11% |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES | 5.610.384,58 | 0 | 0 | 5.959.027,46 | 348.642,88 | 6,21% | 11,24% | 6,21% |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 8.282.715,54 | 0 | 0 | 8.794.168,28 | 511.452,74 | 6,17% | 8,21% | 6,17% |
| BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES | 1.156.440,25 | 0 | 0 | 1.219.685,47 | 63.245,22 | 5,47% | 7,62% | 5,47% |
| GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | 6.428.354,56 | 0 | 0 | 6.724.894,60 | 296.540,04 | 4,61% | 11,37% | 4,61% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 1.395.000,00 | 0 | 14.850,00 | 1.410.000,00 | 29.850,00 | 2,14% | - | 1,39% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO | 2.053.474,59 | 0 | 0 | 2.076.374,24 | 22.899,65 | 1,12% | 0,12% | 1,12% |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | 725.550,25 | 0 | 0 | 699.798,54 | -25.751,71 | -3,55% | - | - |
| Total Renda Variável | | | | | 1.334.263,29 | 4,96% | 9,07% | |

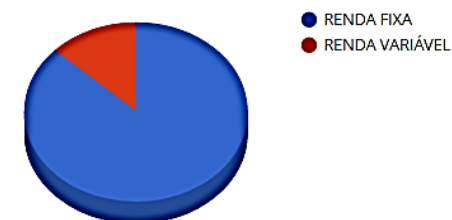
• **Comparação com a Meta Atuarial – Junho de 2016**

| 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% |
| Mai | 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% |
| Junho | 208.369.388,71 | 9.666.642,73 | 4.682.054,34 | 217.277.426,19 | 3.923.449,09 | 1,84% | 0,98% | 187,19% | 2,43% |
| Acumulado no ano | | | | | 19.515.188,29 | 10,51% | 8,15% | 128,96% | |
| Acumulado no 2º Trimestre | | | | | 8.895.739,57 | 4,39% | 3,60% | 121,75% | |

• **Enquadramento – Junho 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% | 43.455.485,24 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 70,00% | 118.856.446,24 | 54,70% | 33.237.752,09 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00% | 40,00% | 36.082.174,73 | 16,61% | 50.828.795,75 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 30,00% | 30,00% | 30.471.600,84 | 14,02% | 34.711.627,02 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 10.863.871,31 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 10.863.871,31 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 5,00% | 3.666.927,86 | 1,69% | 7.196.943,45 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 175,00% | 189.077.149,67 | 87,02% | |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável | Resolução | Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-----------------------------|---------------|---------------|----------------------|---------------|---------------|
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 10,00% | 6.724.894,60 | 3,10% | 15.002.848,02 |
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 15,00% | 17.289.209,14 | 7,96% | 15.302.404,79 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 5,00% | 2.076.374,24 | 0,96% | 8.787.497,07 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 5,00% | 699.798,54 | 0,32% | 10.164.072,77 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 5,00% | 1.410.000,00 | 0,65% | 9.453.871,31 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 40,00% | 28.200.276,52 | 12,98% | |

Distribuição por Artigos

