

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%	

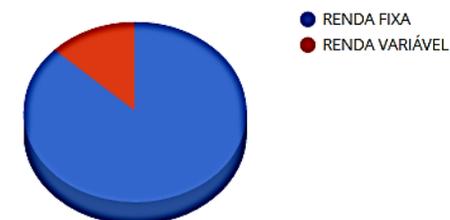
• **Comparação com a Meta Atuarial – Junho de 2016**

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

