

**RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS**  
**JULHO 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 - Julho 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	5.161.790,34	0	0	5.401.647,14	239.856,80	4,65%	4,51%	4,65%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	6.429.717,25	0	0	6.644.105,12	214.387,87	3,33%	2,91%	3,33%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.344.781,00	0	0	2.422.942,95	78.161,95	3,33%	2,90%	3,33%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	2.957.773,40	500.000,00	0	3.565.787,43	108.014,03	3,12%	2,88%	3,31%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1.162.887,81	0	0	1.192.767,97	29.880,16	2,57%	1,99%	2,57%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.317.640,90	0	0	1.350.841,56	33.200,66	2,52%	2,51%	2,52%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.207.795,61	0	0	3.288.586,41	80.790,80	2,52%	2,50%	2,52%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.495.859,89	0	0	12.800.497,11	304.637,22	2,44%	1,90%	2,44%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	9.276.555,30	500.000,00	0	10.010.987,84	234.432,54	2,40%	1,95%	2,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.832.795,74	0	0	2.897.522,95	64.727,21	2,28%	1,64%	2,28%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.957.322,40	0	0	6.089.903,16	132.580,76	2,23%	1,94%	2,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.974.213,06	0	0	6.093.355,97	119.142,91	1,99%	1,53%	1,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.033.268,64	0	0	7.151.286,27	118.017,63	1,68%	1,20%	1,68%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	7.880.042,29	0	0	8.012.207,65	132.165,36	1,68%	1,07%	1,68%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	352.618,51	0	0	358.412,29	5.793,78	1,64%	0,93%	1,64%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.110.801,78	0	0	2.144.514,35	33.712,57	1,60%	1,35%	1,60%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.497.629,06	0	0	1.521.402,14	23.773,08	1,59%	1,19%	1,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.662.540,37	0	0	28.019.209,67	356.669,30	1,29%	0,53%	1,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.498.343,25	0	0	2.529.660,16	31.316,91	1,25%	0,76%	1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.606.322,97	0	0	14.780.265,77	173.942,80	1,19%	0,67%	1,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.265.369,74	0	0	16.449.518,54	184.148,80	1,13%	0,12%	1,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.522.904,36	0	0	1.539.792,24	16.887,88	1,11%	0,01%	1,11%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	15.926.075,68	1.200.000,00	0	17.315.886,46	189.810,78	1,11%	0,67%	1,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.383.514,15	0	0	3.420.935,92	37.421,77	1,11%	0,70%	1,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.249.211,90	0	0	5.304.527,84	55.315,94	1,05%	0,01%	1,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.242.648,63	0	0	5.294.611,12	51.962,49	0,99%	1,08%	0,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.246.381,49	0	0	1.257.231,33	10.849,84	0,87%	0,02%	0,87%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.883.712,00	0	0	1.899.900,00	16.188,00	0,86%	0,03%	0,86%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	9.459.206,94	5.838.703,37	12.960.000,00	2.446.085,44	108.175,13	0,71%	0,00%	1,04%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.244.119,77	1.300.276,85	794.844,98	1.764.300,21	14.748,57	0,58%	0,01%	1,12%
DAYCOVAL IDKA20 FI RENDA FIXA	1.682.360,25	0	1.691.439,23	0	9.078,98	0,54%	-	-
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0	1.691.439,23	0	1.698.895,62	7.456,39	0,44%	0,72%	1,11%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.169.298,80	0	0	2.177.265,60	7.966,80	0,37%	0,83%	0,37%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.041.646,39	8.000.000,00	0	9.059.690,65	18.044,26	0,20%	0,78%	0,99%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.243.259,97</b>	<b>1,68%</b>	<b>1,15%</b>	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	5.959.027,46	0	0	6.615.341,20	656.313,74	11,01%	6,76%	11,01%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVSPA ATIVO FI AÇÕES	6.724.894,60	500.000,00	0	7.958.188,35	733.293,75	10,15%	6,50%	10,61%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.316.327,93	0	0	1.428.003,31	111.675,38	8,48%	5,30%	8,48%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.794.168,28	500.000,00	0	10.035.484,21	741.315,93	7,98%	4,94%	8,27%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.219.685,47	0	0	1.303.662,29	83.976,82	6,89%	4,08%	6,89%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.410.000,00	0	17.970,00	1.432.500,00	40.470,00	2,87%	-	4,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	2.076.374,24	0	0	2.099.193,33	22.819,09	1,10%	0,13%	1,10%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	699.798,54	0	0	693.554,48	-6.244,06	-0,89%	-	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>2.383.620,65</b>	<b>8,17%</b>	<b>5,41%</b>	

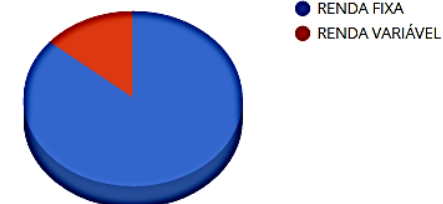
• **Comparação com a Meta Atuarial – Julho de 2016**

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%
Maior	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%
Julho	217.277.426,19	20.030.419,45	15.464.254,21	227.470.472,05	5.626.880,62	2,54%	1,13%	224,49%	1,71%
<b>Acumulado no ano</b>					<b>25.142.068,91</b>	<b>13,31%</b>	<b>9,37%</b>	<b>142,05%</b>	

• **Enquadramento – Julho 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%	45.494.094,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	130.477.433,14	57,36%	28.751.897,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	37.467.797,72	16,47%	53.520.391,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	24.260.646,28	10,67%	43.980.495,34
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.373.523,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.373.523,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.698.667,74	1,63%	7.674.855,86
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>175,00%</b>	<b>195.904.544,88</b>	<b>86,12%</b>	

**Distribuição por Segmento**



Artigos - Renda Variável	Resolução	Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	7.958.188,35	3,50%	14.788.858,86
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	19.382.491,01	8,52%	14.738.079,80
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	2.099.193,33	0,92%	9.274.330,27
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	693.554,48	0,30%	10.679.969,12
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.432.500,00	0,63%	9.941.023,60
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>31.565.927,17</b>	<b>13,88%</b>	

**Distribuição por Artigos**

