

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
AGOSTO 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 - Agosto 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	2.177.265,60	0	0	2.215.990,80	38.725,20	1,78%	0,71%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.288.586,41	0	95.054,62	3.242.527,04	48.995,25	1,49%	5,09%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.350.841,56	0	36.199,37	1.334.764,80	20.122,61	1,49%	4,80%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.521.402,14	0	0	1.543.479,86	22.077,72	1,45%	1,24%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.089.903,16	0	174.485,29	5.999.739,21	84.321,34	1,38%	5,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.897.522,95	0	0	2.936.884,29	39.361,34	1,36%	1,57%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.059.690,65	0	261.787,30	8.914.408,68	116.505,33	1,29%	4,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.093.355,97	0	197.423,24	5.971.967,18	76.034,45	1,25%	1,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.420.935,92	0	0	3.462.533,81	41.597,89	1,22%	0,73%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.144.514,35	0	64.703,83	2.105.722,25	25.911,73	1,21%	5,22%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.539.792,24	0	0	1.558.378,62	18.586,38	1,21%	0,01%
ITAU INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.294.611,12	0	0	5.354.558,84	59.947,72	1,13%	0,95%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	8.012.207,65	0	0	8.102.395,22	90.187,57	1,13%	1,08%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.698.895,62	0	0	1.717.871,57	18.975,95	1,12%	0,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.529.660,16	0	698.166,35	1.859.465,04	27.971,23	1,11%	0,90%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	17.315.886,46	0	0	17.505.650,01	189.763,55	1,10%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.257.231,33	0	35.417,95	1.235.377,13	13.563,75	1,08%	0,12%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.899.900,00	0	52.696,58	1.867.525,50	20.322,08	1,07%	4,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.780.265,77	0	0	14.938.095,71	157.829,94	1,07%	0,80%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	358.412,29	0	0	362.079,51	3.667,22	1,02%	0,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.019.209,67	0	14.242.275,77	14.046.238,18	269.304,28	0,96%	0,87%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	10.010.987,84	0	0	10.103.208,21	92.220,37	0,92%	1,97%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	6.644.105,12	0	0	6.701.097,82	56.992,70	0,86%	2,57%
ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.800.497,11	0	0	12.909.919,31	109.422,20	0,85%	1,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.449.518,54	0	14.247.519,17	2.327.837,71	125.838,34	0,76%	0,55%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3.565.787,43	0	0	3.592.581,89	26.794,46	0,75%	2,55%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.764.300,21	800.000,00	868.499,15	1.714.034,22	18.233,16	0,71%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1.192.767,97	0	0	1.200.800,78	8.032,81	0,67%	2,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.304.527,84	29.420.802,48	29.000.000,00	5.932.499,17	207.168,85	0,60%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.446.085,44	6.382.512,68	4.760.000,00	4.121.247,65	52.649,53	0,60%	0,00%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.151.286,27	5.112.546,12	0	12.321.903,96	58.071,57	0,47%	1,18%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.401.647,14	0	0	5.407.713,17	6.066,03	0,11%	3,93%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.422.942,95	9.000.000,00	0	11.422.411,02	-531,93	0,00%	2,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0	10.000.000,00	0	9.996.022,71	-3.977,29	-0,04%	0,77%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0	10.000.000,00	0	9.982.764,04	-17.235,96	-0,17%	1,90%
Total Renda Fixa				2.123.517,37	1,05%	1,73%	

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	1.432.500,00	0	12.000,00	1.470.000,00	49.500,00	3,46%	2,55%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	6.615.341,20	0	0	6.810.374,54	195.033,34	2,95%	2,95%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	7.958.188,35	0	0	8.023.625,23	65.436,88	0,82%	0,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	2.099.193,33	0	2.112.546,12	0	13.352,79	0,64%	1,22%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	693.554,48	0	0	686.557,45	-6.997,03	-1,01%	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.303.662,29	0	0	1.267.923,51	-35.738,78	-2,74%	-2,74%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.035.484,21	500.000,00	0	10.203.663,00	-331.821,21	-3,15%	-3,14%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.428.003,31	0	0	1.369.659,19	-58.344,12	-4,09%	-4,09%
Total Renda Variável					-109.578,13	-0,35%	7,46%

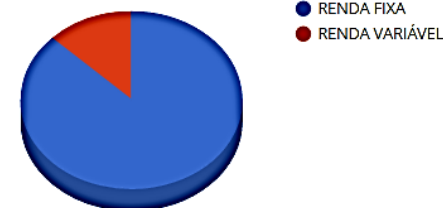
- Comparação com a Meta Atuarial – Agosto de 2016**

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%
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%
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%
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%
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%
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%
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%
Agosto	227.470.472,05	71.215.861,28	66.858.774,74	233.841.497,83	2.013.939,24	0,87%	0,84%	102,82%
Acumulado no ano					27.156.008,15	14,29%	10,29%	138,86%

• **Enquadramento – Agosto 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%	46.768.299,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	130.745.753,15	55,91%	32.943.295,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	37.816.620,56	16,17%	55.719.978,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	31.687.850,54	13,55%	38.464.598,81
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.692.074,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.692.074,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.759.470,66	1,61%	7.932.604,23
Total Renda Fixa	100,00%	175,00%	204.009.694,91	87,24%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução	Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	8.023.625,23	3,43%	15.360.524,55
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	19.651.620,24	8,40%	15.424.604,43
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.692.074,89
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	686.557,45	0,29%	11.005.517,44
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.470.000,00	0,63%	10.222.074,89
Total Renda Variável	30,00%	40,00%	29.831.802,92	12,76%	

Distribuição por Artigos



