

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
SETEMBRO 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 - Setembro de 2016**

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.407.713,17	0	0	5.525.083,26	117.370,09	2,17%	4,41%	2,17%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.543.479,86	0	0	1.570.520,18	27.040,32	1,75%	1,41%	1,75%
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	1.200.800,78	0	0	1.221.818,37	21.017,59	1,75%	2,52%	1,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.354.558,84	0	0	5.447.951,08	93.392,24	1,74%	0,83%	1,74%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	8.102.395,22	0	0	8.240.514,53	138.119,31	1,70%	1,46%	1,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.321.903,96	1.140.000,00	0	13.690.745,42	228.841,46	1,70%	1,65%	1,81%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3.592.581,89	0	0	3.651.610,48	59.028,59	1,64%	3,11%	1,64%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	6.701.097,82	340.000,00	0	7.156.774,25	115.676,43	1,64%	3,17%	1,68%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.422.411,02	340.000,00	0	11.953.652,15	191.241,13	1,63%	3,13%	1,64%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	10.103.208,21	570.000,00	0	10.846.340,94	173.132,73	1,62%	2,40%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	362.079,51	0	0	367.801,43	5.721,92	1,58%	1,25%	1,58%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.909.919,31	570.000,00	0	13.692.148,09	212.228,78	1,57%	2,38%	1,61%
BB IMAB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.982.764,04	0	0	10.138.873,31	156.109,27	1,56%	2,30%	1,56%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.105.722,25	0	0	2.136.532,79	30.810,54	1,46%	1,26%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.859.465,04	0	0	1.885.556,18	26.091,14	1,40%	0,81%	1,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.046.238,18	0	0	14.242.543,31	196.305,13	1,40%	0,97%	1,40%
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.938.095,71	680.000,00	0	15.829.772,97	211.677,26	1,36%	0,78%	1,40%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	17.505.650,01	680.000,00	0	18.431.326,28	245.676,27	1,35%	0,78%	1,39%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.914.408,68	0	0	9.033.979,34	119.570,66	1,34%	0,46%	1,34%
DAYCOVAL IMAB 5 FI RENDA FIXA	1.717.871,57	0	0	1.740.913,54	23.041,97	1,34%	0,79%	1,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.996.022,71	0	0	10.129.972,88	133.950,17	1,34%	0,46%	1,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.327.837,71	0	0	2.358.888,76	31.051,05	1,33%	0,46%	1,33%

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

CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.462.533,81	0	0	3.508.623,47	46.089,66	1,33%	0,55%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.971.967,18	0	0	6.051.208,97	79.241,79	1,33%	1,77%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.936.884,29	0	0	2.974.781,01	37.896,72	1,29%	2,13%	1,29%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.999.739,21	0	0	6.067.267,16	67.527,95	1,13%	2,21%	1,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.558.378,62	0	0	1.575.584,42	17.205,80	1,10%	0,02%	1,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.932.499,17	340.000,00	340.000,00	5.994.558,71	62.059,54	0,99%	0,02%	1,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.215.990,80	0	0	2.236.946,40	20.955,60	0,95%	0,59%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.235.377,13	0	0	1.245.327,02	9.949,89	0,81%	0,07%	0,81%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.867.525,50	0	0	1.882.393,50	14.868,00	0,80%	0,06%	0,80%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.121.247,65	5.984.159,23	5.929.954,81	4.248.409,69	72.957,62	0,72%	0,00%	1,04%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.242.527,04	0	0	3.263.935,16	21.408,12	0,66%	2,77%	0,66%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.334.764,80	0	0	1.343.573,95	8.809,15	0,66%	2,77%	0,66%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.714.034,22	1.200.584,61	803.987,36	2.125.581,54	14.950,07	0,51%	0,00%	1,11%
Total Renda Fixa				3.031.013,96		1,45%	1,54%	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%))	VaR	Mês (%)	Instituição(%))
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.470.000,00	0	12.000,00	1.483.500,00	25.500,00	1,73%	-	-0,46%	
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.023.625,23	0	0	8.099.656,22	76.030,99	0,95%	11,43%	0,95%	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	6.810.374,54	0	0	6.870.335,64	59.961,10	0,88%	10,52%	0,88%	
BB PIPE FIC AÇÕES	1.369.659,19	0	0	1.363.263,05	-6.396,14	-0,47%	7,45%	-0,47%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.203.663,00	0	0	10.082.281,26	-121.381,74	-1,19%	8,00%	-1,19%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	686.557,45	120.000,00	0	795.496,61	-11.060,84	-1,37%	-	-	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.267.923,51	0	0	1.249.297,01	-18.626,50	-1,47%	7,87%	-1,47%	
Total Renda Variável				4.026,87		0,01%	9,60%		

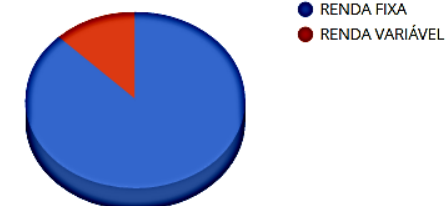
- **Comparação com a Meta Atuarial – Setembro de 2016**

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%
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%
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%	2,42%
Setembro	233.841.497,83	11.964.743,84	7.085.942,17	241.755.340,33	3.035.040,83	1,27%	0,57%	224,17%	2,47%
Acumulado no ano					30.191.048,98	15,75%	10,92%	144,22%	

• **Enquadramento – Setembro 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%	48.351.068,07
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	134.330.884,84	55,56%	34.897.853,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	39.935.777,81	16,52%	56.766.358,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	33.737.381,31	13,96%	38.789.220,79
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.087.767,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.087.767,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.807.466,58	1,57%	8.280.300,44
Total Renda Fixa	100,00%	175,00%	211.811.510,54	87,61%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução	Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	8.099.656,22	3,35%	16.075.877,81
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	19.565.176,96	8,09%	16.698.124,09
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.087.767,02
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	795.496,61	0,33%	11.292.270,41
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.483.500,00	0,61%	10.604.267,02
Total Renda Variável	30,00%	40,00%	29.943.829,79	12,39%	

Distribuição por Artigos

