

**RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS**  
**OUTUBRO 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 - Outubro de 2016**

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.575.584,42	0	0	1.592.111,46	16.527,04	1,05%	0,01%	1,05%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	8.240.514,53	230.744,56	0	8.556.382,91	85.123,82	1,00%	1,28%	1,03%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	367.801,43	0	0	371.441,68	3.640,25	0,99%	1,15%	0,99%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.525.083,26	0	0	5.577.316,45	52.233,19	0,95%	4,51%	0,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	13.690.745,42	1.153.722,81	0	14.982.267,04	137.798,81	0,93%	1,50%	1,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.994.558,71	461.489,11	461.489,11	6.054.287,80	59.729,09	0,93%	0,01%	0,99%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.263.935,16	0	0	3.291.951,90	28.016,74	0,86%	3,02%	0,86%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.343.573,95	0	0	1.355.083,35	11.509,40	0,86%	3,02%	0,86%
BGT PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3.651.610,48	0	0	3.676.448,07	24.837,59	0,68%	3,10%	0,68%
BB IMAB 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.953.652,15	461.489,11	0	12.499.082,50	83.941,24	0,68%	3,11%	0,72%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	10.846.340,94	692.233,67	0	11.613.032,66	74.458,05	0,65%	2,35%	0,70%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.125.581,54	1.245.076,62	1.145.237,95	2.246.843,26	21.423,05	0,64%	0,01%	1,05%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	13.692.148,09	0	0	13.777.543,53	85.395,44	0,62%	2,32%	0,62%
BB IMAB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.138.873,31	0	0	10.202.067,69	63.194,38	0,62%	2,28%	0,62%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.882.393,50	0	0	1.893.759,00	11.365,50	0,60%	0,16%	0,60%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	7.156.774,25	692.233,67	0	7.896.031,36	47.023,44	0,60%	3,16%	0,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.245.327,02	0	0	1.252.696,44	7.369,42	0,59%	0,16%	0,59%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.570.520,18	0	0	1.578.992,09	8.471,91	0,54%	1,15%	0,54%
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	1.221.818,37	692.233,67	0	1.923.804,02	9.751,98	0,51%	2,36%	0,86%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.248.409,69	6.071.180,46	5.862.504,59	4.505.808,71	48.723,15	0,47%	0,00%	0,98%
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.829.772,97	346.116,83	0	16.248.672,99	72.783,19	0,45%	0,74%	0,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.242.543,31	0	0	14.306.567,97	64.024,66	0,45%	0,91%	0,45%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.136.532,79	0	0	2.146.077,13	9.544,34	0,45%	1,03%	0,45%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	18.431.326,28	346.116,83	0	18.858.941,34	81.498,23	0,43%	0,74%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.051.208,97	0	0	6.077.464,10	26.255,13	0,43%	1,50%	0,43%

## PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.974.781,01	0	0	2.987.624,04	12.843,03	0,43%	1,76%	0,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.508.623,47	0	0	3.523.659,29	15.035,82	0,43%	0,67%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.885.556,18	0	0	1.893.605,39	8.049,21	0,43%	0,82%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.358.888,76	0	0	2.368.520,48	9.631,72	0,41%	0,70%	0,41%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.033.979,34	0	0	9.070.129,16	36.149,82	0,40%	0,70%	0,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.129.972,88	0	0	10.170.483,25	40.510,37	0,40%	0,70%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.447.951,08	0	0	5.469.140,24	21.189,16	0,39%	0,74%	0,39%
DAYCOVAL IMAB 5 FI RENDA FIXA	1.740.913,54	0	0	1.747.579,79	6.666,25	0,38%	0,78%	0,38%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.067.267,16	0	0	6.083.242,81	15.975,65	0,26%	2,03%	0,26%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.236.946,40	0	0	2.240.834,40	3.888,00	0,17%	0,80%	0,17%
				Total Retorno Renda Fixa	1.304.578,07	0,60%	1,52%	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR Mês (%)	Instituição(%)
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.099.656,22	0	0	9.108.113,30	1.008.457,08	12,45%	5,99%	12,45%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	6.870.335,64	0	0	7.582.423,46	712.087,82	10,36%	6,16%	10,36%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.483.500,00	0	12.000,00	1.574.520,00	103.020,00	6,94%	15,91%	6,14%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.082.281,26	0	0	10.717.774,07	635.492,81	6,30%	5,31%	6,30%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.363.263,05	0	0	1.445.708,15	82.445,10	6,05%	4,97%	6,05%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.249.297,01	0	0	1.307.034,27	57.737,26	4,62%	4,89%	4,62%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	795.496,61	0	0	794.908,80	-587,81	-0,07%	-	-
				Total Retorno Renda Variável	2.598.652,26	8,68%	6,20%	

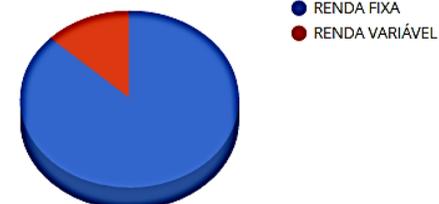
• **Comparação com a Meta Atuarial – Outubro de 2016**

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%
Outubro	241.755.340,33	12.392.637,34	7.481.231,65	250.569.976,35	3.903.230,33	1,58%	0,63%	249,47%	2,12%
Acumulado no ano					34.094.279,31	17,58%	11,62%	151,24%	

• **Enquadramento – Outubro 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%	50.113.995,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	136.861.279,60	54,62%	38.537.703,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	41.842.990,46	16,70%	58.385.000,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	35.515.397,75	14,17%	39.655.595,16
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.528.498,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.528.498,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.819.826,49	1,52%	8.708.672,33
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>175,00%</b>	<b>218.039.494,30</b>	<b>87,02%</b>	

**Distribuição por Segmento**



Artigos - Renda Variável	Resolução	Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	9.108.113,30	3,63%	15.948.884,34
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	21.052.939,95	8,40%	16.532.556,50
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.528.498,82
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	794.908,80	0,32%	11.733.590,02
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.574.520,00	0,63%	10.953.978,82
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>32.530.482,05</b>	<b>12,98%</b>	

**Distribuição por Artigos**

