

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
NOVEMBRO 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 -Novembro de 2016**

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR Mês (%)	Instituição (%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0	3.000.000,00	0	3.046.667,35	46.667,35	1,56%	3,50%	-0,24%
ITAÚ IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	0	600.000,00	0	607.189,15	7.189,15	1,20%	6,46%	-2,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.592.111,46	0	0	1.608.820,57	16.709,11	1,05%	0,03%	1,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.054.287,80	83.140,34	3.000.000,00	3.185.442,07	48.013,93	0,78%	0,01%	0,98%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.893.759,00	0	0	1.907.898,00	14.139,00	0,75%	0,05%	0,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.252.696,44	0	0	1.261.891,01	9.194,57	0,73%	0,05%	0,73%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.246.843,26	800.000,00	685.897,92	2.383.126,65	22.181,31	0,73%	0,02%	1,06%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.240.834,40	0	0	2.257.029,00	16.194,60	0,72%	0,95%	0,72%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.070.129,16	2.790.000,00	0	11.943.379,33	83.250,17	0,70%	1,07%	0,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.368.520,48	0	0	2.384.651,28	16.130,80	0,68%	0,99%	0,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.170.483,25	0	0	10.238.780,87	68.297,62	0,67%	1,00%	0,67%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.523.659,29	0	0	3.543.771,79	20.112,50	0,57%	1,27%	0,57%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.505.808,71	5.852.598,94	8.050.000,00	2.362.165,55	53.757,90	0,52%	0,00%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.893.605,39	0	0	1.901.270,90	7.665,51	0,40%	1,66%	0,40%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	18.858.941,34	0	0	18.932.467,66	73.526,32	0,39%	1,64%	0,39%
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.248.672,99	600.000,00	0	16.913.655,76	64.982,77	0,39%	1,65%	0,38%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.578.992,09	0	0	1.583.881,01	4.888,92	0,31%	2,61%	0,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0	1.356.305,63	0	1.360.477,66	4.172,03	0,31%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.306.567,97	0	0	14.349.447,99	42.880,02	0,30%	1,96%	0,30%
DAYCOVAL IMAB 5 FI RENDA FIXA	1.747.579,79	0	0	1.752.688,92	5.109,13	0,29%	1,82%	0,29%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	371.441,68	400.000,00	0	773.127,49	1.685,81	0,22%	2,44%	0,04%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.146.077,13	0	0	2.148.312,43	2.235,30	0,10%	2,41%	0,10%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	8.556.382,91	0	0	8.547.126,63	-9.256,28	-0,11%	2,67%	-0,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.077.464,10	0	0	6.070.197,96	-7.266,14	-0,12%	3,36%	-0,12%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.083.242,81	0	0	6.071.380,48	-11.862,33	-0,20%	4,11%	-0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.987.624,04	0	83.140,34	2.897.841,89	-6.641,81	-0,22%	3,66%	-0,18%

PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE GUARUJÁ

ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.982.267,04	0	0	14.948.095,17	-34.171,87	-0,23%	3,22%	-0,23%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	13.777.543,53	1.200.000,00	0	14.819.371,92	-158.171,61	-1,06%	4,86%	-1,25%
BB IMAB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.202.067,69	0	0	10.073.836,37	-128.231,32	-1,26%	4,79%	-1,26%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	11.613.032,66	0	0	11.465.973,43	-147.059,23	-1,27%	4,90%	-1,27%
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	1.923.804,02	0	0	1.899.166,45	-24.637,57	-1,28%	4,92%	-1,28%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.291.951,90	0	0	3.235.951,02	-56.000,88	-1,70%	5,78%	-1,70%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.355.083,35	0	0	1.332.007,28	-23.076,07	-1,70%	5,78%	-1,70%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3.676.448,07	0	0	3.598.476,89	-77.971,18	-2,12%	6,45%	-2,12%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	7.896.031,36	0	0	7.728.158,26	-167.873,10	-2,13%	6,51%	-2,13%
BB IMAB 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.499.082,50	0	0	12.232.903,96	-266.178,54	-2,13%	6,20%	-2,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.469.140,24	0	0	5.334.773,93	-134.366,31	-2,46%	5,20%	-2,46%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.577.316,45	0	0	5.378.393,22	-198.923,23	-3,57%	9,13%	-3,57%
Total Retorno Renda Fixa					-822.703,65	-0,37%	3,25%	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR Mês (%)	Instituição (%)
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	794.908,80	0	0	789.281,37	-5.627,43	-0,71%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.574.520,00	0	12.000,00	1.462.500,00	-100.020,00	-6,35%	-	-7,11%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVSPA ATIVO FI AÇÕES	9.108.113,30	0	0	8.489.784,82	-618.328,48	-6,79%	15,37%	-6,79%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.307.034,27	0	0	1.215.592,99	-91.441,28	-7,00%	10,01%	-7,00%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.445.708,15	0	0	1.321.640,60	-124.067,55	-8,58%	10,88%	-8,58%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.717.774,07	0	0	9.725.948,74	-991.825,33	-9,25%	11,91%	-9,25%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.582.423,46	0	0	6.763.961,64	-818.461,82	-10,79%	15,01%	-10,79%
Total Retorno Renda Variável					-2.749.771,89	-8,45%	13,61%	

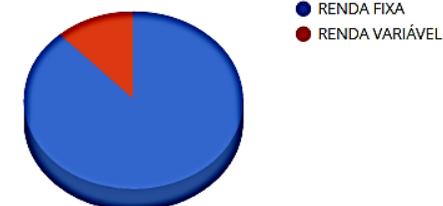
• **Comparação com a Meta Atuarial – Novembro de 2016**

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%
Novembro	250.569.976,35	16.682.044,91	11.831.038,26	251.848.507,46	-3.572.475,54	-1,40%	0,53%	-262,00%	4,40%
Acumulado no ano					30.521.803,77	15,93%	12,22%	130,41%	

• **Enquadramento – Novembro 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%	50.369.701,49
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	143.762.498,48	57,08%	32.531.456,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	42.560.630,24	16,90%	58.178.772,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	31.915.758,57	12,67%	43.638.793,67
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.592.425,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.592.425,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.840.910,01	1,53%	8.751.515,36
Total Renda Fixa	100,00%	175,00%	222.079.797,30	88,18%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução	Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	8.489.784,82	3,37%	16.695.065,93
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	19.027.143,97	7,55%	18.750.132,15
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.592.425,37
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	789.281,37	0,31%	11.803.144,00
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.462.500,00	0,58%	11.129.925,37
Total Renda Variável	30,00%	40,00%	29.768.710,16	11,82%	

Distribuição por Artigos

