

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
JANEIRO DE 2017



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 – Janeiro de 2017**

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Inst(%)
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.682.094,81	0	0	5.842.654,85	160.560,04	2,83%	6,26%	2,83%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	8.017.835,29	0	0	8.201.132,55	183.297,26	2,29%	4,55%	2,29%
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3.729.730,81	0	0	3.812.660,85	82.930,04	2,22%	4,50%	2,22%
BB IMAB 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.728.780,64	0	0	15.047.672,04	318.891,40	2,17%	4,50%	2,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.265.227,69	0	0	15.588.573,70	323.346,01	2,12%	2,04%	2,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.389.132,16	0	0	1.418.492,30	29.360,14	2,11%	2,04%	2,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	8.718.059,12	0	0	8.885.057,56	166.998,44	1,92%	1,67%	1,92%
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	1.952.906,26	0	0	1.990.097,75	37.191,49	1,90%	3,45%	1,90%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.344.038,15	0	0	3.406.422,06	62.383,91	1,87%	3,75%	1,87%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.376.474,15	0	0	1.402.125,83	25.651,68	1,86%	3,75%	1,86%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.248.527,91	0	0	15.531.727,08	283.199,17	1,86%	3,34%	1,86%
BB IMAB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.364.999,92	0	0	10.556.161,20	191.161,28	1,84%	3,34%	1,84%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.177.016,81	0	0	6.286.381,30	109.364,49	1,77%	3,03%	1,77%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	787.913,72	0	0	801.744,17	13.830,45	1,76%	1,57%	1,76%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	11.810.341,85	2.500.000,00	0	14.536.337,95	225.996,10	1,58%	3,41%	1,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.948.696,88	0	0	2.989.933,92	41.237,04	1,40%	2,85%	1,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.174.800,07	0	0	6.261.130,44	86.330,37	1,40%	2,53%	1,40%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.609.905,41	0	0	1.632.405,33	22.499,92	1,40%	1,90%	1,40%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.181.633,82	0	0	2.208.359,15	26.725,33	1,23%	1,70%	1,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.100.358,31	0	0	3.137.759,97	37.401,66	1,21%	2,66%	1,21%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	19.194.171,51	0	0	19.413.019,03	218.847,52	1,14%	1,26%	1,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.401.348,90	0	0	5.462.778,45	61.429,55	1,14%	1,21%	1,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.552.980,43	0	0	14.716.967,86	163.987,43	1,13%	1,48%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.926.953,28	0	0	1.948.450,76	21.497,48	1,12%	1,24%	1,12%
DAYCOVAL IMAB 5 FI RENDA FIXA	1.776.864,69	0	0	1.796.681,75	19.817,06	1,12%	1,36%	1,12%
ITAÚ IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	2.671.900,04	2.000.000,00	0	4.723.624,16	51.724,12	1,11%	4,49%	2,19%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.626.634,71	0	0	1.644.110,57	17.475,86	1,07%	0,03%	1,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.587.303,24	0	0	3.625.466,65	38.163,41	1,06%	1,04%	1,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.218.977,41	0	0	3.251.646,83	32.669,42	1,01%	0,01%	1,01%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.077.866,05	0	0	12.199.440,15	121.574,10	1,01%	0,85%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.353.888,85	0	0	10.458.068,71	104.179,86	1,01%	0,84%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.411.418,44	0	0	2.435.668,50	24.250,06	1,01%	0,84%	1,01%
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.146.770,34	2.500.000,00	0	19.839.007,83	192.237,49	0,98%	1,25%	1,14%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.284.381,80	0	0	2.305.679,40	21.297,60	0,93%	0,74%	0,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.270.799,15	0	0	1.282.355,04	11.555,89	0,91%	0,04%	0,91%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.921.153,50	0	0	1.938.376,50	17.223,00	0,90%	0,05%	0,90%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	934.243,14	800.000,00	0	1.746.039,88	11.796,74	0,68%	0,01%	1,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.728.152,74	11.289.482,35	10.262.532,06	4.844.498,27	89.395,24	0,60%	0,01%	1,01%
CAIXA BRASIL IRFM TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0	2.000.000,00	0	2.004.022,06	4.022,06	0,20%	1,51%	2,31%
Total Renda Fixa					3.651.500,11	1,51%	2,30%	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Inst (%)
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.610.155,03	0	0	9.146.831,49	536.676,46	6,23%	9,15%	6,23%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.330.934,78	0	0	1.396.728,54	65.793,76	4,94%	7,15%	4,94%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.110.689,11	0	0	7.400.966,03	290.276,92	4,08%	8,20%	4,08%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.606.360,84	0	0	9.989.595,12	383.234,28	3,99%	6,83%	3,99%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.203.147,08	0	0	1.240.805,51	37.658,43	3,13%	5,63%	3,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.530.000,00	0	12.594,42	1.544.985,00	27.579,42	1,80%	12,38%	0,98%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.023.299,89	0	0	1.017.958,56	-5.341,33	-0,52%	-	-
Total Renda Variável					1.335.877,94	4,39%	8,10%	

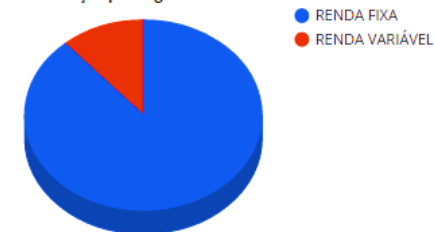
- Comparação com a Meta Atuarial – Janeiro de 2017**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	261.108.868,73	21.089.482,35	10.275.126,48	276.910.602,65	4.987.378,05	1,83%	0,93%	196,76%	2,94%
Acumulado no ano					4.987.378,05	1,83%	0,93%	196,76%	

• **Enquadramento – Janeiro de 2017**

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite - 2017			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	159.376.365,52	57,56%	30,00%	35,00%	70,00%	34.461.056,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	47.154.255,14	17,03%	15,00%	20,00%	60,00%	118.992.106,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	34.704.027,01	12,53%	5,00%	5,00%	30,00%	48.369.153,79
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	41.536.590,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	13.845.530,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3.938.084,73	1,42%	0,00%	2,50%	5,00%	9.907.445,40
Total Renda Fixa	100,00%	245.172.732,40	88,54%	55,00%	75,00%	185,00%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite - 2017			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	9.146.831,49	3,30%	0,00%	0,00%	4,00%	1.929.592,62
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	20.028.095,20	7,23%	5,00%	10,00%	15,00%	21.508.495,20
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	13.845.530,13
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.017.958,56	0,37%	2,00%	5,00%	5,00%	12.827.571,57
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.544.985,00	0,56%	2,00%	5,00%	5,00%	12.300.545,13
Total Renda Variável	30,00%	31.737.870,25	11,46%	11,00%	25,00%	34,00%	

Distribuição por Artigos

