

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
FEVEREIRO 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 –Fevereiro de 2017**

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR	Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.842.654,85	0	0	6.267.849,77	425.194,92	7,28%		3,23%	7,28%
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3.812.660,85	0	0	4.005.023,10	192.362,25	5,05%		2,48%	5,05%
ITAÚ IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	4.723.624,16	0	0	4.960.335,86	236.711,70	5,01%		2,48%	5,01%
BB IMAB 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.047.672,04	0	0	15.798.774,55	751.102,51	4,99%		2,46%	4,99%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.402.125,83	0	37.370,77	1.432.674,51	67.919,45	4,84%		6,27%	2,18%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.406.422,06	0	95.266,26	3.475.156,33	164.000,53	4,81%		6,48%	2,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	8.201.132,55	1.200.000,00	0	9.819.516,33	418.383,78	4,45%		2,52%	5,10%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	14.536.337,95	0	0	15.110.929,51	574.591,56	3,95%		1,94%	3,95%
BB IMAB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.556.161,20	0	0	10.962.202,07	406.040,87	3,85%		1,85%	3,85%
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	1.990.097,75	0	0	2.066.067,02	75.969,27	3,82%		1,85%	3,82%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.531.727,08	1.700.000,00	0	17.846.236,07	614.508,99	3,57%		1,90%	3,86%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.286.381,30	0	174.786,17	6.313.926,56	202.331,43	3,22%		6,21%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.989.933,92	0	0	3.070.541,59	80.607,67	2,70%		1,77%	2,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.588.573,70	0	0	15.986.802,02	398.228,32	2,55%		1,17%	2,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.261.130,44	0	171.586,09	6.248.605,44	159.061,09	2,54%		1,68%	2,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.418.492,30	0	0	1.454.470,34	35.978,04	2,54%		1,17%	2,54%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	8.885.057,56	0	0	9.100.305,57	215.248,01	2,42%		1,01%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.137.759,97	0	87.143,27	3.125.642,17	75.025,47	2,39%		1,60%	2,41%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	801.744,17	0	0	819.685,55	17.941,38	2,24%		0,91%	2,24%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.632.405,33	0	0	1.668.584,91	36.179,58	2,22%		1,34%	2,22%
CAIXA BRASIL IRFM TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.004.022,06	0	0	2.044.840,66	40.818,60	2,04%		0,95%	2,04%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.208.359,15	0	63.226,10	2.186.751,89	41.618,84	1,88%		5,73%	-0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.716.967,86	0	420.345,08	14.528.849,66	232.226,88	1,58%		0,85%	1,59%
DAYCOVAL IMAB 5 FI RENDA FIXA	1.796.681,75	0	0	1.824.093,58	27.411,83	1,53%		0,79%	1,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.462.778,45	0	0	5.544.261,71	81.483,26	1,49%		0,69%	1,49%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	19.413.019,03	0	0	19.700.524,13	287.505,10	1,48%		0,72%	1,48%
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.839.007,83	0	0	20.132.157,37	293.149,54	1,48%		0,72%	1,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.948.450,76	0	55.364,22	1.920.544,32	27.457,78	1,41%		0,71%	1,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.625.466,65	1.200.000,00	0	4.872.313,39	46.846,74	0,97%		0,60%	1,29%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.199.440,15	0	339.853,29	11.977.151,64	117.564,78	0,96%		5,12%	-1,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.458.068,71	0	298.681,27	10.259.859,55	100.472,11	0,96%		0,43%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.435.668,50	0	68.912,10	2.390.110,00	23.353,60	0,96%		0,42%	0,97%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.305.679,40	0	0	2.327.385,60	21.706,20	0,94%		0,44%	0,94%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.644.110,57	0	0	1.658.585,41	14.474,84	0,88%		0,04%	0,88%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.938.376,50	0	54.522,66	1.897.929,00	14.075,16	0,73%		4,96%	-2,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.282.355,04	0	35.975,08	1.255.623,19	9.243,23	0,72%		0,15%	0,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.251.646,83	1.138.007,11	0	4.419.346,28	29.692,34	0,68%		0,01%	0,80%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.844.498,27	6.561.495,65	6.139.578,23	5.330.368,91	63.953,22	0,56%		0,00%	0,81%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.746.039,88	800.000,00	616.338,90	1.942.179,63	12.478,65	0,49%		0,01%	0,87%
Total Renda Fixa				255.746.205,19	6.632.919,52	2,66%		1,80%	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR	Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.544.985,00	0	12.000,00	1.620.000,00	87.015,00	5,63%		9,34%	4,86%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.989.595,12	0	0	10.330.046,27	340.451,15	3,41%		6,70%	3,41%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.240.805,51	0	0	1.271.444,13	30.638,62	2,47%		5,88%	2,47%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.396.728,54	0	0	1.409.786,46	13.057,92	0,93%		6,57%	0,93%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	9.146.831,49	0	0	9.221.359,57	74.528,08	0,81%		8,40%	0,81%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.400.966,03	0	0	7.434.227,21	33.261,18	0,45%		8,34%	0,45%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	0	1.000.000,00	0	992.835,82	-7.164,18	-0,72%		3,26%	-0,47%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.017.958,56	0	0	940.641,96	-77.316,60	-7,60%		-	-
Total Renda Variável				33.220.341,42	494.471,17	1,51%		7,55%	

• **Comparação com a Meta Atuarial – Fevereiro 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%
Fevereiro	276.910.602,65	13.599.502,76	8.670.949,49	288.966.546,61	7.127.390,69	2,53%	0,66%	384,29%	2,44%
Acumulado no ano					12.114.768,74	4,41%	1,60%	276,22%	

- **Enquadramento – Fevereiro de 2017**

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2017		Limite	
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	162.857.400,83	56,36%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	51.876.987,48	17,95%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	37.015.846,37	12,81%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	3.995.970,51	1,38%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	255.746.205,19	88,50%	55%	185,00%
Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2017		Limite	
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 8º, Inciso I	9.221.359,57	3,19%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso III	20.445.504,07	7,08%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	992.835,82	0,34%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	940.641,96	0,33%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.620.000,00	0,56%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	33.220.341,42	11,50%	11,00%	34,00%
Total	288.966.546,61	100,00%		