

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
MARÇO 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 –Março de 2017**

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.668.584,91	0	0	1.697.651,98	29.067,07	1,74%	1,11%	1,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.125.642,17	0	0	3.177.925,44	52.283,27	1,67%	1,64%	1,67%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.186.751,89	0	0	2.222.705,54	35.953,65	1,64%	1,07%	1,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.070.541,59	0	0	3.120.492,79	49.951,20	1,63%	1,60%	1,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.528.849,66	0	0	14.748.831,58	219.981,92	1,51%	0,87%	1,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.248.605,44	0	0	6.342.959,74	94.354,30	1,51%	1,47%	1,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.920.544,32	0	0	1.949.051,09	28.506,77	1,48%	0,74%	1,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.544.261,71	0	0	5.622.677,27	78.415,56	1,41%	0,71%	1,41%
DAYCOVAL IMAB 5 FI RENDA FIXA	1.824.093,58	0	0	1.849.682,76	25.589,18	1,40%	0,83%	1,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.872.313,39	118.694,07	0	5.060.722,67	69.715,21	1,40%	0,66%	1,42%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	19.700.524,13	118.694,07	0	20.092.405,51	273.187,31	1,38%	0,76%	1,38%
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.132.157,37	0	0	20.409.437,61	277.280,24	1,38%	0,76%	1,38%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.977.151,64	0	0	12.136.154,73	159.003,09	1,33%	0,52%	1,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.454.470,34	0	0	1.473.778,77	19.308,43	1,33%	1,51%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.259.859,55	0	0	10.395.812,20	135.952,65	1,33%	0,52%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.390.110,00	0	0	2.421.675,64	31.565,64	1,32%	0,52%	1,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.986.802,02	0	0	16.197.261,96	210.459,94	1,32%	1,52%	1,32%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	9.100.305,57	0	0	9.215.096,89	114.791,32	1,26%	1,23%	1,26%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.327.385,60	0	0	2.355.994,80	28.609,20	1,23%	0,45%	1,23%
CAIXA BRASIL IRFM TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.044.840,66	712.164,45	0	2.790.840,28	33.835,17	1,23%	1,33%	1,43%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	819.685,55	0	0	829.426,21	9.740,66	1,19%	1,13%	1,19%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.313.926,56	0	0	6.388.705,43	74.778,87	1,18%	1,67%	1,18%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.658.585,41	0	0	1.676.304,40	17.718,99	1,07%	0,03%	1,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	15.110.929,51	356.082,23	0	15.628.626,09	161.614,35	1,04%	2,13%	1,06%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	17.846.236,07	356.082,23	0	18.383.680,58	181.362,28	1,00%	2,09%	1,01%
BB IMAB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.962.202,07	356.082,23	0	11.430.639,59	112.355,29	0,99%	2,05%	1,02%
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	2.066.067,02	356.082,23	0	2.445.729,93	23.580,68	0,97%	2,13%	1,10%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.897.929,00	0	0	1.913.823,00	15.894,00	0,84%	0,14%	0,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.255.623,19	0	0	1.266.072,75	10.449,56	0,83%	0,14%	0,83%
BB IMAB 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.798.774,55	0	0	15.930.104,46	131.329,91	0,83%	2,74%	0,83%
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.005.023,10	0	0	4.038.192,84	33.169,74	0,83%	2,74%	0,83%
ITAÚ IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	4.960.335,86	237.388,15	0	5.239.827,53	42.103,52	0,81%	2,73%	0,83%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	9.819.516,33	237.388,15	0	10.135.884,73	78.980,25	0,79%	2,77%	0,80%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.419.346,28	870.739,73	1.226.821,96	4.104.705,30	41.441,25	0,78%	0,00%	0,97%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.432.674,51	0	0	1.443.576,93	10.902,42	0,76%	2,23%	0,76%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.475.156,33	0	0	3.501.468,60	26.312,27	0,76%	2,22%	0,76%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.942.179,63	800.000,00	562.662,30	2.199.925,70	20.408,37	0,74%	0,03%	1,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	5.330.368,91	5.923.228,75	6.605.765,53	4.712.106,90	64.274,77	0,57%	0,00%	0,97%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.267.849,77	0	0	6.288.193,59	20.343,82	0,32%	4,00%	0,32%
Total Renda Fixa				260.838.153,81	3.044.572,12	1,18%	1,45%	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	940.641,96	0	0	1.043.994,00	103.352,04	10,99%	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0	1.000.000,00	0	1.022.854,20	22.854,20	2,29%	4,47%	-1,50%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.271.444,13	395.488,66	0	1.689.097,89	22.165,10	1,33%	6,14%	1,13%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.409.786,46	0	0	1.426.083,62	16.297,16	1,16%	6,73%	1,16%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.330.046,27	0	0	10.400.988,59	70.942,32	0,69%	7,44%	0,69%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	992.835,82	0	0	999.118,27	6.282,45	0,63%	1,62%	0,63%
WESTERN ASSET MASTER VALUATION FI AÇÕES	0	1.000.000,00	0	1.005.815,10	5.815,10	0,58%	8,49%	-2,42%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.434.227,21	395.488,66	0	7.804.779,17	-24.936,70	-0,32%	8,05%	-0,44%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.620.000,00	0	10.952,15	1.575.000,00	-34.047,85	-2,10%	14,05%	-2,78%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	9.221.359,57	0	0	9.012.623,59	-208.735,98	-2,26%	9,15%	-2,26%
Total Renda Variável				35.980.354,43	-20.012,16	-0,06%	8,00%	

• **Comparação com a Meta Atuarial – Março 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	276.910.825,38	4.987.600,78	1,83%	0,93%	197,23%	2,94%
Fevereiro	276.910.825,38	13.599.502,76	8.670.949,49	288.966.546,61	7.127.167,96	2,53%	0,66%	383,15%	2,44%
Março	288.966.546,61	13.233.603,61	8.406.201,94	296.818.508,24	3.024.559,96	1,03%	0,90%	115,01%	2,23%
Acumulado no ano					15.139.328,70	5,48%	2,51%	218,88%	

- **Enquadramento – Março de 2017**

Artigos Renda Fixa	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação		
			Inferior %	Alvo %	Superior %
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	166.756.747,17	56,18%	30,00%	35,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	53.363.288,29	17,98%	15,00%	20,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	36.664.471,57	12,35%	5,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	4.053.646,78	1,37%	0,00%	2,50%	5,00%
Total Renda Fixa	260.838.153,81	87,88%	55,00%	75,00%	185,00%
Artigos Renda Variável	Carteira %	Carteira %	Estratégia de Alocação		
			Inferior %	Alvo %	Superior %
Artigo 8º, Inciso I	9.012.623,59	3,04%	0,00%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso III	23.349.618,57	7,87%	5,00%	10,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	999.118,27	0,34%	2,00%	5,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	1.043.994,00	0,35%	2,00%	5,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.575.000,00	0,53%	2,00%	5,00%	5,00%
Total Renda Variável	35.980.354,43	12,12%	11,00%	25,00%	34,00%