

# **RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS**

**ABRIL 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 – Abril de 2017**

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.622.677,27	0	0	5.672.906,93	50.229,66	0,89%	0,49%	0,89%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.676.304,40	0	0	1.689.597,20	13.292,80	0,79%	0,02%	0,79%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.136.154,73	0	0	12.232.028,20	95.873,47	0,79%	0,31%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.395.812,20	0	0	10.477.872,27	82.060,07	0,79%	0,31%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.421.675,64	0	0	2.440.768,10	19.092,46	0,79%	0,31%	0,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.060.722,67	0	0	5.100.542,97	39.820,30	0,79%	0,46%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.949.051,09	0	0	1.963.505,15	14.454,06	0,74%	0,52%	0,74%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.104.705,30	0	0	4.134.626,74	29.921,44	0,73%	0,01%	0,73%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.355.994,80	0	0	2.372.913,00	16.918,20	0,72%	0,28%	0,72%
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.409.437,61	0	0	20.551.569,33	142.131,72	0,70%	0,52%	0,70%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.092.405,51	0	0	20.232.188,99	139.783,48	0,70%	0,52%	0,70%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.222.705,54	0	0	2.237.905,59	15.200,05	0,68%	0,76%	0,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.748.831,58	0	0	14.846.230,01	97.398,43	0,66%	0,62%	0,66%
DAYCOVAL IMAB 5 FI RENDA FIXA	1.849.682,76	0	0	1.861.565,68	11.882,92	0,64%	0,57%	0,64%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.913.823,00	0	0	1.925.649,00	11.826,00	0,62%	0,03%	0,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.266.072,75	0	0	1.273.850,33	7.777,58	0,61%	0,03%	0,61%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.697.651,98	0	0	1.707.655,67	10.003,69	0,59%	0,79%	0,59%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.199.925,70	800.000,00	575.990,54	2.439.812,78	15.877,62	0,53%	0,01%	0,79%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.712.106,90	6.012.821,18	5.862.254,33	4.914.607,38	51.933,63	0,48%	0,01%	0,73%
CAIXA BRASIL IRFM TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.790.840,28	950.000,00	0	3.754.645,93	13.805,65	0,37%	1,15%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.342.959,74	0	0	6.364.140,75	21.181,01	0,33%	1,17%	0,33%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	829.426,21	0	0	832.031,80	2.605,59	0,31%	1,00%	0,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.177.925,44	0	0	3.187.789,68	9.864,24	0,31%	1,24%	0,31%
BRADERSCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	9.215.096,89	0	0	9.240.187,25	25.090,36	0,27%	1,07%	0,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.197.261,96	0	0	16.231.007,52	33.745,56	0,21%	1,36%	0,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.120.492,79	0	0	3.125.533,32	5.040,53	0,16%	1,20%	0,16%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.388.705,43	0	0	6.394.112,81	5.407,38	0,08%	1,49%	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.473.778,77	1.440.000,00	0	2.915.312,91	1.534,14	0,05%	1,36%	0,21%
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	2.445.729,93	0	0	2.439.447,37	-6.282,56	-0,26%	1,92%	-0,26%
BB IMAB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.430.639,59	0	0	11.391.271,88	-39.367,71	-0,34%	1,90%	-0,34%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	18.383.680,58	0	0	18.318.651,71	-65.028,87	-0,35%	1,92%	-0,35%
BRADERSCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	15.628.626,09	0	0	15.568.174,10	-60.451,99	-0,39%	1,97%	-0,39%
BB IMAB 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.930.104,46	0	0	15.797.372,72	-132.731,74	-0,83%	2,59%	-0,83%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.038.192,84	0	0	4.004.216,39	-33.976,45	-0,84%	2,59%	-0,84%
ITAÚ IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	5.239.827,53	0	0	5.195.529,25	-44.298,28	-0,85%	2,59%	-0,85%
BRADERSCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	10.135.884,73	950.000,00	0	10.989.659,99	-96.224,74	-0,87%	2,63%	-0,88%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.501.468,60	0	0	3.458.279,94	-43.188,66	-1,23%	2,25%	-1,23%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.443.576,93	0	0	1.425.744,56	-17.832,37	-1,24%	2,25%	-1,24%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.288.193,59	0	0	6.198.376,63	-89.816,96	-1,43%	3,81%	-1,43%
<b>Total Renda Fixa</b>				<b>264.907.281,83</b>	<b>354.551,71</b>	<b>0,13%</b>	<b>1,27%</b>	

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.400.988,59	0	0	10.659.610,10	258.621,51	2,49%	5,69%	2,49%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.426.083,62	0	0	1.458.070,62	31.987,00	2,24%	5,31%	2,24%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.689.097,89	0	0	1.720.560,22	31.462,33	1,86%	5,04%	1,86%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.005.815,10	600.000,00	0	1.625.078,49	19.263,39	1,20%	6,81%	0,20%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	999.118,27	0	0	1.005.544,95	6.426,68	0,64%	1,22%	0,64%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1.022.854,20	600.000,00	0	1.630.621,90	7.767,70	0,48%	3,44%	0,34%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.043.994,00	0	0	1.038.913,69	-5.080,31	-0,49%	-	-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.804.779,17	0	0	7.726.500,11	-78.279,06	-1,00%	7,03%	-1,00%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	9.012.623,59	0	0	8.899.009,46	-113.614,13	-1,26%	7,57%	-1,26%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.575.000,00	0	11.400,00	1.522.500,00	-41.100,00	-2,61%	8,21%	-3,33%
<b>Total Renda Variável</b>				<b>37.286.409,54</b>	<b>117.455,11</b>	<b>0,32%</b>	<b>6,32%</b>	

• **Comparação com a Meta Atuarial – Abril 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%
Abril	296.818.508,24	11.352.821,18	6.449.644,87	<b>302.193.691,37</b>	472.006,82	0,16%	0,50%	31,45%	1,88%
Acumulado no ano					<b>15.611.335,52</b>	5,65%	3,02%	187,34%	

- **Enquadramento – Abril de 2017**

Artigos Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação		
				Inferior %	Alvo %	Superior %
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	168.060.042,93	55,61%	30,00%	35,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	54.116.673,05	17,91%	15,00%	20,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	38.649.997,18	12,79%	5,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4.080.568,67	1,35%	0,00%	2,50%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>264.907.281,83</b>	<b>87,66%</b>	<b>55%</b>	<b>75%</b>	<b>185%</b>
Artigos Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação		
				Inferior %	Alvo %	Superior %
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	8.899.009,46	2,94%	0,00%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	24.820.441,44	8,21%	5,00%	10,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	1.005.544,95	0,33%	2,00%	5,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.038.913,69	0,34%	2,00%	5,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.522.500,00	0,50%	2,00%	5,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>37.286.409,54</b>	<b>12,34%</b>	<b>11%</b>	<b>25%</b>	<b>34%</b>
<b>Total</b>		<b>302.193.691,37</b>				