

RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS
MAIO 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 – Maio de 2017**

ATIVOS DE RENDA FIXA	SADO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	VAR MÊS (%)	INSTITUIÇÃO(%)
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.134.626,74	0	0	4.253.126,51	118.499,77	2,87%	0,01%	0,82%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.689.597,20	0	0	1.705.343,19	15.745,99	0,93%	0,03%	0,93%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.925.649,00	0	0	1.941.882,00	16.233,00	0,84%	0,06%	0,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.273.850,33	0	0	1.284.521,79	10.671,46	0,84%	0,06%	0,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.440.768,10	0	0	2.458.078,64	17.310,54	0,71%	2,34%	0,71%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.232.028,20	0	0	12.318.780,76	86.752,56	0,71%	2,37%	0,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.477.872,27	0	0	10.552.144,54	74.272,27	0,71%	2,36%	0,71%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.372.913,00	0	0	2.388.715,20	15.802,20	0,67%	1,79%	0,67%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.100.542,97	1.023.464,14	0	6.162.290,71	38.283,60	0,63%	3,77%	0,41%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.439.812,78	801.008,17	665.603,84	2.593.387,93	18.170,82	0,56%	0,02%	0,94%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.914.607,38	6.782.897,93	6.439.469,28	5.318.077,94	60.041,91	0,51%	0,00%	0,85%
CAIXA BRASIL IRFM TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.754.645,93	255.866,04	0	4.028.340,08	17.828,11	0,44%	6,42%	0,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.963.505,15	0	0	1.971.130,81	7.625,66	0,39%	3,81%	0,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.846.230,01	0	0	14.884.514,01	38.284,00	0,26%	4,54%	0,26%
DAYCOVAL IMAB 5 FI RENDA FIXA	1.861.565,68	0	0	1.863.280,82	1.715,14	0,09%	4,91%	0,09%
CAIXA BRASIL IMAB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.551.569,33	0	0	20.568.977,33	17.408,00	0,08%	4,89%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	832.031,80	0	0	832.665,15	633,35	0,08%	6,39%	0,08%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.232.188,99	0	0	20.242.856,53	10.667,54	0,05%	4,90%	0,05%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.237.905,59	0	0	2.238.822,83	917,24	0,04%	5,38%	0,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.707.655,67	0	0	1.707.230,90	-424,77	-0,02%	5,81%	-0,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAGERAL FIC RENDA FIXA	9.240.187,25	0	0	9.228.047,71	-12.139,54	-0,13%	7,18%	-0,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.364.140,75	0	0	6.347.498,56	-16.642,19	-0,26%	7,81%	-0,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.187.789,68	0	0	3.177.105,70	-10.683,98	-0,34%	7,91%	-0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.125.533,32	0	84.193,03	3.029.910,27	-11.430,02	-0,37%	8,92%	-0,41%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.394.112,81	0	0	6.369.376,51	-24.736,30	-0,39%	9,48%	-0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.915.312,91	0	0	2.882.896,14	-32.416,77	-1,11%	8,47%	-1,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.231.007,52	0	0	16.050.246,87	-180.760,65	-1,11%	8,48%	-1,11%
BB IMAB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.391.271,88	0	0	11.254.896,05	-136.375,83	-1,20%	13,32%	-1,20%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.458.279,94	0	0	3.412.274,95	-46.004,99	-1,33%	15,59%	-1,33%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.425.744,56	0	0	1.406.747,48	-18.997,08	-1,33%	15,59%	-1,33%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	18.318.651,71	0	0	18.068.737,79	-249.913,92	-1,36%	13,66%	-1,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB FIC RENDA FIXA	15.568.174,10	1.279.330,20	0	16.611.832,70	-235.671,60	-1,40%	13,48%	-1,18%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.004.216,39	0	0	3.933.082,43	-71.133,96	-1,78%	17,27%	-1,78%
ITAÚ IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	5.195.529,25	0	0	5.098.372,13	-97.157,12	-1,87%	17,21%	-1,87%
BB IMAB 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.797.372,72	0	0	15.491.291,79	-306.080,93	-1,94%	17,16%	-1,94%
GERAÇÃO FUTURO IMAB FIC RENDA FIXA	2.439.447,37	0	0	2.392.156,92	-47.290,45	-1,94%	14,09%	-1,94%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMAB 5+ FIC RENDA FIXA	10.989.659,99	1.279.330,20	0	12.000.219,18	-268.771,01	-2,19%	17,45%	-1,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.672.906,93	0	0	5.536.961,95	-135.944,98	-2,40%	5,94%	-2,40%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.198.376,63	0	0	5.985.953,27	-212.423,36	-3,43%	25,05%	-3,43%
TOTAL RENDA FIXA					-1.548.136,29	-0,58%	8,81%	

ATIVOS DE RENDA VARIÁVEL	SADO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	VAR MÊS (%)	INSTITUIÇÃO(%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0	255.866,04	0	262.798,22	6.932,18	2,71%	3,54%	2,21%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1.630.621,90	255.866,04	0	1.904.002,89	17.514,95	0,93%	9,59%	0,52%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1.522.500,00	0	11.550,00	1.515.000,00	4.050,00	0,27%	7,71%	-0,49%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.005.544,95	0	0	1.006.514,85	969,9	0,10%	4,82%	0,10%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.038.913,69	0	0	1.032.185,89	-6.727,80	-0,65%	-	-
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.625.078,49	255.866,04	0	1.861.431,54	-19.512,99	-1,04%	14,26%	-1,48%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.458.070,62	0	0	1.441.341,77	-16.728,85	-1,15%	14,12%	-1,15%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.659.610,10	255.866,04	0	10.687.664,90	-227.811,24	-2,09%	14,57%	-2,17%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.720.560,22	0	0	1.667.971,70	-52.588,52	-3,06%	11,82%	-3,06%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.726.500,11	255.866,04	0	7.562.656,46	-419.709,69	-5,26%	19,32%	-5,51%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.899.009,46	0	0	8.371.183,68	-527.825,78	-5,93%	18,70%	-5,93%
TOTAL RENDA VARIÁVEL					-1.241.437,84	-3,22%	15,45%	

• **Comparação com a Meta Atuarial – Maio de 2017**

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO NO MÊS	RETORNO (R\$)	RETORNO (%)	META (%)	GAP (%)
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%
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%
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%
Abril	296.818.508,24	11.352.821,18	6.449.644,87	302.193.691,37	472.006,82	0,16%	0,50%	31,45%
Maio	302.193.691,37	12.701.226,88	7.200.816,15	304.904.527,97	-2.789.574,13	-0,91%	0,87%	-103,99%
ACUMULADO NO ANO					12.821.761,39	4,69%	3,91%	119,88%

• **Enquadramento – Maio 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%	168.527.599,95	55,27%	30,00%	35,00%	70,00%	44.905.569,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	55.908.837,38	18,34%	15,00%	20,00%	60,00%	127.033.879,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	39.059.392,64	12,81%	5,00%	5,00%	30,00%	52.411.965,75
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	45.735.679,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	15.245.226,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4.095.946,10	1,34%	0,00%	2,50%	5,00%	11.149.280,30
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	267.591.776,07	87,76%	55,00%	75,00%	185,00%	
ARTIGOS - RENDA VARIÁVEÇ	RESOLUÇÃO %	CARTEIRA \$	CARTEIRA %	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - LIMITE - 2017			GAP SUPERIOR
				INFERIOR %	ALVO %	SUPERIOR %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	8.371.183,68	2,75%	0,00%	0,00%	4,00%	3.824.997,44
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	25.125.069,26	8,24%	5,00%	10,00%	15,00%	20.610.609,94
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	1.269.313,07	0,42%	2,00%	5,00%	5,00%	13.975.913,33
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.032.185,89	0,34%	2,00%	5,00%	5,00%	14.213.040,51
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.515.000,00	0,50%	2,00%	5,00%	5,00%	13.730.226,40
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	37.312.751,90	12,24%	11,00%	25,00%	34,00%	
TOTAL		304.904.527,97					