

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO DE GESTÃO DE RISCO

AGOSTO 2023



Núcleo de Investimentos



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

SUMÁRIO

INTRODUÇÃO	2
1. CENÁRIO	2
2. PATRIMÔNIO DE RECURSOS PREVIDENCIÁRIO	3
2.1. DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO E PATRIMÔNIO X RESOLUÇÃO..	3
<i>a) Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução – Fundo Financeiro</i>	<i>3</i>
<i>b) Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução – Fundo Previdenciário</i>	<i>4</i>
<i>c) Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução – Consolidado.....</i>	<i>5</i>
3. RISCO	6
3.1 RISCO POR ARTIGO	6
<i>a) Risco Fundo Financeiro</i>	<i>7</i>
<i>b) Risco Fundo Previdenciário</i>	<i>7</i>
<i>c) Risco Consolidado.....</i>	<i>7</i>
3.2 RISCO X RETORNO POR ATIVO	8
<i>a) Risco X Retorno por Ativo – Fundo Financeiro</i>	<i>8</i>
<i>b) Risco X Retorno por Ativo – Fundo Previdenciário.....</i>	<i>10</i>
<i>c) Risco X Retorno Renda Fixa – Consolidado.....</i>	<i>13</i>
4. FLUXO DE MOVIMENTAÇÕES ESTRATÉGICAS DE INVESTIMENTOS	17
5. ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO.....	19
6. RECURSO DA TAXA RESERVA.....	20



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

RELATÓRIO DE GERENCIAMENTO DE RISCO AGOSTO 2023

Introdução

O Núcleo de Investimentos é o setor responsável pelo acompanhamento e monitoramento diário e contínuo dos riscos de todas as posições dos recursos investidos da GuarujáPrev, de acordo com a Política de Gerenciamento de Riscos.

O Núcleo deverá mensalmente emitir o relatório de Gestão de Risco e enviar ao Comitê de Investimentos, sendo de responsabilidade de seus membros a interpretação dos dados e as tomadas de decisões posteriores.

Este relatório, portanto, destina-se a subsidiar o Comitê de Investimentos no gerenciamento dos riscos da Carteira de Investimentos da GuarujáPrev e auxiliar as diretrizes técnicas enviadas à Diretoria Executiva, a fim de proteger e multiplicar o patrimônio da GuarujáPrev, sempre com segurança, eficiência, ética e zelo.

1. Cenário

O mês de agosto fechou o Índice de Preço ao Consumidor Amplo – IPCA - com **0,23%**. No ano, o IPCA acumula alta de 3,23% e, nos últimos 12 meses, de 4,61%.

O Ibovespa, principal índice da bolsa brasileira, fechou o mês em queda de **5,09%**, acumulando ganhos de 5,51% no ano.



2. Patrimônio de Recursos Previdenciário

2.1. Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução

a) Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução – Fundo Financeiro

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA – FUNDO FINANCEIRO								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Pró-Gestão Nível 3
				Mínimo	Objetivo	Máximo		Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	29.064.716,88	10,78	10	45,5	100	0	100
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	60.352.200,20	22,38	0	10,41	60	0	100
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	141.523.228,63	52,48	0	18,79	60	0	75
Total Renda Fixa		230.940.145,71	85,64					100
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	28.527.413,45	10,58	0	0	25	0	45
Total Renda Variável		28.527.413,45	10,58					45
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	10.197.042,61	3,78	0	0	10	0	10
Total Investimentos no Exterior		10.197.042,61	3,78					10
Total		270.107.201,12	100	-----				

Fonte: GuarujáPrev



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

b) Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução – Fundo Previdenciário

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA – FUNDO PREVIDENCIÁRIO								
Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 3
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	502.860.003,26	57,43	10,00	45,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	122.941.852,00	14,04	0,00	10,41	60,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	120.964.857,11	13,81	0,00	18,79	60,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	5.605.110,79	0,64	0,00	0,00	15,00	0,00	15,00
Total Renda Fixa		752.371.823,16	85,92					100
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	54.539.120,02	6,23	0	0	25	0	45
Total Renda Variável		54.539.120,02	6,23					45
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	35.320.638,07	4,03	0	0	10	0	10
Total Investimentos no Exterior		35.320.638,07	4,03					10
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	25.776.818,06	2,94	0	0	12	0	15
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.152.526,57	0,36	0	0	2	0	10
Total Investimentos Estruturados		28.929.344,63	3,30					20
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	4.475.802,62	0,51	0	0	2	0	15
Total Fundos Imobiliários		4.475.802,62	0,51					15
Total		864.867.611,33	100			-----		

Fonte: GuarujáPrev

**c) Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução – Consolidado**

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA – CONSOLIDADO								
Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 3
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	531.924.720,14	46,44	10,00	45,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	183.294.052,20	16,00	0,00	10,41	60,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	262.488.085,74	22,92	0,00	18,79	60,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	5.605.110,79	0,49	0,00	0,00	15,00	0,00	15,00
Total Renda Fixa		967.484.478,97	85,24					100
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	83.066.533,47	7,25	0	0	25	0	45
Total Renda Variável		83.066.533,47	7,25					45
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	45.517.680,68	3,97	0	0	10	0	10
Total Investimentos no Exterior		45.517.680,68	3,97					10
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	25.776.818,06	2,25	0	0	12	0	15
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.152.526,59	0,28	0	0	2	0	10
Total Investimentos Estruturados		28.929.344,65	2,53					20
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	4.475.802,62	0,39	0	0	2	0	15
Total Fundos Imobiliários		4.475.802,62	0,39					15
Total		1.134.974.812,05	100			-----		

Fonte: GuarujáPrev



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

3. Risco

3.1 Risco por artigo

VaR (Value at Risk) é um **indicador de risco**, calculado estatisticamente, que mostra a exposição ao risco financeiro que um ativo ou uma carteira de ativos podem ter em um determinado período de tempo (dia, semana, mês, ano(s)) em um certo intervalo de confiança em condições normais de mercado.

A Política de Investimentos para 2023 da GuarujáPrev estipulou o limite para o VaR conforme tabela abaixo:

VaR – Política de Investimentos 2023	
MANDATO	LIMITE
Renda Fixa	5%
Renda Variável	20%
Investimento no exterior	20%
Fundos Estruturados	20%
Fundos Imobiliários	20%

**a) Risco Fundo Financeiro**

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%							
Value-At-Risk (R\$): 2.811.667,95							
Value-At-Risk: 1,04%							
ARTIGO	VOLATILIDADE(1)	VAR(2)	CVAR(3)	SHARPE	RENT.	VALOR(R\$)	% CARTEIRA
Artigo 7º	1,26	0,58	0,37	-0,28	0,79	230.940.145,71	85,64
Artigo 8º	13,64	7,30	0,69	-0,52	-5,95	28.527.413,45	10,58
Artigo 9º	18,93	8,77	-0,01	-0,02	0,71	10.197.042,61	3,78
GUARUJÁ FINANCEIRO	2,03	1,04	1,04	-0,54	0,05	269.664.601,77	100,00

b) Risco Fundo Previdenciário

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%							
Value-At-Risk (R\$): 5.182.122,68							
Value-At-Risk: 0,59%							
ARTIGO	VOLATILIDADE(1)	VAR(2)	CVAR(3)	SHARPE	RENT.	VALOR(R\$)	% CARTEIRA
Artigo 7º	0,61	0,28	0,16	-0,65	0,74	752.371.823,16	85,92
Artigo 8º	13,98	7,34	0,41	-0,55	-6,53	54.539.120,02	6,23
Artigo 9º	12,66	5,23	0,05	-0,08	0,09	35.320.638,07	4,03
Artigo 10º	2,56	1,70	-0,02	-0,5	-0,14	28.929.344,63	3,30
Artigo 11º	4,11	0,72	-0,00	0,07	1,44	4.475.802,62	0,51
GUARUJÁ PREVIDENCIÁRIO	1,18	0,59	0,59	-0,79	0,21	875.636.728,50	100

c) Risco Consolidado

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%							
Value-At-Risk (R\$): 7.911.819,83							
Value-At-Risk: 0,69%							
ARTIGO	VOLATILIDADE(1)	VAR(2)	CVAR(3)	SHARPE	RENT.	VALOR(R\$)	% CARTEIRA
Artigo 7º	0,73	0,35	0,21	-0,52	0,76	983.311.968,87	85,86
Artigo 8º	13,81	7,30	0,48	-0,54	-6,33	83.066.533,47	7,25
Artigo 9º	13,50	5,76	0,02	-0,07	0,22	45.517.680,68	3,97
Artigo 10º	2,56	1,70	-0,02	-0,50	-0,14	28.929.344,65	2,53
Artigo 11º	4,11	0,72	0,00	0,07	1,44	4.475.802,62	0,39
GUARUJÁ CONSOLIDADO	1,36	0,69	0,69	-0,71	0,17	1.145.301.330,29	100,00



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

3.2 Risco X Retorno por Ativo

a) Risco X Retorno por Ativo – Fundo Financeiro

RISCO X RETORNO – FUNDO FINANCEIRO

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,58%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	1,31	0,48	0,01	0,51	-0,17	0,92	24.987.985,48	9,27
NTN-B 150824 (6,600000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,76	0,81	4.076.731,40	1,51
Sub-total	1,12	0,42	0,01		-0,21	0,91	29.064.716,88	10,78

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,98	0,70	0,00	0,01	-0,27	0,59	2.895.702,84	1,07
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,61	1,86	0,29	0,05	-0,42	-0,37	57.456.497,36	21,31
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,90	NaN	0,00	NaN	-0,19	0,77	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,19	NaN	0,00	NaN	-0,19	0,73	0,00	0,00
Sub-total	2,86	1,80	0,29		-0,34	0,15	60.352.200,20	22,38

Artigo 7º III, Alínea A

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,07	0,04	0,00	0,04	1,89	1,27	51.187.783,22	18,98
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	3,36	1,79	0,01	1,78	-0,10	0,82	10.737.958,41	3,98
BB PREV RF FLUXO FIC	0,03	0,01	0,00	0,01	-3,23	1,05	1.323.839,20	0,49
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,01	0,00	0,01	-9,56	1,05	30.086,64	0,01
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,03	0,00	0,03	3,33	1,27	32.697.701,75	12,13
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,43	0,48	0,06	0,48	-0,34	0,65	45.545.859,41	16,89
Sub-total	0,61	0,23	0,06		-0,17	1,04	141.523.228,63	52,48

Renda Variável Value-At-Risk: 7,30%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	12,94	6,67	0,13	3,47	-0,46	-4,87	5.783.464,14	2,14
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,59	7,58	0,11	3,74	-0,57	-7,18	4.706.619,18	1,75
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	15,34	7,65	0,09	1,95	-0,53	-6,95	3.443.016,97	1,28
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	13,51	7,98	0,11	1,23	-0,45	-4,89	4.381.243,99	1,62
OCCAM FIC FIA	13,85	7,88	0,13	1,63	-0,50	-5,77	5.471.033,60	2,03



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	16,33	8,18	0,03	3,31	-0,62	-8,94	952.503,30	0,35
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,96	8,13	0,10	5,13	-0,43	-5,79	3.789.532,27	1,41
Sub-total	13,64	7,30	0,69		-0,52	-5,95	28.527.413,45	10,58
Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 8,77%								
Artigo 9º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	25,43	12,01	0,01	10,89	-0,24	-4,99	961.417,48	0,36
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,86	9,25	-0,01	9,25	0,01	1,35	7.406.697,13	2,75
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,58	7,90	-0,01	7,78	0,01	1,30	1.828.928,00	0,68
Sub-total	18,93	8,77	-0,01		-0,02	0,71	10.197.042,61	3,78



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

b) Risco X Retorno por Ativo – Fundo Previdenciário

RISCO X RETORNO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO								
Renda Fixa								
Value-At-Risk: 0,28%								
Artigo 7º I, Alínea a								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,396600%)	0,19	0,22	0,00	0,25	-2,31	0,71	999.895,94	0,11
NTN-B 150535 (6,180000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,95	0,77	33.646.291,62	3,84
NTN-B 150545 (5,470100%)	0,19	0,22	0,00	0,24	-2,28	0,71	399.439,55	0,05
NTN-B 150545 (5,480000%)	0,19	0,22	0,00	0,24	-2,27	0,71	44.828,00	0,01
NTN-B 150545 (5,500000%)	0,20	0,22	0,00	0,25	-2,12	0,71	5.630.437,40	0,64
NTN-B 150545 (5,600500%)	0,19	0,22	0,00	0,25	-2,22	0,72	2.660.347,52	0,30
NTN-B 150545 (6,015000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-2,03	0,76	24.869.692,23	2,84
NTN-B 150545 (6,260000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,91	0,78	60.845.919,34	6,95
NTN-B 150545 (6,400000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,85	0,79	3.037.852,16	0,35
NTN-B 150555 (5,548000%)	0,19	0,22	0,00	0,24	-2,24	0,72	5.547.085,23	0,63
NTN-B 150555 (5,595500%)	0,19	0,22	0,00	0,25	-2,22	0,72	2.502.974,16	0,29
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,19	0,22	0,00	0,25	-2,19	0,73	11.629.929,23	1,33
NTN-B 150555 (6,080000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-2,00	0,77	4.950.040,17	0,57
NTN-B 150555 (6,135000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,97	0,77	57.823.210,43	6,60
NTN-B 150555 (6,210000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,94	0,78	23.034.506,38	2,63
NTN-B 150555 (6,230000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,93	0,78	5.383.319,04	0,61
NTN-B 150555 (6,270000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,91	0,78	39.680.662,17	4,53
NTN-B 150555 (6,325000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,88	0,79	4.532.270,83	0,52
NTN-B 150555 (6,372000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,86	0,79	20.815.219,39	2,38
NTN-B 150824 (6,610000%)	9,71	0,23	0,00	0,25	-0,33	-2,10	3.251.198,61	0,37
NTN-B 150824 (6,620000%)	9,71	0,23	0,00	0,25	-0,33	-2,10	160.895,38	0,02
NTN-B 150830 (6,240000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,92	0,78	14.951.089,36	1,71
NTN-B 150840 (5,390000%)	9,06	0,23	0,00	0,25	-0,35	-2,01	1.323.374,45	0,15
NTN-B 150840 (6,200000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,94	0,78	44.035.862,28	5,03
NTN-B 150850 (5,520000%)	9,05	0,22	0,00	0,24	-0,35	-2,00	3.879.093,75	0,44
NTN-B 150850 (6,140000%)	0,37	0,22	0,00	0,20	-0,99	0,77	39.687.283,09	4,53
NTN-B 150850 (6,270000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,91	0,78	33.238.834,05	3,80
NTN-B 150850 (6,385000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,85	0,79	22.303.270,79	2,55
NTN-B 150850 (6,427000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,84	0,80	31.995.180,71	3,65
Sub-total	0,19	0,09	0,01		-1,91	0,78	502.860.003,26	57,43
Artigo 7º I, Alínea b								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,05	0,00	0,05	-0,16	1,13	6.152.118,32	0,70
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,31	0,49	0,00	1,78	-0,18	0,90	8.387.046,44	0,96
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,45	1,77	0,00	0,53	-0,41	-0,27	1.898.919,00	0,22
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	3,45	1,77	0,01	0,53	-0,41	-0,28	4.638.894,00	0,53



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,98	0,70	0,00	0,01	-0,27	0,59	5.491.804,83	0,63
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,61	1,86	0,12	0,05	-0,42	-0,37	84.667.825,19	9,67
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,90	0,72	0,00	0,16	-0,19	0,77	8.887.127,63	1,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,19	NaN	0,00	NaN	-0,19	0,73	0,00	0,00
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,30	0,48	0,00	1,78	-0,18	0,90	2.818.116,59	0,32
Sub-total	2,42	1,45	0,13		-0,35	0,30	122.941.852,00	14,04
Artigo 7º III, Alínea a								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,07	0,04	0,00	0,04	1,89	1,27	66.591.581,34	7,60
BB PREV RF FLUXO FIC	0,03	0,01	0,00	0,01	-3,23	1,05	518.890,00	0,06
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,01	0,00	0,01	-9,56	1,05	839.137,71	0,10
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,03	0,00	0,03	3,33	1,27	13.400.168,21	1,53
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,43	0,48	0,01	0,48	-0,34	0,65	39.615.079,85	4,52
Sub-total	0,44	0,16	0,01		-0,16	1,07	120.964.857,11	13,81
Artigo 7º V, Alínea b								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,54	0,56	0,00	0,58	-0,20	0,83	5.605.110,79	0,64
Sub-total	1,54	0,56	0,00		-0,20	0,83	5.605.110,79	0,64
Renda Variável Value-At-Risk: 7,34%								
Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	12,94	6,67	0,04	3,47	-0,46	-4,87	5.531.796,91	0,63
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,59	7,58	0,25	3,74	-0,57	-7,18	32.843.130,27	3,75
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	15,34	7,65	0,02	1,95	-0,53	-6,95	2.220.813,43	0,25
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	13,51	7,98	0,03	1,23	-0,45	-4,89	3.409.577,22	0,39
OCCAM FIC FIA	13,85	7,88	0,03	1,63	-0,50	-5,77	4.649.324,38	0,53
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,96	8,13	0,05	5,13	-0,43	-5,79	5.884.477,81	0,67
Sub-total	13,98	7,34	0,41		-0,55	-6,53	54.539.120,02	6,23
Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 5,23%								
Artigo 9º II								



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,81	8,41	0,01	11,93	0,16	4,36	4.820.442,96	0,55
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	25,43	12,01	0,01	10,89	-0,24	-4,99	3.062.662,60	0,35
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,86	9,25	0,00	9,25	0,01	1,35	2.684.651,39	0,31
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	13,51	5,55	0,05	5,52	-0,16	-1,07	15.364.829,40	1,75
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,58	7,90	-0,01	7,78	0,01	1,30	9.388.051,72	1,07
Sub-total	12,66	5,23	0,05		-0,08	0,09	35.320.638,07	4,03
Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 1,70%								
Artigo 10º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	4,40	2,38	0,00	5,86	-0,49	-1,01	2.178.308,60	0,25
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3,28	2,19	-0,03	9,01	-0,36	-0,05	23.598.509,46	2,70
Sub-total	2,78	1,91	-0,02		-0,46	-0,14	25.776.818,06	2,94
Artigo 10º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,69	0,03	0,00	0,03	-1,96	-0,21	3.152.526,57	0,36
Sub-total	0,69	0,03	0,00		-1,96	-0,21	3.152.526,57	0,36
Fundos Imobiliários Value-At-Risk: 0,72%								
Artigo 11º								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CXRI11	15,89	2,58	0,00	8,27	0,28	5,64	1.260.000,00	0,14
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,40	0,03	0,00	0,03	-3,18	-0,12	3.215.802,62	0,37
Sub-total	4,11	0,72	0,00		0,07	1,44	4.475.802,62	0,51



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

c) Risco X Retorno Renda Fixa – Consolidado

RISCO X RETORNO - CONSOLIDADO								
Renda Fixa								
Value-At-Risk: 0,35%								
Artigo 7º I, Alínea a								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	1,31	0,48	0,00	0,51	-0,17	0,92	24.987.985,48	2,18
NTN-B 150535 (5,396600%)	0,19	0,22	0,00	0,25	-2,31	0,71	999.895,94	0,09
NTN-B 150535 (6,180000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,95	0,77	33.646.291,62	2,94
NTN-B 150545 (5,470100%)	0,19	0,22	0,00	0,24	-2,28	0,71	399.439,55	0,03
NTN-B 150545 (5,480000%)	0,19	0,22	0,00	0,24	-2,27	0,71	44.828,00	0,00
NTN-B 150545 (5,500000%)	0,20	0,22	0,00	0,25	-2,12	0,71	5.630.437,40	0,49
NTN-B 150545 (5,600500%)	0,19	0,22	0,00	0,25	-2,22	0,72	2.660.347,52	0,23
NTN-B 150545 (6,015000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-2,03	0,76	24.869.692,23	2,17
NTN-B 150545 (6,260000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,91	0,78	60.845.919,34	5,31
NTN-B 150545 (6,400000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,85	0,79	3.037.852,16	0,27
NTN-B 150555 (5,548000%)	0,19	0,22	0,00	0,24	-2,24	0,72	5.547.085,23	0,48
NTN-B 150555 (5,595500%)	0,19	0,22	0,00	0,25	-2,22	0,72	2.502.974,16	0,22
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,19	0,22	0,00	0,25	-2,19	0,73	11.629.929,23	1,02
NTN-B 150555 (6,080000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-2,00	0,77	4.950.040,17	0,43
NTN-B 150555 (6,135000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,97	0,77	57.823.210,43	5,05
NTN-B 150555 (6,210000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,94	0,78	23.034.506,38	2,01
NTN-B 150555 (6,230000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,93	0,78	5.383.319,04	0,47
NTN-B 150555 (6,270000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,91	0,78	39.680.662,17	3,46
NTN-B 150555 (6,325000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,88	0,79	4.532.270,83	0,40
NTN-B 150555 (6,372000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,86	0,79	20.815.219,39	1,82
NTN-B 150824 (6,600000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,76	0,81	4.076.731,40	0,36
NTN-B 150824 (6,610000%)	9,71	0,23	0,00	0,25	-0,33	-2,10	3.251.198,61	0,28
NTN-B 150824 (6,620000%)	9,71	0,23	0,00	0,25	-0,33	-2,10	160.895,38	0,01
NTN-B 150830 (6,240000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,92	0,78	14.951.089,36	1,31
NTN-B 150840 (5,390000%)	9,06	0,23	0,00	0,25	-0,35	-2,01	1.323.374,45	0,12



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

NTN-B 150840 (6,200000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,94	0,78	44.035.862,28	3,84
NTN-B 150850 (5,520000%)	9,05	0,22	0,00	0,24	-0,35	-2,00	3.879.093,75	0,34
NTN-B 150850 (6,140000%)	0,37	0,22	0,00	0,20	-0,99	0,77	39.687.283,09	3,47
NTN-B 150850 (6,270000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,91	0,78	33.238.834,05	2,90
NTN-B 150850 (6,385000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,85	0,79	22.303.270,79	1,95
NTN-B 150850 (6,427000%)	0,19	0,10	0,00	0,11	-1,84	0,80	31.995.180,71	2,79
Sub-total	0,19	0,09	0,01		-1,84	0,78	531.924.720,14	46,44
Artigo 7º I, Alínea b								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,05	0,00	0,05	-0,16	1,13	6.152.118,32	0,54
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,31	0,49	0,00	1,78	-0,18	0,90	8.387.046,44	0,73
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,45	1,77	0,00	0,53	-0,41	-0,27	1.898.919,00	0,17
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	3,45	1,77	0,00	0,53	-0,41	-0,28	4.638.894,00	0,41
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,98	0,70	0,00	0,01	-0,27	0,59	8.387.507,67	0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,61	1,86	0,16	0,05	-0,42	-0,37	142.124.322,55	12,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,90	0,72	0,00	0,16	-0,19	0,77	8.887.127,63	0,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,19	NaN	0,00	NaN	-0,19	0,73	0,00	0,00
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,30	0,48	0,00	1,78	-0,18	0,90	2.818.116,59	0,25
Sub-total	2,57	1,56	0,17		-0,35	0,25	183.294.052,20	16,00
Artigo 7º III, Alínea a								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,07	0,04	0,00	0,04	1,89	1,27	117.779.364,56	10,28
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	3,36	1,79	0,00	1,78	-0,10	0,82	10.737.958,41	0,94
BB PREV RF FLUXO FIC	0,03	0,01	0,00	0,01	-3,23	1,05	1.842.729,20	0,16
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,01	0,00	0,01	-9,56	1,05	869.224,35	0,08
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,03	0,00	0,03	3,33	1,27	46.097.869,96	4,02
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,43	0,48	0,02	0,48	-0,34	0,65	85.160.939,26	7,44



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

Sub-total	0,53	0,19	0,02		-0,17	1,05	262.488.085,74	22,92
Artigo 7º V, Alínea b								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,54	0,56	0,00	0,58	-0,20	0,83	5.605.110,79	0,49
Sub-total	1,54	0,56	0,00		-0,20	0,83	5.605.110,79	0,49
Renda Variável Value-At-Risk: 7,30%								
Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	12,94	6,67	0,06	3,47	-0,46	-4,87	11.315.261,05	0,99
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,59	7,58	0,22	3,74	-0,57	-7,18	37.549.749,45	3,28
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	15,34	7,65	0,03	1,95	-0,53	-6,95	5.663.830,40	0,49
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	13,51	7,98	0,05	1,23	-0,45	-4,89	7.790.821,21	0,68
OCCAM FIC FIA	13,85	7,88	0,06	1,63	-0,50	-5,77	10.120.357,98	0,88
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	16,33	8,18	0,01	3,31	-0,62	-8,94	952.503,30	0,08
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,96	8,13	0,06	5,13	-0,43	-5,79	9.674.010,08	0,84
Sub-total	13,81	7,30	0,48		-0,54	-6,33	83.066.533,47	7,25
Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 5,76%								
Artigo 9º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,81	8,41	0,00	11,93	0,16	4,36	4.820.442,96	0,42
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	25,43	12,01	0,01	10,89	-0,24	-4,99	4.024.080,08	0,35
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,86	9,25	0,00	9,25	0,01	1,35	10.091.348,52	0,88
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	13,51	5,55	0,03	5,52	-0,16	-1,07	15.364.829,40	1,34
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,58	7,90	-0,01	7,78	0,01	1,30	11.216.979,72	0,98
Sub-total	13,50	5,76	0,02		-0,07	0,22	45.517.680,68	3,97
Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 1,70%								
Artigo 10º I								



Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	4,40	2,38	0,00	5,86	-0,49	-1,01	2.178.308,60	0,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3,28	2,19	-0,02	9,01	-0,36	-0,05	23.598.509,46	2,06
Sub-total	2,78	1,91	-0,02		-0,46	-0,14	25.776.818,06	2,25
Artigo 10º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,69	0,03	0,00	0,03	-1,96	-0,21	3.152.526,59	0,28
Sub-total	0,69	0,03	0,00		-1,96	-0,21	3.152.526,59	0,28
Fundos Imobiliários Value-At-Risk: 0,72%								
Artigo 11º								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CXRI11	15,89	2,58	0,00	8,27	0,28	5,64	1.260.000,00	0,11
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,40	0,03	0,00	0,03	-3,18	-0,12	3.215.802,62	0,28
Sub-total	4,11	0,72	0,00		0,07	1,44	4.475.802,62	0,39

Detalhamento:

(1) Volatilidade (Vol) anualizada do ativo no período (%). A volatilidade é uma medida estatística que aponta a **frequência e a intensidade** das oscilações no preço de um ativo. Quanto maior a Vol maior o risco.

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%) – Cvar é uma medida que indica a perda média que excede o VaR, ou seja, quantifica "quão" grande é, na média, a perda (risco) a que se está sujeito em uma determinada carteira, fornecendo dessa forma informações sobre a distribuição da cauda¹.

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%). O VaR busca estimar perdas em condições normais de mercado, para uma carteira composta de um ou mais ativos. O BVaR tem a mesma finalidade, porém estima a perda em relação a um benchmark determinado.

¹ https://www.maxwell.vrac.puc-rio.br/35343/35343_6.PDF



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

4. Fluxo de movimentações estratégicas de investimentos

Deliberações do Comitê de Investimentos da reunião do dia 16/08/2023 –
8ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos de 2023:

3 - APLICAÇÕES						
SEGREGAÇÃO	TIPO DE RESGATE	FUNDO		CNPJ	VALOR	PRAZO COTIZAÇÃO
FINANCEIRO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 699.315,28	D+0
		PARA	TITULOS PUBLICOS NTN-B 2024 - BTG	---	R\$ 699.315,28	D+0
FINANCEIRO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 161.765,49	D+0
		PARA	TITULOS PUBLICOS NTN-B 2024 -XP	---	R\$ 161.765,49	D+0
FINANCEIRO	PARCIAL	DE	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.508.605/0001-00	R\$ 43.037.146,16	D+0
		PARA	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	R\$ 43.037.146,16	D+0
FINANCEIRO	PARCIAL	DE	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.386.926/0001-71	R\$ 14.625.208,64	D+0
		PARA	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	R\$ 14.625.208,64	D+0
FINANCEIRO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 2.549.961,17	D+0
		PARA	TITULOS PUBLICOS NTN-B 2024	---	R\$ 2.549.961,17	D+0
PREVIDENCIÁRIO	PARCIAL	DE	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.508.605/0001-00	R\$ 72.375.903,76	D+0
		PARA	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	R\$ 72.375.903,76	D+0
PREVIDENCIÁRIO	PARCIAL	DE	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.386.926/0001-71	R\$ 21.454.245,13	D+0
		PARA	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	R\$ 21.454.245,13	D+0
PREVIDENCIÁRIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 5.626.370,35	D+0
		PARA	TITULOS PUBLICOS NTN-B 2045	---	R\$ 5.626.370,35	D+0
PREVIDENCIÁRIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 445.373,97	D+0
		PARA	TITULOS PUBLICOS NTN-B 2030- XP	---	R\$ 445.373,97	D+0
PREVIDENCIÁRIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 1.680.407,71	D+0
		PARA	TITULOS PUBLICOS NTN-B 2050- XP	---	R\$ 1.680.407,71	D+0
PREVIDENCIÁRIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 2.196.714,34	D+0



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

		PARA	TITULOS PUBLICOS NTN-B 2050 - BTG	---	R\$ 2.196.714,34	D+0
PREVIDENCIÁRIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 1.320.861,03	D+0
		PARA	TITULOS PUBLICOS NTN-B 2040 - BTG	---	R\$ 1.320.861,03	D+0

Abaixo seguem as movimentações realizadas conforme deliberação do Comitê de Investimentos sobre títulos públicos:

Aplicações realizadas:

TITULOS PUBLICOS NTN-B 2024					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
FINANCEIRO	R\$ 3.411.041,94	R\$ 3.246.113,68	- R\$ 4.092,67	Arredondamento de valor para PU dos Títulos Públicos	28/08/2023
		R\$ 160.835,59			30/08/2023

TITULOS PUBLICOS NTN-B 2040					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.320.861,03	R\$ 1.321.138,21	R\$ 277,18	Arredondamento de valor para PU dos Títulos Públicos	28/08/2023

TITULOS PUBLICOS NTN-B 2045					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
PREVIDENCIÁRIO	R\$ 6.071.744,32	R\$ 5.622.332,51	- R\$ 5.290,46	Arredondamento de valor para PU dos Títulos Públicos	28/08/2023
		R\$ 444.121,35			30/08/2023

TITULOS PUBLICOS NTN-B 2050					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
PREVIDENCIÁRIO	R\$ 3.877.122,05	R\$ 2.193.657,24	- R\$ 1.309,77	Arredondamento de valor para PU dos Títulos Públicos	28/08/2023
		R\$ 1.682.155,04			30/08/2023

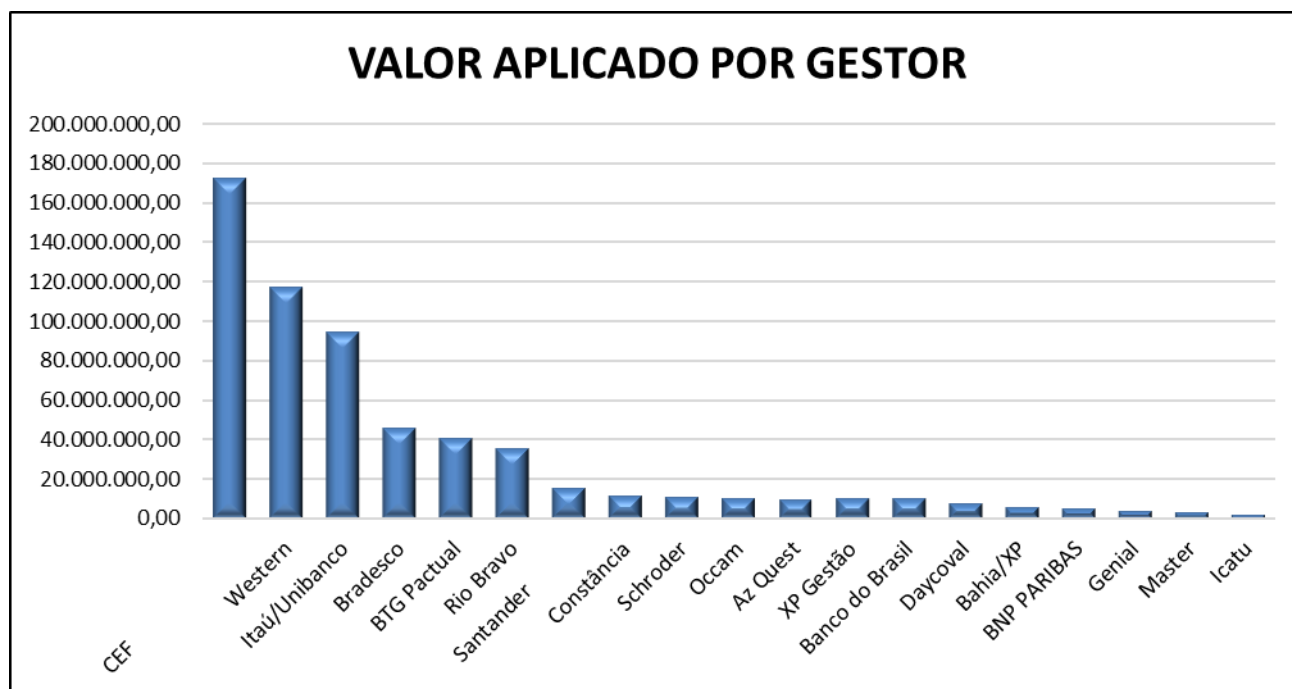


Abaixo seguem as movimentações realizadas conforme deliberação do Comitê de Investimentos sobre Fundos de Investimentos.

FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
FINANCEIRO	R\$ 57.662.354,80	R\$ 52.045.567,76	R\$ 252.728,39	O Fundo de resgate desvalorizou as cotas neste período	29/08/2023
		R\$ 5.869.515,43			30/08/2023

FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
PREVIDENCIÁRIO	R\$ 93.830.148,89	R\$ 76.681.169,76	R\$ 8.486.575,48	Existem duas contas correntes Previdenciárias na CEF e o resgate foi realizado apenas da conta corrente 110.	29/08/2023
		R\$ 8.662.403,65			30/08/2023

5. Alocação por instituição





GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio
Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

6. Recurso da Taxa Reserva

GESTOR	NOME FUNDO	SALDO ANTERIOR (R\$)	APLICACÃO (R\$)	RESGATE (R\$)	RENDIMENTO (R\$)	VALOR TOTAL (R\$)	RENT. MÊS	BENCH MARK
CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	16.048.767,86	----	----	198.558,87	16.247.326,73	1,24%	CDI

Guarujá, 30 de outubro de 2023.

(Assinatura digital)

**Laydianne Alves da S. Rosa
Gonçalves**

Membro do Núcleo de Investimentos
Analista Previdenciário Economista
GuarujáPrev

(Assinatura digital)

Renata Franco Ferreira de Oliveira
Membro do Núcleo de Investimentos
GuarujáPrev

(Assinatura digital)

Lucio Villafranca Motta
Analista Previdenciário Economista
GuarujáPrev