

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO DE GESTÃO DE RISCO

OUTUBRO 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	18
6. RECURSO DA TAXA RESERVA	19



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 SETEMBRO 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

Em outubro, o **Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA)** foi de **0,24%**, 0,02 ponto percentual (p.p.) abaixo da taxa de setembro (0,26%). No ano, o IPCA acumula alta de 3,75% e, nos últimos 12 meses, de 4,82%.

O **Ibovespa**, principal índice da bolsa brasileira, fechou o mês em queda de **2,94 %**, acumulando ganhos de 3,11% no ano.

Com relação ao câmbio, o **Dólar Comercial** encerrou o mês cotado a **R\$ 5,04**. A moeda teve alta de 0,26% na variação mensal.



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

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 4
				Mínimo	Objetivo	Máximo		Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	29.520.850,39	10,91	10,00	45,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	59.418.211,23	21,95	0,00	10,41	60,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	144.910.309,18	53,54	0,00	18,79	60,00	0,00	80,00
Total Renda Fixa		233.849.370,80	86,4					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	27.417.411,13	10,13	0,00	0,00	25,00	0,00	50,00
Total Renda Variável		27.417.411,13	10,13					50,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	9.385.121,65	3,47	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
Total Investimentos no Exterior		9.385.121,65	3,47					10,00
Total		270.651.903,58	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 4
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	512.737.792,58	57,78	10,00	45,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	112.832.457,95	12,71	0,00	10,41	60,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	135.018.394,60	15,22	0,00	18,79	60,00	0,00	80,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	5.634.848,83	0,63	0,00	0,00	15,00	0,00	20,00
Total Renda Fixa		766.223.493,96	86,34					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	52.511.684,71	5,92	0,00	0,00	25,00	0,00	50,00
Total Renda Variável		52.511.684,71	5,92					50,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	32.974.197,23	3,72	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
Total Investimentos no Exterior		32.974.197,23	3,72					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	25.964.859,58	2,93	0,00	0,00	12,00	0,00	15,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	5.320.117,09	0,6	0,00	0,00	2,00	0,00	15,00
Total Investimentos Estruturados		31.284.976,67	3,53					20,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	4.408.766,61	0,5	0,00	0,00	2,00	0,00	20,00
Total Fundos Imobiliários		4.408.766,61	0,5					20,00
Total		887.403.119,18	100					-----

Fonte: GuarujáPrev

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

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA – CONSOLIDADO								
Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 4
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	542.258.642,97	46,82	10,00	45,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	172.250.669,18	14,87	0,00	10,41	60,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	279.928.703,78	24,17	0,00	18,79	60,00	0,00	80,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	5.634.848,83	0,49	0,00	0,00	15,00	0,00	20,00
Total Renda Fixa		1.000.072.864,76	86,36					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	79.929.095,84	6,9	0,00	0,00	25,00	0,00	50,00
Total Renda Variável		79.929.095,84	6,9					50,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	42.359.318,88	3,66	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
Total Investimentos no Exterior		42.359.318,88	3,66					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	25.964.859,58	2,24	0,00	0,00	12,00	0,00	15,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	5.320.117,09	0,46	0,00	0,00	2,00	0,00	15,00
Total Investimentos Estruturados		31.284.976,67	2,7					20,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	4.408.766,61	0,38	0,00	0,00	2,00	0,00	20,00
Total Fundos Imobiliários		4.408.766,61	0,38					10,00
Total		1.158.055.022,76	100					-----

Fonte: GuarujáPrev



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\$): 3.124.035,48							
Value-At-Risk: 1,15%							
ARTIGO	VOLATILIDADE(1)	VAR(2)	CVAR(3)	SHARPE	RENT.	VALOR(R\$)	% CARTEIRA
Artigo 7º	2,06	0,61	0,44	-0,28	0,41	233.849.370,80	86,4
Artigo 8º	16,52	7,58	0,70	-0,3	-3,95	27.417.411,13	10,13
Artigo 9º	19,14	8,75	0,01	-0,29	-4,57	9.385.121,65	3,47
GUARUJÁ FINANCEIRO	3,03	1,15	1,15	-0,41	-0,24	270.651.903,58	100

b) Risco Fundo Previdenciário

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%							
Value-At-Risk (R\$): 5.769.247,12							
Value-At-Risk: 0,65%							
ARTIGO	VOLATILIDADE(1)	VAR(2)	CVAR(3)	SHARPE	RENT.	VALOR(R\$)	% CARTEIRA
Artigo 7º	0,95	0,27	0,17	-0,43	0,59	766.223.493,96	86,34
Artigo 8º	18,38	7,71	0,42	-0,27	-3,99	52.511.684,71	5,92
Artigo 9º	13,09	5,49	0,06	-0,33	-3,36	32.974.197,23	3,72
Artigo 10º	5,91	1,37	0,00	-0,10	0,40	31.284.976,67	3,53
Artigo 11º	2,34	0,64	0,00	-0,61	-0,44	4.408.766,61	0,50
GUARUJÁ PREVIDENCIÁRIO	1,85	0,65	0,65	-0,47	0,13	887.403.119,18	100

c) Risco Consolidado

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%							
Value-At-Risk (R\$): 8.829.200,42							
Value-At-Risk: 0,76%							
ARTIGO	VOLATILIDADE(1)	VAR(2)	CVAR(3)	SHARPE	RENT.	VALOR(R\$)	% CARTEIRA
Artigo 7º	1,19	0,35	0,23	-0,38	0,55	1.000.072.864,76	86,36
Artigo 8º	17,69	7,64	0,49	-0,28	-3,98	79.929.095,84	6,90
Artigo 9º	13,81	5,93	0,04	-0,33	-3,63	42.359.318,88	3,66
Artigo 10º	5,91	1,37	0,00	-0,10	0,40	31.284.976,67	2,70
Artigo 11º	2,34	0,64	0,00	-0,61	-0,44	4.408.766,61	0,38
GUARUJÁ CONSOLIDADO	2,11	0,76	0,76	-0,45	0,04	1.158.055.022,76	100



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: 0,61%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	1,00	0,43	0,01	0,44	-0,54	0,45	25.381.309,10	9,38
NTN-B 150824 (6,600000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,16	0,78	4.139.541,29	1,53
Sub-total	0,87	0,37	0,01		-0,57	0,50	29.520.850,39	10,91

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	3,01	1,19	0,01	0,00	-0,44	-0,32	2.889.735,69	1,07
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,32	2,00	0,33	0,03	-0,26	-0,66	56.528.475,54	20,89
Sub-total	6,14	1,96	0,34		-0,27	-0,65	59.418.211,23	21,95

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	0,06	0,04	0,00	0,04	0,98	1,05	40.841.223,63	15,09
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	4,78	1,71	0,03	1,72	-0,16	0,25	10.787.644,21	3,99
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,68	0,65	0,02	0,65	-0,34	0,43	11.325.151,76	4,18
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,02	0,00	0,02	-4,77	0,90	1.680.073,86	0,62
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	0,01	0,00	0,01	-41,97	0,91	36.734,59	0,01
BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,03	0,02	0,00	0,02	1,71	1,05	57.237.969,66	21,15
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,83	0,58	0,03	0,58	-0,35	0,70	23.001.511,47	8,50
Sub-total	0,63	0,22	0,08		-0,27	0,83	144.910.309,18	53,54

Renda Variável Value-At-Risk: 7,58%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	16,13	7,51	0,13	3,34	-0,35	-4,68	5.457.637,40	2,02
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,09	7,93	0,11	4,12	-0,24	-3,86	4.553.135,90	1,68
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	17,22	7,88	0,09	2,10	-0,24	-3,05	3.377.748,93	1,25
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	14,88	7,42	0,10	0,96	-0,27	-3,09	4.253.883,20	1,57
OCCAM FIC FIA	13,41	7,61	0,13	1,54	-0,25	-2,37	5.383.543,43	1,99
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,43	9,16	0,03	4,22	-0,35	-7,30	878.333,15	0,32



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	21,91	9,02	0,10	2,82	-0,33	-6,30	3.513.129,12	1,30
Sub-total	16,52	7,58	0,70		-0,30	-3,95	27.417.411,13	10,13
Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 8,75%								
Artigo 9º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30,31	13,18	0,01	11,44	-0,36	-9,79	841.029,33	0,31
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,62	9,24	0,01	9,24	-0,24	-4,04	6.839.491,50	2,53
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	13,48	7,12	-0,01	7,67	-0,37	-3,95	1.704.600,82	0,63
Sub-total	19,14	8,75	0,01		-0,29	-4,57	9.385.121,65	3,47



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: 0,27%								
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	0,05	0,00	0,06	-1,67	0,68	1.013.428,10	0,11
NTN-B 150535 (6,180000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,34	0,74	34.142.748,08	3,85
NTN-B 150545 (5,470100%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,63	0,69	404.891,47	0,05
NTN-B 150545 (5,480000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,63	0,69	45.440,52	0,01
NTN-B 150545 (5,500000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,62	0,69	5.707.545,97	0,64
NTN-B 150545 (5,600500%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,58	0,70	2.697.198,80	0,30
NTN-B 150545 (6,015000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,41	0,73	25.230.267,80	2,84
NTN-B 150545 (6,260000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,31	0,75	61.751.291,85	6,96
NTN-B 150545 (6,400000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,25	0,76	3.083.715,54	0,35
NTN-B 150555 (5,548000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,60	0,69	5.623.467,63	0,63
NTN-B 150555 (5,595500%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,58	0,70	2.537.625,90	0,29
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,55	0,70	11.792.290,17	1,33
NTN-B 150555 (6,080000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,38	0,74	5.022.312,66	0,57
NTN-B 150555 (6,135000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,36	0,74	58.672.370,57	6,61
NTN-B 150555 (6,210000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,33	0,75	23.375.471,37	2,63
NTN-B 150555 (6,230000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,32	0,75	5.463.168,96	0,62
NTN-B 150555 (6,270000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,30	0,75	40.271.704,37	4,54
NTN-B 150555 (6,325000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,28	0,76	4.600.165,76	0,52
NTN-B 150555 (6,372000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,26	0,76	21.128.578,98	2,38
NTN-B 150824 (6,461000%)	0,19	0,19	0,00	0,20	-1,22	0,77	859.777,65	0,10
NTN-B 150824 (6,610000%)	0,19	0,19	0,00	0,20	-1,16	0,78	3.301.341,68	0,37
NTN-B 150824 (6,620000%)	0,19	0,19	0,00	0,20	-1,15	0,78	163.379,44	0,02
NTN-B 150830 (6,240000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,31	0,75	15.173.090,62	1,71
NTN-B 150840 (5,390000%)	0,19	0,18	0,00	0,19	-1,67	0,68	1.341.270,14	0,15
NTN-B 150840 (6,200000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,33	0,75	44.686.963,07	5,04
NTN-B 150850 (5,520000%)	0,19	0,18	0,00	0,19	-1,61	0,69	3.932.337,90	0,44
NTN-B 150850 (5,797500%)	0,19	0,18	0,00	0,19	-1,50	0,71	1.592.921,68	0,18
NTN-B 150850 (6,140000%)	0,36	0,21	0,00	0,21	-0,71	0,74	40.270.110,96	4,54
NTN-B 150850 (6,270000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,30	0,75	33.733.925,49	3,80
NTN-B 150850 (6,385000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,25	0,76	22.639.448,20	2,55
NTN-B 150850 (6,427000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,24	0,76	32.479.541,25	3,66
Sub-total	0,19	0,06	0,00		-1,33	0,74	512.737.792,58	57,78
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	0,05	0,03	0,00	0,03	-0,83	0,96	6.270.135,49	0,71
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,00	0,43	0,00	1,89	-0,56	0,44	8.516.137,82	0,96



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,66	2,07	0,00	0,45	-0,28	-0,83	1.860.266,91	0,21
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	6,68	2,08	0,01	0,45	-0,28	-0,84	4.543.841,31	0,51
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3,01	1,19	0,01	0,00	-0,44	-0,32	5.480.487,93	0,62
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,32	2,00	0,14	0,03	-0,26	-0,66	83.300.293,39	9,39
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	NaN	0,00	NaN	-0,50	-0,29	0,00	0,00
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,00	0,43	0,00	1,89	-0,56	0,43	2.861.295,10	0,32
Sub-total	5,08	1,66	0,15		-0,28	-0,43	112.832.457,95	12,71
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	0,06	0,04	0,00	0,04	0,98	1,05	59.207.834,25	6,67
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,68	0,65	0,00	0,65	-0,34	0,43	8.719.364,63	0,98
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,02	0,00	0,02	-4,77	0,90	393.117,06	0,04
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	0,01	0,00	0,01	-41,97	0,91	882.930,90	0,10
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,03	0,02	0,00	0,02	1,71	1,05	45.804.907,97	5,16
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,83	0,58	0,01	0,58	-0,35	0,70	20.010.239,79	2,25
Sub-total	0,50	0,22	0,02		-0,29	0,83	121.738.162,45	13,79
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	2,01	0,79	0,00	0,79	-0,51	-0,03	5.634.848,83	0,63
Sub-total	2,01	0,79	0,00		-0,51	-0,03	5.634.848,83	0,63
Renda Variável								
Value-At-Risk: 7,71%								
Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	16,13	7,51	0,04	3,34	-0,35	-4,68	5.220.148,50	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,09	7,93	0,26	4,12	-0,24	-3,86	31.772.112,74	3,58
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	17,22	7,88	0,02	2,10	-0,24	-3,05	2.178.714,26	0,25
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	14,88	7,42	0,02	0,96	-0,27	-3,09	3.310.462,35	0,37
OCCAM FIC FIA	13,41	7,61	0,03	1,54	-0,25	-2,37	4.574.974,60	0,52
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	21,91	9,02	0,05	2,82	-0,33	-6,30	5.455.272,26	0,61



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	18,38	7,71	0,42		-0,27	-3,99	52.511.684,71	5,92
Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 5,49%								
Artigo 9º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,15	8,36	0,01	11,03	-0,24	-3,87	4.444.251,33	0,50
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30,31	13,18	0,01	11,44	-0,36	-9,79	2.679.157,70	0,30
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,62	9,24	0,00	9,24	-0,24	-4,04	2.479.060,51	0,28
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	13,77	5,88	0,05	5,14	-0,18	-1,43	14.621.858,58	1,65
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	13,48	7,12	-0,01	7,67	-0,37	-3,95	8.749.869,11	0,99
Sub-total	13,09	5,49	0,06		-0,33	-3,36	32.974.197,23	3,72
Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 1,37%								
Artigo 10º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	7,31	2,86	0,01	4,83	-0,32	-1,32	2.147.986,95	0,24
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,39	1,79	0,00	7,36	-0,05	0,61	23.816.872,63	2,68
Sub-total	7,00	1,64	0,00		-0,08	0,44	25.964.859,58	2,93
Artigo 10º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	2,45	0,54	0,00	0,59	-0,12	0,71	2.179.231,75	0,25
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,66	0,04	0,00	0,04	-1,79	-0,19	3.140.885,34	0,35
Sub-total	0,61	0,23	0,00		-1,35	0,18	5.320.117,09	0,60
Fundos Imobiliários Value-At-Risk: 0,64%								
Artigo 11º								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CXR11	7,57	2,35	0,00	7,65	-0,31	-1,31	1.198.800,00	0,14
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,38	0,02	0,00	0,02	-2,92	-0,11	3.209.966,61	0,36
Sub-total	2,34	0,64	0,00		-0,61	-0,44	4.408.766,61	0,50



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	1,00	0,43	0,00	0,44	-0,54	0,45	25.381.309,10	2,19
NTN-B 150535 (5,396600%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,67	0,68	1.013.428,10	0,09
NTN-B 150535 (6,180000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,34	0,74	34.142.748,08	2,95
NTN-B 150545 (5,470100%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,63	0,69	404.891,47	0,03
NTN-B 150545 (5,480000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,63	0,69	45.440,52	0,00
NTN-B 150545 (5,500000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,62	0,69	5.707.545,97	0,49
NTN-B 150545 (5,600500%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,58	0,70	2.697.198,80	0,23
NTN-B 150545 (6,015000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,41	0,73	25.230.267,80	2,18
NTN-B 150545 (6,260000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,31	0,75	61.751.291,85	5,33
NTN-B 150545 (6,400000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,25	0,76	3.083.715,54	0,27
NTN-B 150555 (5,548000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,60	0,69	5.623.467,63	0,49
NTN-B 150555 (5,595500%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,58	0,70	2.537.625,90	0,22
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,55	0,70	11.792.290,17	1,02
NTN-B 150555 (6,080000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,38	0,74	5.022.312,66	0,43
NTN-B 150555 (6,135000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,36	0,74	58.672.370,57	5,07
NTN-B 150555 (6,210000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,33	0,75	23.375.471,37	2,02
NTN-B 150555 (6,230000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,32	0,75	5.463.168,96	0,47
NTN-B 150555 (6,270000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,30	0,75	40.271.704,37	3,48
NTN-B 150555 (6,325000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,28	0,76	4.600.165,76	0,40
NTN-B 150555 (6,372000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,26	0,76	21.128.578,98	1,82
NTN-B 150824 (6,461000%)	0,19	0,19	0,00	0,20	-1,22	0,77	859.777,65	0,07
NTN-B 150824 (6,600000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,16	0,78	4.139.541,29	0,36
NTN-B 150824 (6,610000%)	0,19	0,19	0,00	0,20	-1,16	0,78	3.301.341,68	0,29
NTN-B 150824 (6,620000%)	0,19	0,19	0,00	0,20	-1,15	0,78	163.379,44	0,01
NTN-B 150830 (6,240000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,31	0,75	15.173.090,62	1,31



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 (5,390000%)	0,19	0,18	0,00	0,19	-1,67	0,68	1.341.270,14	0,12
NTN-B 150840 (6,200000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,33	0,75	44.686.963,07	3,86
NTN-B 150850 (5,520000%)	0,19	0,18	0,00	0,19	-1,61	0,69	3.932.337,90	0,34
NTN-B 150850 (5,797500%)	0,19	0,18	0,00	0,19	-1,50	0,71	1.592.921,68	0,14
NTN-B 150850 (6,140000%)	0,36	0,21	0,00	0,21	-0,71	0,74	40.270.110,96	3,48
NTN-B 150850 (6,270000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,30	0,75	33.733.925,49	2,91
NTN-B 150850 (6,385000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,25	0,76	22.639.448,20	1,95
NTN-B 150850 (6,427000%)	0,19	0,05	0,00	0,06	-1,24	0,76	32.479.541,25	2,80
Sub-total	0,20	0,06	0,00		-1,31	0,73	542.258.642,97	46,82
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	0,05	0,03	0,00	0,03	-0,83	0,96	6.270.135,49	0,54
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,00	0,43	0,00	1,89	-0,56	0,44	8.516.137,82	0,74
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,66	2,07	0,00	0,45	-0,28	-0,83	1.860.266,91	0,16
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	6,68	2,08	0,01	0,45	-0,28	-0,84	4.543.841,31	0,39
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3,01	1,19	0,01	0,00	-0,44	-0,32	8.370.223,62	0,72
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,32	2,00	0,18	0,03	-0,26	-0,66	139.828.768,93	12,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	NaN	0,00	NaN	-0,50	-0,29	0,00	0,00
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,00	0,43	0,00	1,89	-0,56	0,43	2.861.295,10	0,25
Sub-total	5,44	1,76	0,20		-0,28	-0,50	172.250.669,18	14,87
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	0,06	0,04	0,00	0,04	0,98	1,05	100.049.057,88	8,64
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	4,78	1,71	0,01	1,72	-0,16	0,25	10.787.644,21	0,93
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,68	0,65	0,01	0,65	-0,34	0,43	20.044.516,39	1,73
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,02	0,00	0,02	-4,77	0,90	2.073.190,92	0,18
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	0,01	0,00	0,01	-41,97	0,91	919.665,49	0,08



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,03	0,02	0,00	0,02	1,71	1,05	103.042.877,63	8,90
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,83	0,58	0,01	0,58	-0,35	0,70	43.011.751,26	3,71
Sub-total	0,49	0,17	0,03		-0,29	0,86	279.928.703,78	24,17
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	2,01	0,79	0,00	0,79	-0,51	-0,03	5.634.848,83	0,49
Sub-total	2,01	0,79	0,00		-0,51	-0,03	5.634.848,83	0,49
Renda Variável								
Value-At-Risk: 7,64%								
Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	16,13	7,51	0,06	3,34	-0,35	-4,68	10.677.785,90	0,92
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,09	7,93	0,22	4,12	-0,24	-3,86	36.325.248,64	3,14
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	17,22	7,88	0,03	2,10	-0,24	-3,05	5.556.463,19	0,48
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	14,88	7,42	0,04	0,96	-0,27	-3,09	7.564.345,55	0,65
OCCAM FIC FIA	13,41	7,61	0,06	1,54	-0,25	-2,37	9.958.518,03	0,86
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,43	9,16	0,01	4,22	-0,35	-7,30	878.333,15	0,08
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	21,91	9,02	0,06	2,82	-0,33	-6,30	8.968.401,38	0,77
Sub-total	17,69	7,64	0,49		-0,28	-3,98	79.929.095,84	6,90
Investimentos no Exterior								
Value-At-Risk: 5,93%								
Artigo 9º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,15	8,36	0,00	11,03	-0,24	-3,87	4.444.251,33	0,38
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30,31	13,18	0,01	11,44	-0,36	-9,79	3.520.187,03	0,30
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,62	9,24	0,00	9,24	-0,24	-4,04	9.318.552,01	0,80
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	13,77	5,88	0,03	5,14	-0,18	-1,43	14.621.858,58	1,26
SCHRODER SUSTENTABILIDADE	13,48	7,12	-0,01	7,67	-0,37	-3,95	10.454.469,93	0,90



AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE								
Sub-total	13,81	5,93	0,04		-0,33	-3,63	42.359.318,88	3,66
Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 1,37%								
Artigo 10º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	7,31	2,86	0,00	4,83	-0,32	-1,32	2.147.986,95	0,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,39	1,79	0,00	7,36	-0,05	0,61	23.816.872,63	2,06
Sub-total	7,00	1,64	0,00		-0,08	0,44	25.964.859,58	2,24
Artigo 10º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	2,45	0,54	0,00	0,59	-0,12	0,71	2.179.231,75	0,19
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,66	0,04	0,00	0,04	-1,79	-0,19	3.140.885,34	0,27
Sub-total	0,61	0,23	0,00		-1,35	0,18	5.320.117,09	0,46
Fundos Imobiliários Value-At-Risk: 0,64%								
Artigo 11º								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CXRI11	7,57	2,35	0,00	7,65	-0,31	-1,31	1.198.800,00	0,10
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,38	0,02	0,00	0,02	-2,92	-0,11	3.209.966,61	0,28
Sub-total	2,34	0,64	0,00		-0,61	-0,44	4.408.766,61	0,38

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 na reunião dos dias 18/10/2023 e 23/10/2023 – 10ª 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\$ 804.887,26	D+0
		PARA	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	R\$ 804.887,26	D+0
FINANCEIRO	PARCIAL	DE	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	32.972.942/0001-28	R\$ 23.000.000,00	D+0
		PARA	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	R\$ 23.000.000,00	D+0
PREVIDENCIARIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 825.000,00	D+0
		PARA	PATRIA PE VII ADVISORY FIP MULTI-CLASSE C	43.120.902-0001-74	R\$ 825.000,00	ACIMA 365
PREVIDENCIARIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 3.160.294,51	D+0
		PARA	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	R\$ 3.160.294,51	D+0
PREVIDENCIARIO	TOTAL	DE	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.386.926/0001-71	R\$ 8.876.960,22	D+0
		PARA	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	R\$ 8.876.960,22	D+0
PREVIDENCIARIO	PARCIAL	DE	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	32.972.942/0001-28	R\$ 20.000.000,00	D+0
		PARA	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	R\$ 20.000.000,00	D+0

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

BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
FINANCEIRO	R\$ 23.804.887,26	R\$ 23.804.887,26	R\$ 0,00	----	25/10/2023 e 27/10/2023

BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
PREVIDENCIÁRIO	R\$ 32.037.254,73	R\$ 32.069.186,40	R\$ 31.931,67	Valor referente à valorização das cotas do fundo resgatado no período entre a reunião e o resgate	25/10/2023 e 27/10/2023



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

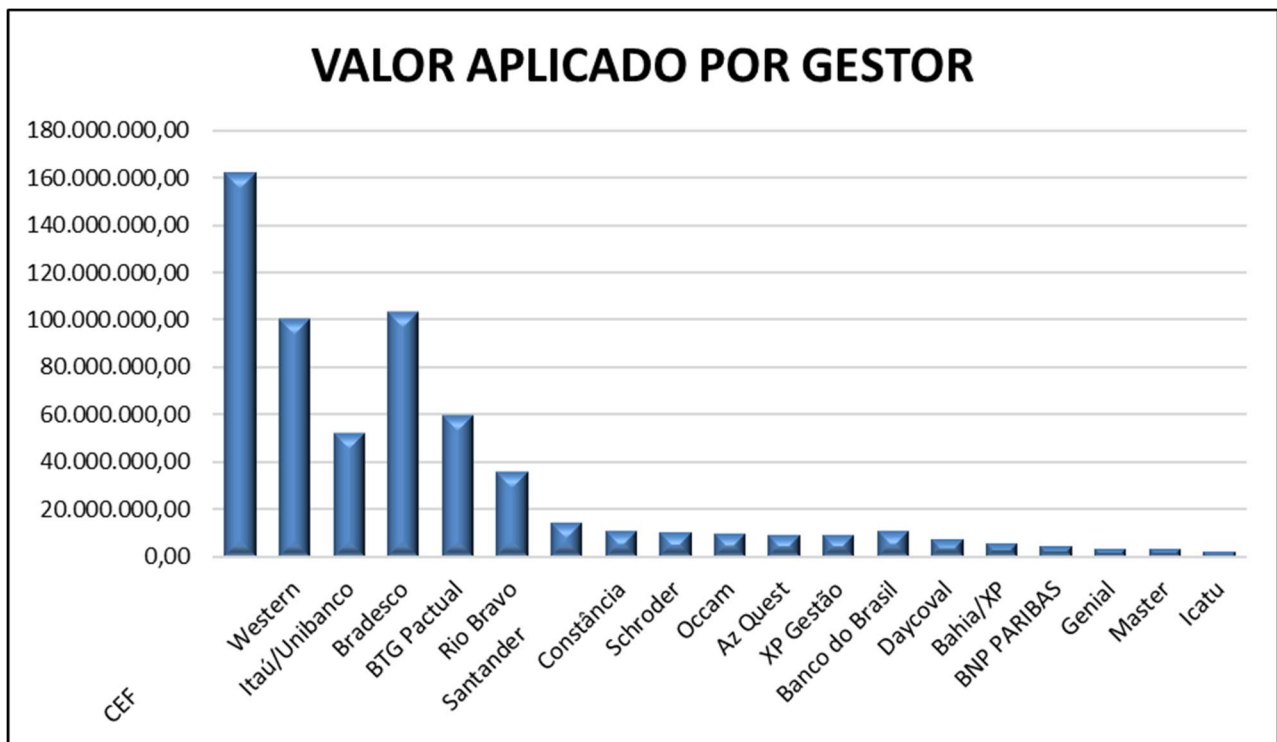
@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

PATRIA PE VII ADVISORY FIP MULTI-CLASSE C					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
PREVIDENCIÁRIO	R\$ 825.000,00	R\$ 825.000,00	R\$ 0,00	----	01/11/2023

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	16.412.305,67	-----	48.440,57	166.576,33	16.530.441,43	1,02%	CDI

Guarujá, 30 de novembro 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