

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO DE GESTÃO DE RISCO

MARÇO 2024



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
a) <i>Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução – Fundo Financeiro.....</i>	<i>3</i>
b) <i>Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução – Fundo Previdenciário.....</i>	<i>4</i>
c) <i>Distribuição dos recursos por segmento e patrimônio x resolução – Consolidado</i>	<i>5</i>
3. RISCO	6
3.1 RISCO POR ARTIGO	6
a) <i>Risco Fundo Financeiro</i>	<i>7</i>
b) <i>Risco Fundo Previdenciário</i>	<i>7</i>
c) <i>Risco Consolidado</i>	<i>7</i>
3.2 RISCO X RETORNO POR ATIVO	8
a) <i>Risco X Retorno por Ativo – Fundo Financeiro.....</i>	<i>8</i>
b) <i>Risco X Retorno por Ativo – Fundo Previdenciário.....</i>	<i>10</i>
c) <i>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.....	18



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 MARÇO 2024

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 capitalizar o patrimônio da GuarujáPrev, sempre com segurança, eficiência, ética e zelo.

1. Cenário Nacional

Em março de 2024, o **Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA)** foi de **0,16%**, um recuo de 0,67 ponto percentual (p.p.) frente à taxa de fevereiro (0,83%). Com isso, a variação acumulada no ano ficou em 1,42% e 3,93% em 12 meses.

O **Ibovespa**, principal índice da bolsa brasileira, fechou o mês com desvalorização de **0,71%**, acumulando queda de 4,53% no ano.

Com relação ao câmbio, o **Dólar Comercial** encerrou o mês cotado a **R\$ 5,15** com alta de 0,86% em relação a fevereiro.

A Taxa Básica de Juros (**Selic**) definida pelo Banco Central está em **10,75% a.a.**, vigente desde 21/03/2024.



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	34.422.351,09	11,17	20,00	46,48	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	76.706.456,79	24,88	10,00	16,63	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	153.437.303,45	49,77	2,00	6,96	60,00	0,00	80,00
Total Renda Fixa		264.566.111,33	85,82					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	31.212.930,93	10,12	0,00	3,97	25,00	0,00	50,00
Total Renda Variável		31.212.930,93	10,12					50,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	12.501.538,41	4,06	0,00	5,00	8,00	0,00	10,00
Total Investimentos no Exterior		12.501.538,41	4,06					10,00
Total		308.280.580,67	100,00	-----				

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	518.355.353,45	53,65	20,00	46,48	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	123.963.720,10	12,83	10,00	16,63	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	165.414.702,90	17,12	2,00	6,96	60,00	0,00	80,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	5.924.768,73	0,61	0,00	0,50	8,00	0,00	20,00
Total Renda Fixa		813.658.545,18	84,21					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	69.336.890,15	7,18	0,00	3,97	25,00	0,00	50,00
Total Renda Variável		69.336.890,15	7,18					50,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	42.144.661,07	4,36	0,00	5,00	8,00	0,00	10,00
Total Investimentos no Exterior		42.144.661,07	4,36					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	27.879.395,32	2,89	0,00	13,47	15,00	0,00	15,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	6.670.342,26	0,69	0,00	1,53	5,00	0,00	15,00
Total Investimentos Estruturados		34.549.737,58	3,58					20,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.533.265,18	0,68	0,00	0,47	3,00	0,00	20,00
Total Fundos Imobiliários		6.533.265,18	0,68					20,00
Total		966.223.099,16	100,00					

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

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	552.777.704,54	43,37	20,00	46,48	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	200.670.176,89	15,74	10,00	16,63	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	318.852.006,35	25,02	2,00	6,96	60,00	0,00	80,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	5.924.768,73	0,46	0,00	0,50	8,00	0,00	20,00
Total Renda Fixa		1.078.224.656,51	84,60					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	100.549.821,08	7,89	0,00	3,97	25,00	0,00	50,00
Total Renda Variável		100.549.821,08	7,89					50,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	54.646.199,48	4,29	0,00	5,00	8,00	0,00	10,00
Total Investimentos no Exterior		54.646.199,48	4,29					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	27.879.395,32	2,19	0,00	13,47	15,00	0,00	15,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	6.670.342,26	0,52	0,00	1,53	5,00	0,00	15,00
Total Investimentos Estruturados		34.549.737,58	2,71					20,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	6.533.265,18	0,51	0,00	0,47	3,00	0,00	20,00
Total Fundos Imobiliários		6.533.265,18	0,51					20,00
Total		1.274.503.679,83	100,00					-----

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 2024 da GuarujáPrev estipulou o limite para o VaR conforme tabela abaixo:

VaR – Política de Investimentos 2024	
MANDATO	LIMITE
Renda Fixa	5%
Renda Variável	20%
Investimento no exterior	20%
Fundos Estruturados	20%
Fundos Imobiliários	20%
Empréstimo Consignado	5%

**a) Risco Fundo Financeiro**

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,00%							
Value-At-Risk (R\$): 2.690.285,33							
Value-At-Risk: 0,87%							
ARTIGO	VOLATILIDADE(1)	VAR(2)	CVAR(3)	SHARPE	RENT.	VALOR(R\$)	% CARTEIRA
Artigo 7º	0,71	0,35	0,22	-0,20	0,69	264.566.111,33	85,82
Artigo 8º	9,29	5,79	0,49	-0,10	-0,07	31.212.930,93	10,12
Artigo 9º	17,93	9,42	0,15	0,09	2,39	12.501.538,41	4,06
GUARUJÁ FINANCEIRO	1,48	0,87	0,87	-0,10	0,68	308.280.580,67	100,00

b) Risco Fundo Previdenciário

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,00%							
Value-At-Risk (R\$): 7.049.136,17							
Value-At-Risk: 0,73%							
ARTIGO	VOLATILIDADE(1)	VAR(2)	CVAR(3)	SHARPE	RENT.	VALOR(R\$)	% CARTEIRA
Artigo 7º	0,50	0,20	0,11	0,05	0,86	813.658.545,18	84,21
Artigo 8º	9,49	6,13	0,41	-0,05	0,35	69.336.890,15	7,18
Artigo 9º	10,11	5,35	0,10	0,22	3,03	42.144.661,07	4,36
Artigo 10º	9,31	3,66	0,11	-0,11	-0,23	34.549.737,58	3,58
Artigo 11º	17,60	1,94	0,00	-0,31	-4,71	6.533.265,18	0,68
GUARUJÁ PREVIDENCIÁRIO	1,27	0,73	0,73	0,00	0,84	966.223.099,16	100,00

c) Risco Consolidado

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,00%							
Value-At-Risk (R\$): 9.662.060,83							
Value-At-Risk: 0,76%							
ARTIGO	VOLATILIDADE(1)	VAR(2)	CVAR(3)	SHARPE	RENT.	VALOR(R\$)	% CARTEIRA
Artigo 7º	0,54	0,23	0,13	-0,03	0,82	1.078.224.656,51	84,60
Artigo 8º	9,39	6,00	0,43	-0,07	0,22	100.549.821,08	7,89
Artigo 9º	11,40	6,14	0,11	0,18	2,89	54.646.199,48	4,29
Artigo 10º	9,31	3,66	0,08	-0,11	-0,23	34.549.737,58	2,71
Artigo 11º	17,60	1,94	0,00	-0,31	-4,71	6.533.265,18	0,51
GUARUJÁ CONSOLIDADO	1,31	0,76	0,76	-0,03	0,80	1.274.503.679,83	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: 0,35%								
Artigo 7º I, Alínea a								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	0,42	0,42	0,00	0,44	0,24	0,93	25.794.114,17	8,37
NTN-B 150824 (6,461000%)	0,26	0,08	0,00	0,11	0,86	1,05	876.046,44	0,28
NTN-B 150824 (6,600000%)	0,26	0,08	0,00	0,11	0,90	1,06	4.219.999,25	1,37
NTN-B 150824 (6,610000%)	0,26	0,08	0,00	0,11	0,90	1,06	3.365.624,42	1,09
NTN-B 150824 (6,620000%)	0,26	0,08	0,00	0,11	0,91	1,06	166.566,81	0,05
Sub-total	0,32	0,32	0,00		0,42	0,97	34.422.351,09	11,17
Artigo 7º I, Alínea b								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	3,21	1,86	0,01	1,86	-0,25	0,04	2.913.973,96	0,95
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	0,05	0,00	0,04	-0,26	0,79	6.546.965,11	2,12
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,93	0,54	0,00	0,00	-0,09	0,75	3.043.725,79	0,99
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,28	1,22	0,17	0,01	-0,34	0,06	59.660.202,97	19,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,51	0,84	0,01	0,02	-0,22	0,50	4.541.588,96	1,47
Sub-total	1,96	1,06	0,19		-0,34	0,16	76.706.456,79	24,88
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	0,03	0,00	0,02	1,33	0,92	42.802.716,12	13,88
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	1,20	1,52	0,00	1,52	0,49	1,42	11.095.877,12	3,60
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,16	0,32	0,01	0,32	-0,11	0,71	11.860.554,05	3,85
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	2.868.016,92	0,93
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	0,01	NaN	0,00	NaN	-6,51	0,75	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	60.780.237,13	19,72
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,53	0,31	0,01	0,31	-0,37	0,63	24.029.902,11	7,79
Sub-total	0,18	0,14	0,03		0,31	0,89	153.437.303,45	49,77



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Renda Variável								
Value-At-Risk: 5,79%								
Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	8,09	5,29	0,09	2,40	0,03	1,06	6.303.633,44	2,04
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,10	3,77	-0,06	0,22	5.299.944,66	1,72
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	11,00	6,10	0,06	1,42	-0,23	-1,71	3.779.893,53	1,23
DAYCOVAL IBOVSPA ATIVO FIA	11,07	5,53	0,07	0,69	-0,16	-0,90	4.766.947,29	1,55
OCCAM FIC FIA	10,96	5,80	0,09	1,11	-0,21	-1,50	5.989.638,25	1,94
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	11,69	7,22	0,02	3,12	0,00	0,83	977.926,82	0,32
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	8,37	6,80	0,07	3,83	0,17	2,29	4.094.946,94	1,33
Sub-total	9,29	5,79	0,49		-0,10	-0,07	31.212.930,93	10,12
Investimentos no Exterior								
Value-At-Risk: 9,42%								
Artigo 9º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	29,54	15,92	0,02	15,23	0,06	2,58	1.171.555,80	0,38
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,55	10,03	0,12	10,02	0,07	2,16	9.220.360,49	2,99
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,02	6,41	0,01	6,36	0,18	3,31	2.109.622,12	0,68
Sub-total	17,93	9,42	0,15		0,09	2,39	12.501.538,41	4,06



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: 0,20%								
Artigo 7º I, Alínea a								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,396600%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,54	0,97	1.031.269,94	0,11
NTN-B 150535 (6,180000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,78	1,03	34.790.810,39	3,60
NTN-B 150545 (5,470100%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,57	0,98	412.562,98	0,04
NTN-B 150545 (5,480000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,57	0,98	46.301,86	0,00
NTN-B 150545 (5,500000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,57	0,98	5.815.828,33	0,60
NTN-B 150545 (5,600500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,60	0,99	2.748.587,83	0,28
NTN-B 150545 (6,015000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,73	1,02	25.718.608,22	2,66
NTN-B 150545 (6,260000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,80	1,04	62.956.215,51	6,52
NTN-B 150545 (6,400000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,84	1,05	3.144.140,51	0,33
NTN-B 150555 (5,548000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,59	0,98	5.734.342,80	0,59
NTN-B 150555 (5,595500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,60	0,99	2.587.680,45	0,27
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	12.025.037,23	1,24
NTN-B 150555 (6,080000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,75	1,02	5.121.617,10	0,53
NTN-B 150555 (6,135000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,76	1,03	59.832.520,60	6,19
NTN-B 150555 (6,210000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,03	23.837.667,42	2,47
NTN-B 150555 (6,230000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,04	5.571.192,64	0,58
NTN-B 150555 (6,270000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,80	1,04	41.067.953,41	4,25
NTN-B 150555 (6,325000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,82	1,04	4.691.108,84	0,49
NTN-B 150555 (6,372000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,83	1,05	21.546.221,04	2,23
NTN-B 150830 (6,240000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,04	15.458.967,21	1,60
NTN-B 150840 (5,390000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,54	0,97	1.365.828,57	0,14
NTN-B 150840 (6,200000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,78	1,03	45.547.907,54	4,71
NTN-B 150850 (5,520000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,58	0,98	4.008.817,39	0,41
NTN-B 150850 (5,797500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,66	1,00	1.624.095,52	0,17
NTN-B 150850 (6,140000%)	0,36	0,24	0,00	0,25	0,55	1,03	41.062.869,10	4,25
NTN-B 150850 (6,270000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,80	1,04	34.399.260,42	3,56
NTN-B 150850 (6,385000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,84	1,05	23.086.601,97	2,39
NTN-B 150850 (6,427000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,85	1,05	33.121.338,63	3,43
Sub-total	0,25	0,15	0,00		0,80	1,03	518.355.353,45	53,65
Artigo 7º I, Alínea b								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	3,21	1,86	0,01	1,86	-0,25	0,04	12.149.557,25	1,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,42	0,33	0,00	1,29	0,20	0,92	8.656.067,91	0,90
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	2,33	1,25	0,00	0,38	-0,36	0,00	1.907.406,00	0,20
CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	2,34	1,25	0,00	0,38	-0,36	0,00	4.656.450,66	0,48



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	0,93	0,54	0,00	0,00	-0,09	0,75	5.772.535,70	0,60
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,28	1,22	0,08	0,01	-0,34	0,06	87.915.203,14	9,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI	0,42	0,33	0,00	1,29	0,19	0,91	2.906.499,44	0,30
Sub-total	1,99	1,10	0,10		-0,35	0,14	123.963.720,10	12,83
Artigo 7º III, Alínea a								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET DI MAX RF REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,07	0,03	0,00	0,02	1,33	0,92	62.051.424,91	6,42
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,16	0,32	0,00	0,32	-0,11	0,71	9.131.577,01	0,95
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	7.038.776,64	0,73
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,01	0,00	0,00	-6,51	0,75	964.941,01	0,10
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	65.323.091,74	6,76
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,53	0,31	0,00	0,31	-0,37	0,63	20.904.891,59	2,16
Sub-total	0,12	0,06	0,01		0,24	0,86	165.414.702,90	17,12
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	1,59	0,52	0,00	0,53	-0,04	0,77	5.924.768,73	0,61
Sub-total	1,59	0,52	0,00		-0,04	0,77	5.924.768,73	0,61
Renda Variável								
Value-At-Risk: 6,13%								
Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	9,45	5,44	0,04	2,43	0,05	1,28	8.727.543,92	0,90
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	8,09	5,29	0,03	2,40	0,03	1,06	6.029.331,07	0,62
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,24	3,77	-0,06	0,22	36.983.398,48	3,83
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	11,00	6,10	0,01	1,42	-0,23	-1,71	2.438.105,41	0,25
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	11,07	5,53	0,02	0,69	-0,16	-0,90	3.709.739,73	0,38
OCCAM FIC FIA	10,96	5,80	0,03	1,11	-0,21	-1,50	5.090.038,42	0,53
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	8,37	6,80	0,04	3,83	0,17	2,29	6.358.733,12	0,66
Sub-total	9,49	6,13	0,41		-0,05	0,35	69.336.890,15	7,18



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Investimentos no Exterior								
Value-At-Risk: 5,35%								
Artigo 9º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,38	6,62	0,01	8,39	0,11	2,36	5.911.703,87	0,61
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	29,54	15,92	0,02	15,23	0,06	2,58	3.732.072,87	0,39
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,55	10,03	0,01	10,02	0,07	2,16	3.342.036,70	0,35
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	9,58	4,70	0,05	4,15	0,26	3,35	18.329.967,82	1,90
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,02	6,41	0,01	6,36	0,18	3,31	10.828.879,81	1,12
Sub-total	10,11	5,35	0,10		0,22	3,03	42.144.661,07	4,36
Investimentos Estruturados								
Value-At-Risk: 3,66%								
Artigo 10º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	4,86	1,81	0,00	4,27	0,10	1,32	2.359.007,51	0,24
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	8,78	4,84	0,11	1,10	-0,20	-0,96	25.520.387,81	2,64
Sub-total	8,43	4,55	0,11		-0,19	-0,77	27.879.395,32	2,89
Artigo 10º II								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTI CLASSE C	27,54	0,12	0,00	0,16	0,13	4,55	3.259.608,74	0,34
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,63	0,56	0,00	0,56	-1,61	-0,18	3.410.733,52	0,35
Sub-total	12,98	0,29	0,00		0,09	2,01	6.670.342,26	0,69
Fundos Imobiliários								
Value-At-Risk: 1,94%								
Artigo 11º								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CXRI11	85,30	3,14	0,00	6,64	-0,25	-20,89	1.203.600,00	0,12
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,35	2,34	0,00	2,34	-2,69	-0,10	5.329.665,18	0,55
Sub-total	17,60	1,94	0,00		-0,31	-4,71	6.533.265,18	0,68



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: 0,23%								
Artigo 7º I, Alínea a								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	0,42	0,42	0,00	0,44	0,24	0,93	25.794.114,17	2,02
NTN-B 150535 (5,396600%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,54	0,97	1.031.269,94	0,08
NTN-B 150535 (6,180000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,78	1,03	34.790.810,39	2,73
NTN-B 150545 (5,470100%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,57	0,98	412.562,98	0,03
NTN-B 150545 (5,480000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,57	0,98	46.301,86	0,00
NTN-B 150545 (5,500000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,57	0,98	5.815.828,33	0,46
NTN-B 150545 (5,600500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,60	0,99	2.748.587,83	0,22
NTN-B 150545 (6,015000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,73	1,02	25.718.608,22	2,02
NTN-B 150545 (6,260000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,80	1,04	62.956.215,51	4,94
NTN-B 150545 (6,400000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,84	1,05	3.144.140,51	0,25
NTN-B 150555 (5,548000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,59	0,98	5.734.342,80	0,45
NTN-B 150555 (5,595500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,60	0,99	2.587.680,45	0,20
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	12.025.037,23	0,94
NTN-B 150555 (6,080000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,75	1,02	5.121.617,10	0,40
NTN-B 150555 (6,135000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,76	1,03	59.832.520,60	4,69
NTN-B 150555 (6,210000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,03	23.837.667,42	1,87
NTN-B 150555 (6,230000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,04	5.571.192,64	0,44
NTN-B 150555 (6,270000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,80	1,04	41.067.953,41	3,22
NTN-B 150555 (6,325000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,82	1,04	4.691.108,84	0,37
NTN-B 150555 (6,372000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,83	1,05	21.546.221,04	1,69
NTN-B 150824 (6,461000%)	0,26	0,08	0,00	0,11	0,86	1,05	876.046,44	0,07
NTN-B 150824 (6,600000%)	0,26	0,08	0,00	0,11	0,90	1,06	4.219.999,25	0,33
NTN-B 150824 (6,610000%)	0,26	0,08	0,00	0,11	0,90	1,06	3.365.624,42	0,26
NTN-B 150824 (6,620000%)	0,26	0,08	0,00	0,11	0,91	1,06	166.566,81	0,01
NTN-B 150830 (6,240000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,04	15.458.967,21	1,21
NTN-B 150840 (5,390000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,54	0,97	1.365.828,57	0,11
NTN-B 150840 (6,200000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,78	1,03	45.547.907,54	3,57
NTN-B 150850 (5,520000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,58	0,98	4.008.817,39	0,31
NTN-B 150850 (5,797500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,66	1,00	1.624.095,52	0,13
NTN-B 150850 (6,140000%)	0,36	0,24	0,00	0,25	0,55	1,03	41.062.869,10	3,22
NTN-B 150850 (6,270000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,80	1,04	34.399.260,42	2,70
NTN-B 150850 (6,385000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,84	1,05	23.086.601,97	1,81
NTN-B 150850 (6,427000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,85	1,05	33.121.338,63	2,60
Sub-total	0,24	0,15	0,00		0,82	1,03	552.777.704,54	43,37
Artigo 7º I, Alínea b								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	3,21	1,86	0,01	1,86	-0,25	0,04	15.063.531,21	1,18
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	0,05	0,00	0,04	-0,26	0,79	6.546.965,11	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

FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,42	0,33	0,00	1,29	0,20	0,92	8.656.067,91	0,68
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	2,33	1,25	0,00	0,38	-0,36	0,00	1.907.406,00	0,15
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	2,34	1,25	0,00	0,38	-0,36	0,00	4.656.450,66	0,37
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,93	0,54	0,00	0,00	-0,09	0,75	8.816.261,49	0,69
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,28	1,22	0,10	0,01	-0,34	0,06	147.575.406,11	11,58
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,51	0,84	0,00	0,02	-0,22	0,50	4.541.588,96	0,36
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI	0,42	0,33	0,00	1,29	0,19	0,91	2.906.499,44	0,23
Sub-total	1,98	1,08	0,12		-0,34	0,15	200.670.176,89	15,74
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	0,03	0,00	0,02	1,33	0,92	104.854.141,03	8,23
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	1,20	1,52	0,00	1,52	0,49	1,42	11.095.877,12	0,87
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,16	0,32	0,00	0,32	-0,11	0,71	20.992.131,06	1,65
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	9.906.793,56	0,78
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,01	0,00	0,00	-6,51	0,75	964.941,01	0,08
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	126.103.328,87	9,89
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,53	0,31	0,01	0,31	-0,37	0,63	44.934.793,70	3,53
Sub-total	0,14	0,09	0,01		0,29	0,87	318.852.006,35	25,02
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	1,59	0,52	0,00	0,53	-0,04	0,77	5.924.768,73	0,46
Sub-total	1,59	0,52	0,00		-0,04	0,77	5.924.768,73	0,46
Renda Variável								
Value-At-Risk: 6,00%								
Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	9,45	5,44	0,03	2,43	0,05	1,28	8.727.543,92	0,68
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	8,09	5,29	0,04	2,40	0,03	1,06	12.332.964,51	0,97
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,20	3,77	-0,06	0,22	42.283.343,14	3,32
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	11,00	6,10	0,03	1,42	-0,23	-1,71	6.217.998,94	0,49
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	11,07	5,53	0,03	0,69	-0,16	-0,90	8.476.687,02	0,67
OCCAM FIC FIA	10,96	5,80	0,04	1,11	-0,21	-1,50	11.079.676,67	0,87



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	11,69	7,22	0,00	3,12	0,00	0,83	977.926,82	0,08
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	8,37	6,80	0,05	3,83	0,17	2,29	10.453.680,06	0,82
Sub-total	9,39	6,00	0,43		-0,07	0,22	100.549.821,08	7,89

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,14%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,38	6,62	0,01	8,39	0,11	2,36	5.911.703,87	0,46
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	29,54	15,92	0,02	15,23	0,06	2,58	4.903.628,67	0,38
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,55	10,03	0,03	10,02	0,07	2,16	12.562.397,19	0,99
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	9,58	4,70	0,04	4,15	0,26	3,35	18.329.967,82	1,44
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,02	6,41	0,01	6,36	0,18	3,31	12.938.501,93	1,02
Sub-total	11,40	6,14	0,11		0,18	2,89	54.646.199,48	4,29

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,66%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	4,86	1,81	0,00	4,27	0,10	1,32	2.359.007,51	0,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	8,78	4,84	0,08	1,10	-0,20	-0,96	25.520.387,81	2,00
Sub-total	8,43	4,55	0,08		-0,19	-0,77	27.879.395,32	2,19

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	27,54	0,12	0,00	0,16	0,13	4,55	3.259.608,74	0,26
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	0,63	0,56	0,00	0,56	-1,61	-0,18	3.410.733,52	0,27
Sub-total	12,98	0,29	0,00		0,09	2,01	6.670.342,26	0,52

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 1,94%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CXRI11	85,30	3,14	0,00	6,64	-0,25	-20,89	1.203.600,00	0,09
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,35	2,34	0,00	2,34	-2,69	-0,10	5.329.665,18	0,42
Sub-total	17,60	1,94	0,00		-0,31	-4,71	6.533.265,18	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

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



4. Fluxo de movimentações estratégicas de investimentos

Deliberações do Comitê de Investimentos na reunião do dia 21/03/2024 –
3ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos de 2024:

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\$ 1.530.871,45	D+0
		PARA	TITULOS PÚBLICOS 2024	---	R\$ 1.530.871,45	D+1
PREVIDENCIARIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 6.540.056,59	D+0
		PARA	WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO AÇÕES BDR NÍVEL I	19.831.126/0001-36	R\$ 6.540.056,59	D+1

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

NTN-B 2024					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
FINANCEIRO	R\$ 1.530.871,45	R\$ 1.528.080,33	R\$ 2.791,12	Arredondamento de valor do PU dos Títulos Públicos	03/04/2024

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

WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO AÇÕES BDR NÍVEL I					
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO	DATA APLICAÇÃO
PREVIDENCIÁRIO	R\$ 6.540.056,59	R\$ 6.540.056,59	R\$ 0,00	-----	02/04/2024



5. Alocação por instituição



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	16.855.219,56	-----	265.558,41	146.280,17	16.735.941,32	0,87%	CDI



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050 

@guarujaprevidencia 

@guarujaprevidencia 

guarujaprevidencia.sp.gov.br 

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

Guarujá, 03 de Maio de 2024.

(Assinatura digital)

**Laydianne Alves da S. Rosa
Gonçalves**

Membro do Núcleo de Investimentos
Analista Previdenciário Economista
GuarujáPrev

(Assinatura digital)

Lucio Villafranca Motta

Analista Previdenciário Economista
GuarujáPrev