



**GUARUJÁPREV**

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

## **ATA DA 6ª (SEXTA) REUNIÃO ORDINÁRIA DE 2023 DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA GUARUJÁ PREVIDÊNCIA.**

Ao 22º dia do mês de junho do ano de dois mil e vinte e três, reuniram-se ordinariamente nas dependências da sala de reuniões “Luís Fernando Scalzitti Fioretti”, da sede da autarquia GuarujáPrev, situada na Av. Adhemar de Barros, nº 230, 1º. Andar - sala 18, no bairro de Santo Antônio, nesta cidade de Guarujá, em primeira chamada as 9h (nove horas) os membros do Comitê de Investimentos: Presidente do Comitê de Investimentos, Laydianne Alves da Silva Rosa Gonçalves, Presidente da Autarquia: Edler Antonio da Silva, Gerente de Planejamento Orçamento Contabilidade e Finanças: Lucielma Ferreira Feitosa, Gestor do Comitê de Investimentos: Fernando Antônio Gonçalves de Melo, Secretário da mesa Fábio Enrique Camilo José Esteves, e os membros Aline Borges de Carvalho – on-line e Zaqueu Elias da Silva Ferreira. Convidados: Davi de Castro Fernandes de Souza - Estagiário. Documentos recebidos/encaminhados: **A) Documentos Recebido: A)** o Memorando nº 373/2023 da Gerência de Planejamento, Orçamento, Contabilidade e Finanças. Ordem do dia: Dando início aos trabalhos, Sra. Laydianne Alves da Silva Rosa Gonçalves, observou quórum presencial e procedeu à leitura da pauta, a ordem do dia para operacionalização das atividades, que passou a ser objeto de análise pelos presentes: 1- Análise do cenário macroeconômico; 2 - Avaliação dos investimentos; 3 - Análise do fluxo de caixa; 4 - Proposições de investimentos/desinvestimentos; 5 – Credenciamento; 6- Relação de visitas técnicas de Instituições; 7 - Relatório Mensal; 8 - Acompanhamento do Pró-Gestão, e 9- Assuntos Gerais. **1. Análise do cenário macroeconômico:** Segundo o relatório macroeconômico da consultoria de Investimentos LDB “MERCADOS INTERNACIONAIS Ao longo do mês de maio os ecos da crise bancária americana, iniciada em meados de março, se dissiparam. Além disso, a volatilidade no segmento de renda fixa permaneceu alta, com especial destaque para o mercado americano. Ainda há uma leitura cautelosa, especialmente pela perspectiva mais desfavorável para as economias desenvolvidas, onde a inflação elevada e os juros restritivos sugerem crescimento fraco e alto grau de incerteza.



**GUARUJÁPREV**

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Nos EUA, os dados mais fortes de atividade e emprego e o arrefecimento do stress financeiro abrem a possibilidade para novas elevações da taxa básica de juros. O Fed, por sua vez, elevou a taxa de juros em 0,25%. No atual patamar, os juros continuarão exercendo efeito restritivo sobre a economia, que deve ser intensificado por condições creditícias mais apertadas, dada a situação mais complexa para os bancos regionais. A curva de juros americana voltou a subir, à medida em que a crise bancária precipitada pelo mercado em março foi ficando para trás e as conversas sobre a elevação do teto da dívida foram avançando. Dessa maneira, parte do alívio de março foi revertido. Na Zona do Euro, a inflação continua pressionada, com o avanço do núcleo, e a esperada queda deverá ocorrer de forma gradual. Em reflexo a dinâmica inflacionária, o Banco Central Europeu ainda deve promover um aumento de juros, o que deverá contribuir para a manutenção de um ritmo fraco da atividade na região. Sendo assim, permanece a expectativa de uma dinâmica desafiadora para as economias desenvolvidas nos próximos trimestres. A economia chinesa perdeu o dinamismo observado após o fim da política de covid zero. Onde, o setor de imóveis residenciais segue mostrando fraqueza. Dada a importância do setor para a economia chinesa, isso exerceu pressão baixista sobre commodities no mês. Assim, no mês de maio de 2023, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, renderam -1,32% e +0,25%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de -0,99% e +1,15%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, valorizaram +0,56% e +2,16%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos positivos de +6,70% e +9% nos últimos 12 meses. 2 BRASIL Localmente, dado o alívio nas expectativas de inflação para este ano e o avanço na aprovação do novo arcabouço fiscal, observamos queda ao longo da curva de juros locais. Adicionalmente, a atividade econômica continuou a dar sinais mais fortes, o que foi ratificado pelo crescimento de 1,9% do PIB do primeiro trimestre. A inflação continua seguindo um estágio de desaceleração mais lento, com medidas de núcleo pressionadas, isso sugere maior persistência da inflação em um horizonte



relevante para a condução da política monetária. Ainda assim, o Banco Central passou a adotar um discurso mais suave, no qual, apesar de reconhecer os desafios à frente, também mostra uma visão mais positiva em relação às perspectivas para a inflação. Adicionalmente, a meta de inflação poderá ser revista pelo Conselho Monetário Nacional. Essa definição e os próximos passos no campo fiscal terão efeito importante sobre as expectativas da inflação. Além disso, vale ressaltar que o andamento do arcabouço fiscal no Congresso e as medidas voltadas para o aumento de arrecadação, elemento fundamental para o sucesso do arcabouço, seguem como tema relevante para os próximos passos do Copom. Aqui, somente a título de exemplo da “Estrutura a Termo das Taxas de Juros - ETTJ” para o IPCA, estimada e divulgada pela ANBIMA para o fechamento de 05.06.2023, e apresentada no item 3 deste relatório como “Taxa de Juros Real”, a taxa de juros real com vencimento para 9 anos apresentava taxa de retorno estimada em 5,36% a.a., continuando acima da taxa máxima pré-fixada de 4,90% limitada pela SPREV para o ano de 2023. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices internacionais. Apresentando um retorno positivo de 3,47% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento negativo anual de -1,28% e de -2,71% nos últimos 12 meses. Mediante a todo esse cenário exposto acima e em linha com o último relatório disponibilizado, tentando elucidar muitos questionamentos recebidos acerca dos prêmios trazidos pelas NTN-Bs atualmente, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, respaldada por um estudo de ALM, pode auxiliar na “ancoragem de rentabilidade” ainda acima da meta atuarial dos RPPS. Tal estratégia, em especial para carregamento até o vencimento, pode contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos do RPPS, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo.”

**2) Avaliação dos investimentos:** A carteira da GuarujáPrev, em maio de 2023 apresentou rentabilidade de 2,35% (dois inteiros e trinta e cinco centésimos por cento), sobre a meta estabelecida de 0,68% (sessenta e oito centésimos por cento) - Tabela 03.

**3) Análise do fluxo de caixa:** Os valores disponíveis para aplicação dos recursos recebidos entre 26/05/2023 a 21/06/2023 separados por plano são: **A) Plano Financeiro:** R\$ 6.544.976,88 (seis milhões, quinhentos e quarenta e quatro mil



**GUARUJÁPREV**

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

novecentos e setenta e seis reais e oitenta e oito centavos) referente a contribuições, devendo se destinar o valor de R\$ 4.950.000,00 (quatro milhões, novecentos e cinquenta mil reais) para pagamento das aposentadorias e pensões do mês de junho e o pagamento da 1ª parcela do 13º Salário/2023 **B) Plano Previdenciário:** Total de R\$ 6.278.571,61 (seis milhões, duzentos e setenta e oito mil, quinhentos e setenta e um reais e sessenta e um centavos) sendo R\$ 6.230.670,16 (seis milhões, duzentos e trinta mil, seiscentos e setenta reais e dezesseis centavos), referente a Contribuições, R\$ 39.501,45 (trinta e nove mil, quinhentos e um reais e quarenta e cinco centavos) referente ao COMPREV, R\$ 8.400,00 (oito mil e quatrocentos reais) referente aos rendimentos do Fundo Caixa Rio Bravo FII, devendo se destinar o valor de R\$ 795.000,00 (setecentos e noventa e cinco mil reais) para pagamento das aposentadorias e pensões do mês de junho e o pagamento da 1ª parcela do 13º Salário/2023 **4) Proposições de investimentos/desinvestimentos:** A) Fundo Financeiro Aplicações do mês: O valor de R\$ 1.594.976,88 (um milhão, quinhentos e noventa e quatro mil, novecentos e setenta e seis reais e oitenta e oito centavos), a ser aplicado no Fundo **ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI (CNPJ 32.972.942/0001-28).** B) Fundo Previdenciário Aplicações do mês: O valor de 5.483.571,61 (cinco milhões, quatrocentos e oitenta e três mil, quinhentos e setenta e um reais e sessenta e um centavos), a ser aplicado em TITULOS PUBLICOS NTN-B 2055 (marcação na curva). **Motivação:** Objetivando cumprir a Política de Investimentos 2023, com o estudo ALM e tendo em vista a conjuntura econômica, notadamente a continuidade da SELIC no patamar de 13,75% não se vislumbra por parte do BANCO CENTRAL, seu vize de baixa, que desta forma observamos que a aplicação em NTN-B-2055 é o melhor ativo neste momento, dado a possibilidade de captar juros real acima da Meta Atuarial e diminuir a volatilidade da carteira marcando-se os títulos na curva. No plano financeiro, após efetuar as análises junto aos fundos que melhor entregaram retornos comparados com os seus riscos, Índice Sharpe e Índice de Treynor foram Bradesco e Itaú, onde este último o **ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI**, se mostrou muito mais vantajoso quando abriu-se a carteira e a analisou com as expectativas do mercado. **5) Credenciamento:** Não houve. **6- Relação de**



**GUARUJÁPREV**

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

**visitas técnicas de Instituições:** O Comitê de Investimentos recebeu no dia 21/06/2023 as seguintes instituições: **A)** GRID Investimentos representada pela senhora Priscila Navarro, que falou da visão de cenários de várias casas ao qual a Grid distribui os Fundos e apresentou os Fundos Claritas Valor Feeder FIA (CNPJ.: 11.403.850/0001-57); Icatu Vanguarda Simples Soberano FIRF (CNPJ.: 14.843.784/0001-24) e Plural Dividendos FIA (CNPJ.: 11.898.280/0001-13) **B)** Sicred, representada pelos Senhores Jorge Alves dos Santos (Gerente da agência Sicred da cidade de Guarujá), Sandro Roque (Gerente de investimentos) e Rodolpho B Amorim (Gerente de negócios pessoa jurídica) onde fizeram uma leitura de cenário e apresentaram os fundos Sicredi Liquidez Empresarial FI Renda Fixa Referenciado Di (CNPJ.: 24.634.187/0001-43); Sicredi Institucional FI Renda Fixa Referenciado IRF-M 1 (CNPJ.: 19.196.599/0001-09); Sicredi Institucional Fi Renda Fixa Referenciado IRF-M LP (CNPJ.: 13.081.159/0001-20); Sicredi Institucional FIC Renda Fixa Referenciado IMA-B LP (CNPJ.: 11.087.118/0001-15); Sicredi Bolsa Americana FI Multimercado LP (CNPJ.: 24.633.818/0001-00); Sicredi Schroders Ibovespa FI Ações (CNPJ.: 06.051.151/0001-55); Sicredi Sulamérica Valor FI Ações (CNPJ.: 24.633.875/0001-99); Sicredi Sustentáveis ESG FIC Ações (CNPJ.: 41.283.741/0001-04); Sicredi Petrobras FI Ações (CNPJ.: 08.336.054/0001-34) e Sicredi Taxa Selic FIC Renda Fixa LP (CNPJ.: 07.277.931/0001-80). **C)** Santander Asset representado pelo Senhor Gustavo Veleza Nazareth. Ele apresentou os fundos Santander Rf Ima-B 5 Premium FIC FI (CNPJ.: 13.455.117/0001-01); Santander FI Ima-B 5 Top Renda Fixa Longo Prazo (CNPJ.: 18.599.673/0001-75); Santander Ações Dividendos Fundo De Investimento em Cotas de Fundos de Investimento (CNPJ.: 13.455.174/0001-90) e Santander Renda Fixa Ima-B 5+ Premium Fundo e Investimento em Cotas de Fundos de Investimento (CNPJ.: 37.242.345/0001-61). **7) Relatório Mensal:** Será finalizado o relatório referente ao mês de maio e enviado a Diretoria Executiva. **8) Acompanhamento do Pró-Gestão:** Acompanhamento realizado e será inserido no relatório. **9) Assuntos Gerais:** **A) Data próxima reunião:** A data da próxima reunião será dia 13/07/2023 podendo haver alteração conforme se torne necessário. **B)** Nos dias 14, 15 e 16 de junho os membros do Comitê, Laydianne, Edler, Lucielma e Zaqueu



**GUARUJÁPREV**

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

foram ao evento da ABIPEM, na cidade de Foz de Iguazú, onde a GuarujáPrev recebeu a premiação de 4º lugar na gestão de investimentos, 8º lugar em responsabilidade previdenciária e de 3º lugar na gestão de governança previdenciária. Não havendo mais nada a tratar, a Srª. Presidente deu por encerrado os trabalhos as 18:00. Para constar, eu, Fabio Enrique Camilo José Esteves, Secretário da mesa Diretora lavrei a presente Ata, que vai numerada de 01 (um) a 12 (doze) laudas, que após lida e aprovada, segue assinada digitalmente por mim, como secretário, pela Sra. Presidente, pelo gestor e pelos demais membros presentes.

Guarujá, 22 de junho de 2023.

(Assinatura Digital)

Laydianne Alves da Silva Rosa Gonçalves  
**Presidente Comitê de Investimentos**

(Assinatura Digital)

Fernando A. G. de Melo  
**Responsável Técnico – Gestor do Comitê de Investimentos**

(Assinatura Digital)

Aline Borges de Carvalho  
**Membro do Comitê de Investimentos**

(Assinatura Digital)

Fábio Enrique Camilo José Esteves  
**Secretário do Comitê de Investimentos**

(Assinatura Digital)

Zaqueu Elias da Silva Ferreira  
**Vice-secretário do Comitê de Investimentos**

(Assinatura Digital)

Edler Antonio da Silva  
**Diretor Presidente - GuarujáPrev  
Membro do Comitê de Investimentos**

(Assinatura Digital)

Lucielma Ferreira Feitosa  
**Gerente de Planejamento, Orçamento,  
Contabilidade e Finanças - GuarujáPrev  
Membro do Comitê 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

## ANEXOS

**Tabela 01: Repasses**

1 - RECEITAS			
FUNDOS / BANCOS	FUNDO FINANCEIRO	FUNDO PREVIDENCIARIO	TOTAL
REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES	R\$ 6.544.976,88	R\$ 6.230.670,16	R\$ 12.775.647,04
COMPREV	R\$ -	R\$ 39.501,45	R\$ 39.501,45
JUROS CAIXA RIO BRAVO	R\$ -	R\$ 8.400,00	R\$ 8.400,00
(-) FOLHA PAGAMENTO SANTANDER	R\$ 4.950.000,00	R\$ 795.000,00	R\$ 5.745.000,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 1.594.976,88</b>	<b>R\$ 5.483.571,61</b>	<b>R\$ 7.078.548,49</b>

**Tabela 02: Aplicação**

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\$ 1.594.976,88	D+0
		PARA	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	32.972.942/0001-28	R\$ 1.594.976,88	D+0
PREVIDENCIÁRIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 5.483.571,61	D+0
		PARA	TITULOS PUBLICOS NTN-B 2055	---	R\$ 5.483.571,61	D+0
					<b>R\$ 7.078.548,49</b>	



**GUARUJÁPREV**

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

**Tabela 03: Retorno carteira GuarujáPrev**

MÊS	SALDO ANTERIOR (R\$)	APLICAÇÕES (R\$)	RESGATES (R\$)	AMORTIZAÇÃO (R\$)	JUROS (R\$)	RETORNO (R\$)	SALDO NO MÊS	RETORNO (%)	META (%)
JANEIRO	988.456.089,84	25.661.519,20	3.114.963,00	0,00	8.400,00	17.726.942,98	1.028.729.589,02	1,76%	0,98%
FEVEREIRO	1.028.729.589,02	182.851.966,29	174.335.952,16	427.847,36	4.034.425,11	-4.271.421,09	1.029.705.535,15	0,02%	1,21%
MARÇO	1.029.705.535,15	134.134.699,30	141.254.436,99	0,00	8.400,00	9.752.587,93	1.032.338.385,39	0,95%	1,18%
ABRIL	1.032.338.385,39	95.229.619,34	68.436.806,84	0,00	8.400,00	8.104.959,57	1.067.236.157,46	0,77%	0,98%
MAIO	1.067.236.157,46	63.011.492,43	46.941.265,41	0,00	8.249.869,40	17.225.387,19	1.092.281.902,27	2,35%	0,68%
<b>TOTAL RETORNO</b>				427.847,36	12.309.494,51	48.538.456,57		5,97%	5,12%





**GUARUJÁPREV**

(13) 3343-9050 ☎

@guarujaprevidencia 📱

@guarujaprevidencia 📷

guarujaprevidencia.sp.gov.br 🌐

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

**Quadro 01: Relatório Focus**

Expectativas de Mercado														16 de junho de 2023													
Mediana - Agregado	2023							2024							2025					2026							
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **			
	<small>▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade</small>																										
IPCA (variação %)	5,80	5,42	5,12	▼ (5)	153	5,07	118	4,13	4,04	4,00	▼ (3)	150	3,96	116	4,00	3,90	3,80	▼ (2)	128	4,00	3,88	3,80	▼ (2)	117			
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	1,20	1,84	2,14	▲ (6)	112	2,19	71	1,30	1,27	1,20	▼ (3)	105	1,19	69	1,70	1,80	1,80	= (1)	79	1,80	1,95	1,99	▲ (3)	74			
Câmbio (R\$/US\$)	5,15	5,10	5,00	▼ (1)	122	5,00	84	5,20	5,17	5,10	▼ (1)	118	5,10	81	5,20	5,20	5,18	▼ (1)	87	5,27	5,26	5,25	▼ (1)	79			
Selic (% a.a)	12,50	12,50	12,25	▼ (1)	143	12,25	97	10,00	10,00	9,50	▼ (1)	139	9,50	95	9,00	9,00	9,00	= (19)	111	8,75	8,75	8,75	= (1)	100			
IGP-M (variação %)	1,00	-0,20	-1,21	▼ (10)	78	-1,75	54	4,12	4,09	4,00	▼ (2)	68	4,00	47	4,00	4,00	4,00	= (17)	59	4,00	4,00	4,00	= (17)	58			
IPCA Administrados (variação %)	9,50	9,32	9,09	▼ (7)	104	9,08	74	4,50	4,52	4,50	▼ (2)	88	4,50	65	4,00	4,00	4,00	= (13)	59	4,00	4,00	4,00	= (16)	53			
Conta corrente (US\$ bilhões)	-47,06	-47,50	-45,29	▲ (2)	32	-43,22	18	-53,05	-53,00	-51,02	▲ (1)	31	-51,00	17	-50,20	-50,15	-50,30	▼ (1)	21	-52,00	-51,00	-50,00	▲ (2)	19			
Balança comercial (US\$ bilhões)	60,00	59,20	61,15	▲ (2)	32	61,71	20	54,60	55,30	57,80	▲ (1)	28	57,75	16	59,00	60,00	55,00	▼ (1)	19	54,00	55,00	55,00	= (1)	17			
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	80,00	80,00	79,00	▼ (1)	29	78,30	16	80,00	80,00	80,00	= (20)	28	80,00	15	81,60	81,80	80,50	▼ (2)	20	80,00	80,00	80,00	= (4)	17			
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	61,00	60,60	60,60	= (1)	31	60,80	14	64,70	64,40	64,20	▼ (4)	28	63,90	13	67,00	66,00	66,00	= (1)	23	67,40	67,40	67,10	▼ (3)	21			
Resultado primário (% do PIB)	-1,00	-1,05	-1,01	▲ (2)	45	-1,00	23	-0,70	-0,70	-0,80	▼ (1)	42	-0,78	22	-0,37	-0,37	-0,50	▼ (3)	32	-0,15	-0,20	-0,25	▼ (1)	29			
Resultado nominal (% do PIB)	-7,80	-7,85	-7,77	▲ (2)	29	-7,52	14	-7,00	-7,00	-7,00	= (8)	27	-6,67	13	-6,00	-6,35	-6,50	▼ (4)	19	-5,50	-5,90	-6,00	▼ (3)	17			

\* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento \*\* respondentes nos últimos 30 dias \*\*\* respondentes nos últimos 5 dias úteis

— 2023 — 2024 — 2025 — 2026



**GUARUJÁPREV**

(13) 3343-9050 

@guarujaprevidencia 

@guarujaprevidencia 

guarujaprevidencia.sp.gov.br 

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

**Tabela 06 – Percentual em Títulos Públicos na carteira dos Fundos**

% CARTEIRA EM TP - FUNDO ITAÚ GLOBAL DINÂMICO	
ATIVO	PERCENTUAL
LFT	51%
LTN	10%
NTN-B	33%
TOTAL TÍTULOS PÚBLICOS	94%

% CARTEIRA EM TP - FUNDO BRADESCO DI PREMIUM	
ATIVO	PERCENTUAL
NTN-F	52,77
LFT	5,69
LTN	2,57
TOTAL TÍTULOS PÚBLICOS	61,03

**Fonte:** Sistema ComDinheiro dia 22/09/2023



**GUARUJÁPREV**

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

**Tabela 07 – Comparações Retorno, Volatildiade, Sharpe, Treynor, patrimônio líquido.**

NOME_FUNDO	RETORNO 6 MESES 20/06/2023	RETORNO 12 MESES 20/06/2023	RETORNO 24 MESES 20/06/2023	VOLATILIDADE ANUALIZADA 6 MESES 20/06/2023	VOLATILIDADE ANUALIZADA 12 MESES 20/06/2023	VOLATILIDADE ANUALIZADA 24 MESES 20/06/2023
BRADESCO FI RF REF DI PREMIUM	6,49	13,81	24,19	0,06	0,05	0,19
WESTERN ASSET DI MAX RF REF FI	5,76	13,09	23,89	0,65	0,47	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV	7,01	12,82	25,23	0,60	0,71	0,76
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FICFI	5,93	12,37	20,50	0,02	0,02	0,20
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	5,12	12,05	21,77	0,75	0,58	0,57
FICFI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF SIMPLES	5,56	11,60	19,29	0,02	0,01	0,18
<b>IPCA+5,23%</b>	<b>5,77</b>	<b>8,86</b>				



# GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

NOME_FUNDO	SHARPE_06M	SHARPE AO PERÍODO 12 MESES 20/06/2023	SHARPE AO PERÍODO 24 MESES 20/06/2023	TREYNOR_06M	TREYNOR 12 MESES 20/06/2023	TREYNOR 24 MESES 20/06/2023	PATRIMÔNIO R\$ MILHÕES 20/06/2023	NÚMERO COTISTAS 20/06/2023	CAPTAÇÃO NO DIA R\$ MILHÕES 20/06/2023	RESGATE NO DIA R\$ MILHÕES 20/06/2023
BRDESCO FI RF REF DI PREMIUM	1,19	7,34	4,22	-395,13	-3.707,52	2.326,59	8.720,56	359,00	4,65	29,51
WESTERN ASSET DI MAX RF REF FI	-1,52	-0,81	1,50	-118,73	-179,19	428,43	795,62	12,00	0,00	1,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV	1,36	-0,92	2,04	46,45	-43,48	492,13	2.928,64	231,00	5,09	1,66
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	-2,52	-2,49	-1,58	-229,86	-242,58	-155,01	652,53	561,00	1,91	0,01
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FICFI	-36,67	-59,25	-9,20	-39.997,62	-1.186.979,26	-4.050,02	4.376,04	973,00	257,35	73,60
FICFI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF SIMPLES	-73,29	-132,65	-14,82	-8.113,36	-57.976,43	-6.743,08	1.018,71	349,00	130,73	6,62

Fonte: Sistema ComDinheiro dia 22/09/2023