

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

OUTUBRO DE 2022



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

SUMÁRIO

1. Objetivo	2
2. Cenário outubro de 2022.....	2
3. Desafios para os próximos meses.....	4
4. Análise do Relatório de Gestão de Risco	4
4.1 - Carteira de Investimentos – outubro de 2022.....	6
4.2 - Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – 2022.....	9
4.3 - Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro	10
4.4 - Carteira de Investimentos por segmento– Fundo Previdenciário	10
4.5 - Carteira de Investimentos por segmento– Consolidado	10
5. Pró-Gestão.....	11



1. Objetivo

Este relatório visa demonstrar as atividades mensais do Comitê de Investimentos relativo ao mês de outubro de 2022.

2. Cenário outubro de 2022

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

“ MERCADOS INTERNACIONAIS

No mês de setembro, a escalada do sentimento de aversão a risco resultou em alta da curva de juros dos EUA e queda dos principais índices de ações globais. Adicionalmente, os desafios para as autoridades monetárias seguem crescentes, uma vez que precisam conciliar não apenas a estabilidade de preços com os riscos de recessão, mas, também, um quadro de estabilidade financeira cada vez mais desafiador. A inflação ao consumidor nos EUA (CPI) voltou a trazer informações desfavoráveis em setembro, levando a uma intensificação do risco inflacionário. O último dado aponta para um processo inflacionário ainda mais complexo, com núcleo muito acima do esperado e uma composição desfavorável. O mercado de trabalho aquecido, com pressões salariais, reforça essa leitura. Devido a esse cenário, o Fed subiu novamente os juros básicos em 0,75% reiterando sua postura no sentido de controle da inflação. No sumário de projeções dos seus dirigentes, houve importante aumento da expectativa de juros, para 4,4% em 2022 e 4,6% em 2023. O mercado reagiu ao novo conjunto de informações, com elevação dos prêmios ao longo da curva de juros futuros, além de depreciação da Bolsa e de outros ativos financeiros. Também ocorrem revisões baixistas na Zona do Euro e na China. No caso europeu, a piora adicional da crise energética, reflexo das tensões geopolíticas, deverá acentuar a trajetória recessiva na região. Na China, a recuperação econômica vem sendo afetada pela política de contenção da Covid-19 e pela fraqueza do mercado imobiliário. O governo inglês anunciou a redução de impostos e aumento de gastos a fim de proteger a economia da forte elevação nos preços de energia.



Em um contexto de pleno emprego e inflação elevada, a deterioração do quadro fiscal inglês levou a forte aversão a risco nos mercados globais. Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos negativos. Assim, no mês de setembro de 2022, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -9,74% e -9,34%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. Observando no acumulado do ano, esses índices apresentam queda de -26,69% e -24,77%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -5,78% e -5,36%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Acumulando retornos negativos de -28,97% e -27,11% no ano.

BRASIL

No Brasil, o resultado da reunião do Copom em setembro veio dentro do esperado, com manutenção da taxa Selic em 13,75%, acompanhada de uma comunicação cautelosa sobre cenário econômico e riscos à frente, e, em conjunto com o resultado das eleições contribuíram para uma certa estabilidade do Ibovespa. Ao mesmo tempo, o recuo dos dados de inflação e o fim do ciclo de aperto monetário, agiram como catalisadores para queda na curva de juros. A inflação voltou a trazer sinais mais favoráveis nas leituras recentes. Além de o IPCA ter vindo abaixo do esperado, sua abertura mostra redução de parte das pressões em grupos importantes (Bens e Serviços), ainda que a tendência dos números siga elevada. Reforçando a expectativa de desaceleração, ainda que gradual, do IPCA nos próximos trimestres. Em relação às eleições, o resultado do primeiro turno mostrou uma vantagem menor do ex-presidente Lula do que a apontada pelas pesquisas. A diferença entre os candidatos torna possível uma reversão do resultado no segundo turno. A eleição também mostrou uma composição mais centrada do Congresso Nacional, o que diminui a chance de grandes desvios na condução de políticas públicas. 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 10.10.2022, e



apresentada no item 3 deste relatório como “Taxa de Juros Real”, a taxa de juros real com vencimento para 10 anos apresentava taxa de retorno estimada em 5,75% a.a., continuando assim acima da taxa de desconto de 5,04% limitada pela SPREV para o ano de 2022. Na renda variável, a bolsa brasileira encerrou o mês em território positivo, apesar do sentimento mais negativo no exterior, sendo beneficiada pelos bons dados da economia e uma inflação desacelerada. Apresentando um retorno positivo de +0,47% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento anual positivo de +4,97% e uma queda de -0,85% 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.”

3. Desafios para os próximos meses

A Selic continuou com a taxa de 13,75% e durante o mês de outubro o ciclo de deflação encerrou-se, tendo o IPCA sido de 0,59%. Espera-se que a Bolsa brasileira continue volátil até a real saída do nomes dos ministros, principalmente o ministro da Economia. Enquanto isso, os Títulos Públicos vêm oferecendo retorno acima dos 6% de juro real, onde enxergamos ai uma boa oportunidade.

4. Análise do Relatório de Gestão de Risco

O Núcleo de Investimentos entregou o Relatório de Gestão de Risco do mês de outubro de 2022.

Pontos de atenção:



O Fundo GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE atingiu uma VaR de 25,79 quando a estipulada na Política de Investimentos foi de 20.

O Fundo MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR atingiu uma VaR de 20,55 quando a estipulada na Política de Investimentos foi de 20.

Os Fundos citados nos parágrafos anteriores são Fundos do exterior e sua volatilidade estão atreladas ao dólar, além de serem afetados pela recessão mundial. O Comitê vem acompanhando de perto esses Fundos.

A Var do artigo de Investimentos no exterior, Art. 9º, II, está dentro da VaR estipulada na Política de Investimentos.

Das Aplicações orientadas pelo Comitê de Investimentos:

Os valores abaixo descrevem a quantidade orientada pelo Comitê de Investimentos na reunião do dia 19/10/2022 a ser aplicadas e a quantidade efetivamente aplicada:

3 - APLICAÇÕES					
SEGREGAÇÃO	TIPO DE RESGATE	FUNDO		CNPJ	VALOR
FINANCEIRO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 3,804,001.31
		PARA	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REF FI	05.090.727/0001-20	R\$ 3,804,001.31
PREVIDENCIARIO	PARCIAL	DE	BB PREV RF FLUXO FIC	13.077.415/0001-05	R\$ 4,621,605.35
		PARA	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REF FI	05.090.727/0001-20	R\$ 4,621,605.35
FINANCEIRO	TOTAL	DE	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	19.436.818/0001-80	R\$ 2,389,952.03
		PARA	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REF FI	05.090.727/0001-20	R\$ 2,389,952.03
PREVIDENCIARIO	TOTAL	DE	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	19.436.818/0001-80	R\$ 19,601,263.39
		PARA	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REF FI	05.090.727/0001-20	R\$ 19,601,263.39
TOTAL					R\$ 30,416,822.08

WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REF FI				
SEGREGAÇÃO	VALOR ORIENTADO	VALOR APLICADO	DIFERENÇA	MOTIVO
PREVIDENCIÁRIO	R\$ 24.222.868,74	R\$ 24.346.738,59	R\$ 123.869,85	Valor a maior devido a valorização do ativo.
FINANCEIRO	R\$ 6.193.953,34	R\$ 6.209.059,03	R\$ 15.105,69	Valor a maior devido a valorização do ativo.



4.1 - Carteira de Investimentos – Outubro de 2022.

POSIÇÃO DE ATIVOS E ENQUADRAMENTO									
RENDA FIXA									
72,82%									
Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)									
Emissor		Título Público	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150535 (6,180000%)	4,17	0,57	0,65	32.462.857,36	3,3		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150545 (6,260000%)	4,24	0,58	0,67	58.721.220,49	5,96		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150555 (6,135000%)	4,18	0,57	0,99	55.818.017,14	5,67		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150555 (6,270000%)	13,79	0,26	7,64	40.956.335,60	4,16		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150555 (6,325000%)	4,29	0,59	0,71	4.375.269,54	0,44		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150830 (6,240000%)	3,02	0,58	0,68	14.417.191,18	1,46		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150840 (6,200000%)	10,68	0,95	6,54	44.976.178,79	4,57		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150850 (6,140000%)	9,45	0,33	5,83	40.145.026,08	4,08		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150850 (6,270000%)	12,89	0,33	7,34	34.206.950,69	3,47		
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a			6,42	0,53	11,54	326.079.046,87	33,1		
Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,92	1,89	8,19	8.171.922,79	0,83	3.200.270.776,09	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,28	1,07	6,72	1.805.514,37	0,18	734.034.559,46	0,25
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	6,31	1,06	6,77	4.398.274,42	0,45	223.691.964,46	1,97
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	2,48	1,88	8,98	5.633.925,38	0,57	372.189.374,97	1,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,7	1,83	8,48	33.098.643,02	3,36	8.108.886.938,29	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,24	0,94	2,73	103.159.191,57	10,47	989.148.437,52	10,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,11	0,89	9,1	355.618,48	0,04	818.815.798,11	0,04
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,01	2,24	9,55	4.012.343,56	0,41	3.736.730.846,68	0,11
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,06	1,96	9,44	2.723.530,74	0,28	203.675.715,62	1,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,79	1,24	8,05	163.358.964,33	16,58		
Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)									



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,18	1,08	1,19	47.800.175,89	4,85	663.478.040,92	7,2
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,59	1,25	6,77	25.942.231,65	2,63	447.224.453,96	5,8
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,12	0,95	9,1	515.132,15	0,05	3.859.205.707,52	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,46	1,84	8,68	3.810.119,26	0,39	1.078.455.317,88	0,35
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO	0,32	1,06	10,41	29.931.423,15	3,04	828.368.773,66	3,61
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,73	1	10,02	75.501.921,65	7,66	2.196.787.659,94	3,44
XP	INTRAG	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	3,6	1,34	8,02	39.218.754,31	3,98	596.682.358,50	6,57
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,42	1,1	8,7	222.719.758,06	22,61		
Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,79	1,83	8,67	5.126.631,47	0,52	538.020.375,78	0,95
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CRED PRIV	3,36	0,1	8,35	0,00	0	823.161.779,75	0
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			3,09	1,83	9,83	5.126.631,47	0,52		
Renda Fixa			3,37	0,81	8,52	717.284.400,73	72,82		
RENDA VARIÁVEL									
17,59%									
Artigo 8º I (Fundos de Ações)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,65	5,21	10,37	21.412.060,54	2,17	957.805.640,45	2,24
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	18,94	9,46	14,1	7.582.179,25	0,77	52.647.842,90	14,4
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	17,84	5,41	13,8	11.688.278,73	1,19	1.326.372.993,27	0,88
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,71	8,89	3,12	22.546.280,65	2,29	1.146.083.351,86	1,97
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	22,36	7,42	11,28	2.218.632,90	0,23	84.480.149,84	2,63
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO	24,46	7,78	6,99	41.306.979,75	4,19	1.534.573.593,33	2,69



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

INSTITUCIONAL FIC FIA									
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,21	8,13	9,74	6.199.302,50	0,63	249.446.060,54	2,49
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	21,25	6,79	13,84	8.245.043,97	0,84	159.763.853,34	5,16
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,53	6,75	13,34	10.828.398,29	1,1	1.054.252.592,18	1,03
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,29	10,6	12,92	26.766.446,28	2,72	2.150.027.623,87	1,24
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	21,68	6,95	7,34	1.140.037,70	0,12	473.598.534,93	0,24
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	20,37	5,42	10,57	3.206.470,51	0,33	363.996.306,82	0,88
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	17,82	8,19	3,24	10.168.298,11	1,03	491.946.044,22	2,07
Sub-total Artigo 8º I			19,34	7,8	9,17	173.308.409,18	17,59		
Renda Variável			18,97	7,8	9,17	173.308.409,18	17,59		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 3,83%									
Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,43	1,83	-34,28	3.983.614,94	0,4	146.868.190,44	2,71
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	56,76	-2,38	-57,64	3.772.211,44	0,38	187.298.018,89	2,01
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	38,26	-1,68	-47,14	7.627.919,06	0,77	529.565.364,86	1,44
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	22,64	5,38	-15,94	12.556.146,77	1,27	424.939.275,41	2,95
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDAD E AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	24,01	1,76	-28,26	9.756.176,72	0,99	256.882.795,89	3,8
Sub-total Artigo 9º II			23,99	1,78	-34,93	37.696.068,93	3,83		
Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	24,28	0,69	-32,56	0,00	0	1.004.133.508,36	0
Sub-total Artigo 9º III			24,28	0,69	-32,56	0,00	0		
Investimentos no Exterior			21,67	2,6	-33,28	37.696.068,93	3,83		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 5,66%									
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)									



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	38,31	-0,39	4,13	23.427.573,89	2,38	163.443.498,63	14,33
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	22,81	8,61	-12,66	20.470.592,04	2,08	679.137.929,09	3,01
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	22,87	8,84	-8,93	5.265.184,30	0,53	403.547.884,46	1,3
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	13,22	4,75	15,95	1.901.990,63	0,19	125.898.611,47	1,51
Sub-total Artigo 10º I			22,56	4,17	-8,49	51.065.340,86	5,18		
Artigo 10º II (Fundo de Participação)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
LEGATUS	BTG PACTUAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	125,66	0,01	4,3	1.586.364,93	0,16	155.004.456,26	1,02
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	8,7	-2,65	8,04	3.056.284,46	0,31	95.599.342,16	3,2
Sub-total Artigo 10º II			5,43	-1,76	6,76	4.642.649,39	0,47		
Investimentos Estruturados			20,48	3,65	-7,08	55.707.990,25	5,66		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,11%									
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	CEF	CXRI11	12,11	-0,12	10,22	1.039.500,00	0,11	139.445.989,22	0,75
Sub-total Artigo 11º			12,11	-0,12	10,22	1.039.500,00	0,11		
Fundos Imobiliários			12,38	-0,12	10,22	1.039.500,00	0,11		
Total			5,89	2,21	3,26	985.036.369,9	100		

4.2 - Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – 2022

MÊS	SALDO ANTERIOR (R\$)	APLICAÇÕES (R\$)	RESGATES (R\$)	AMORTIZAÇÃO (R\$)	JUROS (R\$)	RETORNO (R\$)	SALDO NO MÊS	RETORNO (%)	META (%)
JANEIRO	875.501.350,93	19.991.781,89	8.963.212,66	0	8.250,00	-9.768.897,70	876.761.022,46	-1,13	0,94
FEVEREIRO	876.761.022,46	15.160.850,26	7.910.943,63	0	352.305,95	-4.024.703,50	879.633.919,64	-0,44	1,38
MARÇO	879.633.919,64	70.624.998,53	63.240.165,19	0	7.650,00	22.017.854,31	909.036.607,29	2,46	2,05
ABRIL	909.036.607,29	46.311.381,65	39.246.919,68	0	7.650,00	15.821.058,35	900.280.010,91	-1,72	1,47
MAIO	900.280.010,91	178.215.600,77	170.647.992,70	0	7.950,00	4.218.450,33	912.066.069,31	0,48	0,89
JUNHO	912.066.069,31	105.020.783,47	98.986.965,53	0	8.250,00	16.993.180,10	901.106.707,15	-1,85	1,07
JULHO	901.106.707,15	540.449.428,05	532.758.947,53	0	9.600,00	15.200.490,42	923.997.678,09	1,7	-0,28
AGOSTO	923.997.678,09	267.420.574,96	253.389.028,73	506.676,53	6.275.974,24	10.851.691,56	946.413.070,78	1,37	0,08
SETEMBRO	946.413.070,78	35.833.536,28	28.034.740,22	0	8.250,00	1.096.686,73	955.308.553,56	0,12	0,11



OUTUBRO	955.308.553,56	57.103.198,52	48.707.225,44	361.247,95	8.250,00	21.723.572,58	985.066.851,2 7	2,21	0,97
TOTAL RETORNO						6.777.333,70		3,26%	8,96%%

A tabela acima demonstra o retorno da carteira da GuarujáPrev ao longo de 2022 e a meta atuarial.

A carteira da GuarujáPrev fechou o mês com uma rentabilidade momentânea positiva, superando a meta atuarial do mês. Este retorno deu-se principalmente a alocação da carteira em Títulos Públicos e ativos da renda fixa.

4.3 - Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro



4.4 - Carteira de Investimentos por segmento– Fundo Previdenciário



4.5 - Carteira de Investimentos por segmento– Consolidado



Consolidado



5. Pró-Gestão

O quadro abaixo, relata as atividades do Comitê de Investimentos relacionadas com o Pró-Gestão de outubro de 2022.

AÇÃO	OUTUBRO DE 2022
Acompanhar o desempenho obtido pelos investimentos, em consonância com a política de investimentos, bem como com os limites de investimentos e diversificações estabelecidos na Resolução nº 4.963/2021 e suas alterações	realizado, atividade de rotina
Alocar taticamente os investimentos, em consonância com a política de investimentos, o cenário macroeconômico, e as características e peculiaridades do passivo	realizado, atividade de rotina
Selecionar opções de investimentos, verificando as oportunidades de ingressos e resgates dos investimentos	realizado, atividade de rotina
Manter uma gestão de ativos em consonância com a legislação em vigor, restrições e diretrizes contidas na política de investimentos, e que atenda aos mais elevados padrões técnicos, éticos e de prudência	realizado, atividade de rotina
Determinar uma política de taxas e corretagens, considerando os custos e serviços envolvidos	realizado, atividade de rotina
Selecionar gestores, corretoras de valores e outros prestadores de serviços diretamente ligados à atividade de administração de recursos	realizado, atividade de rotina
Disponibilizar à Diretoria Executiva as informações contidas na política anual de investimentos e suas revisões, no prazo de trinta dias, contados da data de sua aprovação	realizado, atividade de rotina
Disponibilizar à Diretoria Executiva as informações contidas nos formulários APR	realizado, atividade de rotina
Autorização de Aplicação e Resgate, no prazo de até trinta dias, contados da respectiva aplicação ou resgate	realizado, atividade de rotina
Disponibilizar à Diretoria Executiva a composição da carteira de investimentos do RPPS, no prazo de até trinta dias após o encerramento do mês	realizado, atividade de rotina
Disponibilizar à Diretoria Executiva as informações relativas ao processo de credenciamento de instituições para receber as aplicações dos recursos do RPPS	realizado, atividade de rotina
Disponibilizar à Diretoria Executiva a relação das entidades credenciadas para atuar com o RPPS e respectiva data de atualização do credenciamento	realizado, atividade de rotina
Realizar relatório mensal de investimentos com auxílio do Núcleo de Investimentos	Realizado.

Guarujá, 29 de novembro de 2022.



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

(Assinado Digitalmente)
Lucielma Ferreira Feitosa
**Gestor do Comitê de Investimentos
Responsável Técnico**

(Assinado Digitalmente)
Laydianne Alves da Silva Gonçalves
Presidente Comitê de Investimentos

(Assinado Digitalmente)
Fernando A. G. de Melo
Secretário do Comitê

(Assinado Digitalmente)
Aline Borges de Carvalho
Vice-Secretária

(Assinado Digitalmente)
Fábio Enrique Camilo José Esteves
Membro do Comitê

(Assinado Digitalmente)
Edler Antonio da Silva
**Diretor Presidente
Membro do Comitê de Investimentos**

(Assinado Digitalmente)
Liliane da Silva e Silva
**Gerente de Planejamento, Orçamento, Contabilidade e Finanças
Membro do Comitê de Investimentos**