

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

FEVEREIRO 2023



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 FEVEREIRO DE 2023.....	2
3. DESAFIOS PARA OS PRÓXIMOS MESES.....	4
4. ANÁLISE DO RELATÓRIO DE GESTÃO DE RISCO.....	5
5. DAS APLICAÇÕES ORIENTADAS PELO COMITÊ DE INVESTIMENTOS:	6
6. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – FEVEREIRO DE 2023.	7
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – 2023.....	10
8. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO FINANCEIRO	11
9. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO– FUNDO PREVIDENCIÁRIO	11
10. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO– CONSOLIDADO.....	12
11. PRÓ-GESTÃO	13



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

1. Objetivo

Este relatório visa demonstrar as atividades mensais do Comitê de Investimentos relativo ao mês de fevereiro de 2023.

2. Cenário fevereiro de 2023

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

“MERCADOS INTERNACIONAIS”

No mês de janeiro, os mercados globais caminharam na direção positiva, com desaceleração dos indicadores de inflação, divulgações mais construtivas de crescimento econômico e reabertura da economia chinesa. Também, em destaque, a queda acentuada do preço do gás natural sugere que a crise energética na Europa pode estar perdendo força. Nos EUA, a inflação (CPI) vem passando por decompressão, sem surpresas negativas em relação às projeções. Fica reforçada, assim, a premissa de desaceleração consistente da inflação, trazendo uma redução no risco da inflação levar o Fed a realizar movimentos de alta mais agressivos nos juros. Na Zona do Euro, é apresentada uma situação menos desfavorável. A tensão geopolítica e as dificuldades no mercado energético não tiveram um efeito negativo tão intenso quanto o esperado. Adicionalmente, nota-se uma decompressão importante no mercado energético, que reduz o risco de um impacto muito negativo. Esse contexto suporta um aumento das projeções de crescimento do PIB na região. Na China, vai se consolidando o processo de reabertura mais célere da economia, diante da ampla flexibilização da política de contenção do Covid-19. Isso levou a uma relevante mudança nas perspectivas para a atividade, trazendo um cenário de PIB mais forte. Ainda que o curto prazo deva ficar marcado por dados mais modestos, em virtude do rápido aumento de casos de Covid-19, o fator dominante nos próximos meses deverá ser o efeito expansionista advindo da reabertura da economia. Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos. Assim, no mês de janeiro de 2023, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente,



subiram +7,10% e +6,18%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam queda de -9,62% e -9,72%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, subiram +4,67% e +3,77%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Acumulando retornos negativos de -13,97% e -14,07% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, a curva de juros teve alta, refletindo as incertezas no cenário fiscal e levando a uma alta da expectativa de inflação. Adicionalmente, o movimento de deterioração das expectativas inflacionárias foi amplificado pelo início de discussões sobre alteração das metas de inflação, iniciada pelo presidente da república em uma entrevista. Teoricamente, a alteração da meta de inflação sugerida abriria espaço para uma política monetária menos restritiva. Desta forma, o cenário para a convergência se tornou ainda mais desafiador para o Banco Central. Para a inflação, apesar de estarmos num momento ainda muito desafiador em termos de convergência do IPCA para a meta, a trajetória de desaceleração prossegue, apresentando uma composição qualitativa mais favorável, tanto de bens quanto de serviços. O Copom, em sua primeira reunião do ano, manteve a Selic em 13,75%, adotando um discurso ainda mais conservador do que o observado na sua reunião de dezembro passado, enfatizando a questão das expectativas. Uma vez que, conforme Boletim Focus, as expectativas de inflação não estão ancoradas em relação às metas. 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 03.02.2023, 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 6,45% 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 e ainda sendo beneficiado pelo movimento de reabertura da China, o que vem ajudando os mercados emergentes. Apresentando um retorno positivo de +3,37% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo de +1,15% 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 fevereiro com o IPCA acima do esperado, alta de 0,84%, o Comitê deparou-se com uma Meta alta, diante da queda do mercado acionário brasileiro e internacional.

O Comitê continuará realocando os seus ativos, quando possível a fim de se alcançar a Meta Atuarial em 2023.

Foram feitas visitas e recebidas instituições com possíveis investimentos.

O Comitê abriu para o recebimento de FIP, a fim de investir na economia Real de logo prazo, característica do RPPS. Todas as diligências serão tomadas e caso, apareça, algum FIP que seja agregador à carteira da GuarujáPrev, o Comitê avaliará.



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050 

@guarujaprevidencia 

@guarujaprevidencia 

guarujaprevidencia.sp.gov.br 

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

4. Análise do Relatório de Gestão de Risco

O Núcleo de Investimentos entregou o Relatório de Gestão de Risco do mês de fevereiro de 2023

Pontos de atenção:

Dos fundos cadastrados como Investimentos no Exterior que o Comitê vem acompanhando nos últimos meses, apenas o Fundo GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE atingiu uma VaR de 23,93% quando a estipulada na Política de Investimentos foi de 20%.

Os membros do Comitê continuam atentos a este Fundo, porém concordaram que o momento não era o ideal para retiradas de posições, dado que no Fundo há empresas qualificadas e consolidadas, entendendo que o momento negativo do Fundo é devido, em sua maioria, a instabilidade econômica, além disso o Fundo encontra-se com resultado negativo contabilmente. O Comitê continuará acompanhando o Fundo e seu desenvolvimento nos próximos meses.

A VaR do artigo de Investimentos no exterior, Art. 9º, II, está em 10,15% o que está dentro da VaR estipulada na Política de Investimentos, 20%



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

5. Das Aplicações orientadas pelo Comitê de Investimentos:

O relatório de Gestão de Risco, realizado pelo Núcleo de **Investimentos**, informou sobre as aplicações realizadas pela Diretoria Executiva que foram deliberadas pelo Comitê de Investimentos na reunião dia 15/02/2023 – 2ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos de 2023:

Verifica-se que as aplicações foram realizadas pela Diretoria Executiva no mês de março e que houve veto por parte da Diretoria, segundo o memorando 225/2023: Na ocasião do resgate foi constatado que a Bolsa de Valores estava numa sequência de quedas e analisando a VaR deste fundo, decidimos por não efetuar o resgate com riscos do Fundo reverter o saldo positivo e realizarmos uma perda nesta operação. O referido memorando foi enviado ao Conselho de Administração para deliberação do veto. O Comitê continuará aguardando.

Ainda segundo o relatório de risco as aplicações foram realizadas em março e para comprová-las deve-se aguardar o extrato mensal referente a este mês.

O Comitê constatou que foram feitas aplicações a menor em Títulos Públicos devido ao valor da cota na data do resgate ter desvalorizado e ao Veto da Diretoria



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

6. Carteira de Investimentos – Fevereiro de 2023.

POSIÇÃO DE ATIVOS E ENQUADRAMENTO									
RENDA FIXA									
75,31%									
Emissor		Título Público	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150535 (6,180000%)	2,99	0,98	2,21	32.862.073,03	3,19		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150545 (6,015000%)	4,14	0,97	2,18	24.299.693,00	2,36		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150545 (6,260000%)	3,04	0,99	2,22	59.431.527,82	5,77		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150545 (6,400000%)	4,32	1	2,24	2.966.691,57	0,29		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150555 (6,135000%)	4,43	0,98	2,2	56.492.421,97	5,49		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150555 (6,270000%)	15,07	0,99	2,22	38.763.346,84	3,76		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150555 (6,325000%)	3,07	0,99	2,23	4.427.313,67	0,43		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150824 (6,600000%)	3,07	1,01	2,27	3.972.790,17	0,39		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150824 (6,920000%)	3,08	1,03	2,32	1.349.362,17	0,13		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150830 (6,240000%)	0,63	0,98	2,22	14.597.733,89	1,42		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150840 (6,200000%)	11,75	0,98	2,21	43.011.926,94	4,18		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150850 (6,140000%)	10,18	0,98	2,2	38.772.363,27	3,77		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150850 (6,270000%)	14,11	0,99	2,22	32.468.142,31	3,15		
TESOURO NACIONAL		NTN-B 150850 (6,427000%)	4,42	0,47	0,47	31.248.513,18	3,03		
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a			6,15	0,98	2,21	384.663.899,83	37,36		
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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,37	0,37	5.766.804,59	0,56	18.186.776.756,57	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,85	1,34	2,75	8.218.694,05	0,8	3.416.468.689,80	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,63	1,29	1,58	1.761.717,84	0,17	778.501.825,72	0,23
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	6,67	1,3	1,58	4.299.598,23	0,42	218.673.388,73	1,97
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	2,74	0,32	1,7	0,00	0	410.793.764,48	0
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	1,5	2,93	34.246.871,75	3,33	6.865.433.667,15	0,5
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,71	0,83	1,72	105.786.364,90	10,27	991.192.385,85	10,67



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,79	1,76	833.840,04	0,08	1.066.490.987,09	0,08
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,84	0,91	2,43	4.060.011,96	0,39	3.864.016.961,46	0,11
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,35	1,34	2,74	2.770.408,39	0,27	204.888.262,29	1,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,14	1,03	2,07	167.744.311,75	16,29	----	----
Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteir a	PL do Fundo	% Fund o
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,45	0,81	1,24	110.069.346,46	10,69	763.806.481,46	14,41
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,08	-0,05	-0,12	0,00	0	283.116.559,96	0
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,85	1,89	8.873.424,39	0,86	3.964.919.513,24	0,22
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,67	-0,09	1,27	0,00	0	917.477.455,94	0
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO	0,6	0,57	0,88	30.831.142,58	2,99	707.130.435,05	4,36
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,76	0,87	1,91	78.199.268,68	7,59	2.496.061.867,24	3,13
XP	INTRAG	XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FI RENDA FIXA LP	4,44	-0,43	-1,44	0,00	0	473.121.537,32	0
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,09	0,66	1,04	227.973.182,11	22,14	----	----
Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteir a	PL do Fundo	% Fund o
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,78	1,41	2,76	5.303.011,31	0,52	400.778.113,56	1,32
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			2,78	1,41	2,76	5.303.011,31	0,52	----	----
Renda Fixa			3,35	0,89	1,81	785.684.405,00	76,3	----	----
RENDA VARIÁVEL 14,89%									
Artigo 8º I (Fundos de Ações)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteir a	PL do Fundo	% Fund o
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	19,71	-6,9	-3,79	19.660.212,26	1,91	787.939.109,22	2,5
CONSTANCI A	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	19,43	-6,16	-2,57	10.214.612,98	0,99	1.126.523.175,67	0,91
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,82	-5,37	-2,86	19.391.845,07	1,88	876.824.136,01	2,21



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	22,58	-8,13	-4,15	1.896.369,03	0,18	60.052.345,90	3,16
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,48	-6,29	-1,93	36.094.904,49	3,51	1.337.859.374,92	2,7
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,47	-7,85	-5,04	5.498.239,81	0,53	213.405.356,36	2,58
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVSPA ATIVO FIA	21,64	-7,86	-4,34	7.374.547,03	0,72	143.506.776,12	5,14
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,75	-6,44	-3,86	9.600.539,46	0,93	901.055.650,43	1,07
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,67	-6,8	-4,55	23.794.103,08	2,31	1.687.120.867,12	1,41
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,56	-9,1	-5,25	912.153,31	0,09	358.025.193,09	0,25
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	19,08	-5,11	-2,59	8.827.168,13	0,86	425.763.174,59	2,07
Sub-total Artigo 8º I			19,81	-6,45	-3,27	143.264.694,65	13,91	----	----
Renda Variável			19,81	-6,45	-3,27	143.264.694,65	13,91	----	----
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR									
3,99%									
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	32,4	1,01	6,2	4.284.533,06	0,42	159.529.125,59	2,69
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	56,04	0,71	12,18	3.726.311,42	0,36	186.017.956,94	2
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	39,18	1,39	12,55	8.889.478,23	0,86	590.852.345,79	1,5
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULTIE FI	23,05	-1,41	4,42	13.408.097,87	1,3	365.742.430,63	3,67
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDAD E AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	25,68	0,35	2,1	10.795.030,66	1,05	286.454.880,94	3,77
Sub-total Artigo 9º II			24,9	0,09	6,3	41.103.451,24	3,99	----	----
Investimentos no Exterior			23,16	0,09	6,3	41.103.451,24	3,99	----	----
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS									
5,72%									
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)									
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	29,2	0,28	0,5	23.238.332,84	2,26	162.123.251,73	14,33



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

MULTIMERCADO									
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	23,52	-1,75	4,54	21.580.945,77	2,1	597.097.746,42	3,61
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	23,54	-1,74	4,53	5.560.528,40	0,54	485.533.147,91	1,15
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	12,03	0,17	2,91	1.975.018,91	0,19	139.075.139,02	1,42
Sub-total Artigo 10º I			19,97	-0,78	2,65	52.354.825,92	5,08	-----	-----
Artigo 10º II (Fundo de Participação)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteir a	PL do Fundo	% Fund o
LEGATUS	BTG PACTUAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	68,5	3,46	104,73	3.238.648,12	0,31	155.004.456,26	2,09
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	19,33	6,58	7,31	3.134.910,24	0,3	88.958.661,62	3,52
Sub-total Artigo 10º II			32,71	4,97	41,53	6.373.558,36	0,62	-----	-----
Investimentos Estruturados			18,33	-0,19	5,8	58.728.384,28	5,7	-----	-----
FUNDOS IMOBILIÁRIOS									
0,09%									
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid . a.a. (%)	Rentab . Mês (%)	Rentab . Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteir a	PL do Fundo	% Fund o
RIO BRAVO	CEF	CXRI11	13,67	-1,89	-0,39	924.600,00	0,09	125.978.660,14	0,73
Sub-total Artigo 11º			13,67	-1,89	-0,39	924.600,00	0,09	-----	
Fundos Imobiliários			13,67	-1,89	-0,39	924.600,00	0,09		
Total			5,3	-0,29	1,46	1.029.705.535,17	100		

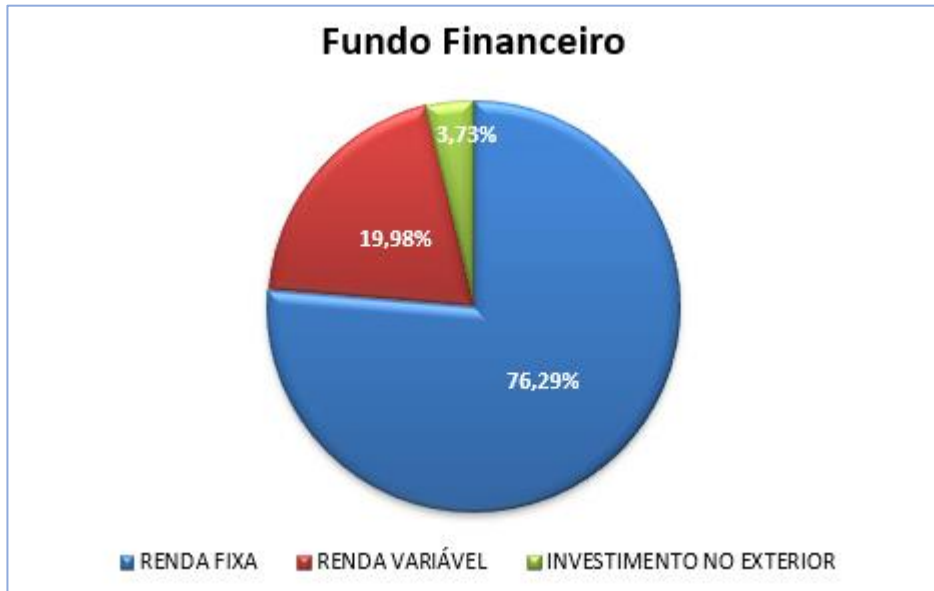
7. Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – 2023

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	1,75%	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%
TOTAL RETORNO				427.847,36	4.042.825,11	13.455.521,88	-----	1,96%	2,20%

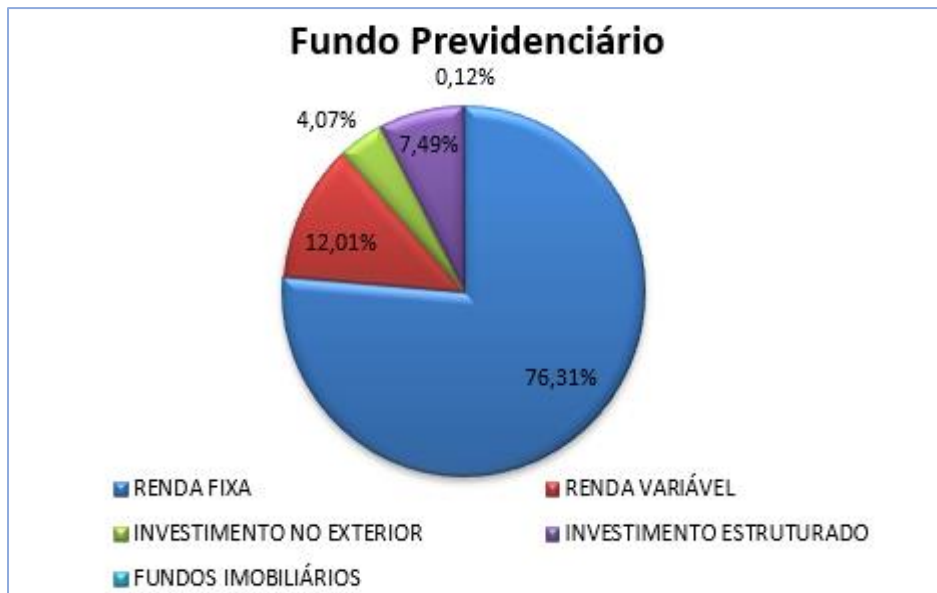
Vê-se que no mês de fevereiro de 2023 a GuarujáPrev teve o retorno de 0,02% e a Meta Atuarial o percentual de 1,21%, não alcançando assim a meta do mês. Ao longo do ano, a rentabilidade da carteira é de 1,96% perante uma Meta Atuarial de 2,20. Este resultado deu-se, principalmente, ao resultado negativo nos ativos de Renda Variável, incluindo nestes, ativos no Exterior.



8. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro



9. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Previdenciário





GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

10. Carteira de Investimentos por segmento– Consolidado





11. Pró-Gestão

O quadro abaixo, relata as atividades do Comitê de Investimentos relacionadas com o Pró-Gestão de fevereiro 2023

ATIVIDADE	FEVEREIRO
Elaborar relatório de aderência de carteira de investimentos	realizado
Criar manual de alocação dos investimentos	em andamento
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
Alocar taticamente os investimentos, em consonância com a política de investimentos, o cenário macroeconômico, e as características e peculiaridades do passivo	Realizado
Selecionar opções de investimentos, verificando as oportunidades de ingressos e resgates dos investimentos	Realizado
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
Determinar uma política de taxas e corretagens, considerando os custos e serviços envolvidos	Realizado
Selecionar gestores, corretoras de valores e outros prestadores de serviços diretamente ligados à atividade de administração de recursos	Realizado
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
Disponibilizar à Diretoria Executiva as informações contidas nos formulários APR	Realizado
Autorização de Aplicação e Resgate, no prazo de até trinta dias, contados da respectiva aplicação ou resgate	Realizado
Disponibilizar à Diretoria Executiva a composição da carteira de investimentos do RPPS, no prazo de até trinta dias após o encerramento do mês	Realizado
Disponibilizar à Diretoria Executiva as informações relativas ao processo de credenciamento de instituições para receber as aplicações dos recursos do RPPS	Realizado
Disponibilizar à Diretoria Executiva a relação das entidades credenciadas para atuar com o RPPS e respectiva data de atualização do credenciamento	Realizado
Realizar relatório mensal de investimentos com auxílio do Núcleo de Investimentos	Realizado
Elaborar o Relatório Anual de Atividades	Em andamento

Guarujá, 30 de março de 2023.

(Assinado Digitalmente)
Fernando A. G. de Melo
Gestor do Comitê de Investimentos
Responsável Técnico

(Assinado Digitalmente)
Laydianne Alves da Silva Gonçalves
Presidente 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

(Assinado Digitalmente)
Fábio Enrique Camilo José Esteves
Secretário do Comitê de Investimentos

(Assinado Digitalmente)
Zaqueu Elias da Silva Ferreira
Vice-Secretário do Comitê de Investimentos

(Assinado Digitalmente)
Aline Borges de Carvalho
Membro do Comitê de Investimentos

(Assinado Digitalmente)
Lucielma Ferreira Feitosa
**Gerente de Planejamento,
Orçamento, Contabilidade e Finanças
Membro do Comitê de Investimentos**

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