

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

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



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 abril de 2023.

2. Cenário maio de 2023

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

MERCADOS INTERNACIONAIS

O mês de abril foi relativamente calmo no cenário global, depois do mês de março dominado pelos receios de uma crise bancária sistêmica. 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. O estresse financeiro nos EUA persistiu, com o First Republic Bank se tornando insolvente. Apesar de uma resolução relativamente rápida deste caso, permanecem as preocupações sobre a intensidade de aperto das condições de crédito à frente. Nos EUA e na Zona do Euro, a inflação continua pressionada e a esperada queda deverá ocorrer de forma gradual, com convergência para as metas ocorrendo provavelmente só a partir do final de 2024. Em paralelo, o mercado de trabalho apertado e desacelerando apenas modestamente segue como um risco para a inflação. Isso sugere que o desafio dos bancos centrais permanece, o que deve exigir juros restritivos por um período relativamente longo. A economia Chinesa ainda continua demonstrando sinais de recuperação robusta e deve encerrar o ano com crescimento forte do PIB, oferecendo suporte para a economia internacional como um todo. Adicionalmente, os dados econômicos mostram certa acomodação do setor de manufaturas, o que sugere menor pressão nos preços das commodities. Diante disso, as previsões de crescimento global vêm mostrando certa recuperação nos últimos meses. Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos. Assim, no mês de abril de 2023, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, renderam +1,27% e +1,46%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos positivos de



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

+0,20% e +0,91%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -0,32% e -0,13%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Entretanto, acumulam retornos positivos de +1,87% e +2,58% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, a melhora na percepção sobre os riscos fiscais domésticos contribuiu para uma redução das taxas de juros em vértices mais longos da curva, com a valorização do Real amplificando esse sentimento. Apesar disso, o Banco Central enfrenta um ambiente inflacionário bastante desafiador. A inflação continua seguindo um estágio de desaceleração mais lento, com medidas de núcleo pressionadas. É preciso que os núcleos apresentem uma tendência mais firme de queda para que o Banco Central tenha conforto em iniciar um ciclo de afrouxamento monetário. 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 de inflação, que atualmente estão pressionadas e acima das metas, o que tem levado o Copom a manter um tom cauteloso, sinalizando a manutenção da taxa Selic no atual patamar por um prazo relativamente longo. A proposta oficial para o arcabouço fiscal seguiu, em linhas gerais, as indicações anteriores dadas pelo governo. Após a apresentação do projeto, temos o trâmite no Congresso, com chance relevante de eventuais mudanças. Adicionalmente, espera-se que sejam aprovadas medidas buscando aumento nas receitas, fator essencial para o sucesso do novo arcabouço. 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 05.05.2023, 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 5,77% 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 sendo favorecido pela queda dos juros locais. Apresentando um retorno positivo de 2,50% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento negativo anual de -4,83% e de -3,19% nos últimos 12 meses. Mediante a todo esse cenário exposto acima e em linha com o último relatório disponibilizado, tentando elucidar muitos questionamentos



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050 

@guarujaprevidencia 

@guarujaprevidencia 

guarujaprevidencia.sp.gov.br 

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

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 maio o IPCA veio em 0,23%.

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.



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 maio 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 21,45% quando a estipulada na Política de Investimentos foi de 20%. Apesar da VaR ultrapassar a estipulada este mês, ela vem diminuindo ao longo dos meses e o Fundo performando de acordo com o seu risco e ativos.



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 29/05/2023 – 5ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos de 2023:

Verifica-se que a aplicação do Fundo Financeira foi realizada pela Diretoria Executiva no dia 31/05/2023. Já do Fundo Previdenciário foi realizada no mês de junho 2023.

6. Carteira de Investimentos – Maio de 2023.

RENDA FIXA 85,75%										
Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)										
Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo	
			Dia	Mês	Ano					
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	2,53	0,01	0,01	4,67	1.388.404,32	0,13			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,47	0,04	1,09	5,9	33.058.659,94	3,03			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	2,94	0,04	1,08	5,83	24.445.152,63	2,24			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,47	0,04	1,1	5,93	59.771.671,82	5,47			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,04	1,11	5,99	2.983.205,58	0,27			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,080000%)	2,97	0,04	1,08	1,29	4.864.772,29	0,45			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	3,29	0,04	1,09	5,88	56.819.595,97	5,2			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	3,02	0,04	1,09	1,77	22.630.570,09	2,07			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	3,03	0,04	1,09	2,15	5.288.657,32	0,48			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	14,77	0,04	1,1	5,94	38.979.118,72	3,57			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,325000%)	0,47	0,04	1,1	5,96	4.451.548,41	0,41			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	3,08	0,04	1,11	2,65	20.442.162,47	1,87			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,600000%)	3,97	0,04	1,12	6,07	4.120.380,36	0,38			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,47	0,04	1,09	5,92	15.127.240,96	1,38			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	11,75	0,04	1,09	5,91	44.567.955,66	4,08			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	10,17	0,1	1,09	5,88	40.168.857,87	3,68			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	14,1	0,04	1,1	5,94	33.648.266,89	3,08			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,385000%)	4,37	0,04	1,11	2,65	22.581.523,03	2,07			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,427000%)	4,39	0,04	1,11	4,16	32.396.258,73	2,97			
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		6,14	0,05	1,09	5,91	467.734.003,06	42,82			
Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				



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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,06	1,22	3,61	5.953.376,48	0,55	15.093.190.243,42	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,52	0,01	-0,01	4,58	8.365.275,94	0,77	3.601.308.774,10	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,2	-0,04	2,84	9,38	1.897.103,41	0,17	891.125.850,38	0,21
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	6,24	-0,04	2,84	9,38	4.629.791,17	0,42	235.466.680,27	1,97
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,79	0,01	0,36	5,5	35.099.673,55	3,21	6.636.813.957,94	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,51	0,04	2,2	7,3	111.594.755,23	10,22	1.186.587.228,81	9,4
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,05	0,97	4,6	446.724,66	0,04	900.415.296,74	0,05
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,46	0	1,09	5,77	0	0	241.807.690,53	0
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,26	0,01	-0,01	4,57	2.819.645,18	0,26	208.529.617,32	1,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,98	0,03	1,64	6,74	170.806.345,62	15,64		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,46	0,06	1,17	4,63	106.372.301,30	9,74	792.839.447,57	13,42
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	0,11	0	0	0	10.553.350,05	0,97	224.228.668,39	4,71
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,04	4,93	50.121.520,21	4,59	3.860.323.166,27	1,3
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,06	1,16	2,52	44.484.998,83	4,07	8.436.127.357,01	0,53
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LONGO PRAZO	0,58	0	1,13	3,94	0	0	665.763.792,89	0
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,73	0,05	1,49	5,73	81.130.424,23	7,43	2.873.372.304,81	2,82
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,86	0,05	1,26	4,47	292.662.594,62	26,79		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,46	0,01	0,55	5,63	5.451.024,64	0,5	321.142.550,57	1,7
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			2,46	0,01	0,55	5,63	5.451.024,64	0,5		
Renda Fixa			3,15	0,04	1,24	5,61	936.653.967,94	85,75		

RENDA VARIÁVEL
7,24%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	18,78	-0,35	6,03	3,4	10.840.145,77	0,99	1.189.891.343,79	0,91



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,32	-0,32	7,44	-2,5	35.885.434,67	3,29	1.350.305.370,46	2,66
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,82	-0,34	2,54	-5,3	5.483.051,53	0,5	204.109.039,01	2,69
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVSPA ATIVO FIA	21,15	-0,7	3,01	-4,82	7.337.789,62	0,67	143.802.604,30	5,1
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,26	-0,8	0,44	-5,07	9.479.603,55	0,87	839.965.227,23	1,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,05	-0,21	5,24	-3,56	928.407,54	0,08	317.640.425,26	0,29
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	17,95	-0,03	4,56	0,56	9.112.381,07	0,83	435.939.233,82	2,09
Sub-total Artigo 8º I			19,08	-0,39	5,24	-2,18	79.066.813,75	7,24		
Renda Variável			19,08	-0,39	5,24	-2,18	79.066.813,75	7,24		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 3,98%										
Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	27,64	-0,28	5,35	13,7	4.587.064,90	0,42	179.476.313,56	2,56
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	48,18	1,17	12,68	16,2	3.860.015,47	0,35	180.506.038,86	2,14
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35,1	-0,36	6,84	21,04	9.560.259,47	0,88	658.978.226,88	1,45
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	18,64	-0,74	-0,26	11,32	14.293.624,95	1,31	318.643.175,62	4,49
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	24,21	-0,97	2,61	5,57	11.162.447,83	1,02	296.355.367,98	3,77
Sub-total Artigo 9º II			22,19	-0,5	3,64	12,4	43.463.412,62	3,98		
Investimentos no Exterior			21,11	-0,5	3,64	12,4	43.463.412,62	3,98		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,94%										
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	25,92	0,04	0,4	2,06	23.599.724,28	2,16	164.644.510,49	14,33
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	10,06	-0,22	2,91	8,55	2.083.181,70	0,19	187.315.713,28	1,11
Sub-total Artigo 10º I			15,65	0,02	0,6	5,55	25.682.905,98	2,35		
Artigo 10º II (Fundo de Participação)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid.	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	%	PL do Fundo	%



			a.a. (%)	Dia	Mês	Ano		Carteira		Fundo
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,5	-0,17	-0,17	103,9	3.224.638,51	0,3	155.004.456,26	2,08
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	18,88	2,09	2,09	8,45	3.168.213,48	0,29	95.334.478,35	3,32
Sub-total Artigo 10º II			32,6	0,94	0,94	41,96	6.392.851,99	0,59		
Investimentos Estruturados			14,72	0,2	0,67	8,36	32.075.757,97	2,94		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,09%										
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	CEF	CXR111	15,44	7,9	8,86	12,07	1.021.950,00	0,09	135.271.947,76	0,76
Sub-total Artigo 11º			15,44	7,9	8,86	12,07	1.021.950,00	0,09		
Fundos Imobiliários			15,44	7,9	8,86	12,07	1.021.950,00	0,09		
Total			4,23	0	1,6	4,86	1.092.281.902,28	100		

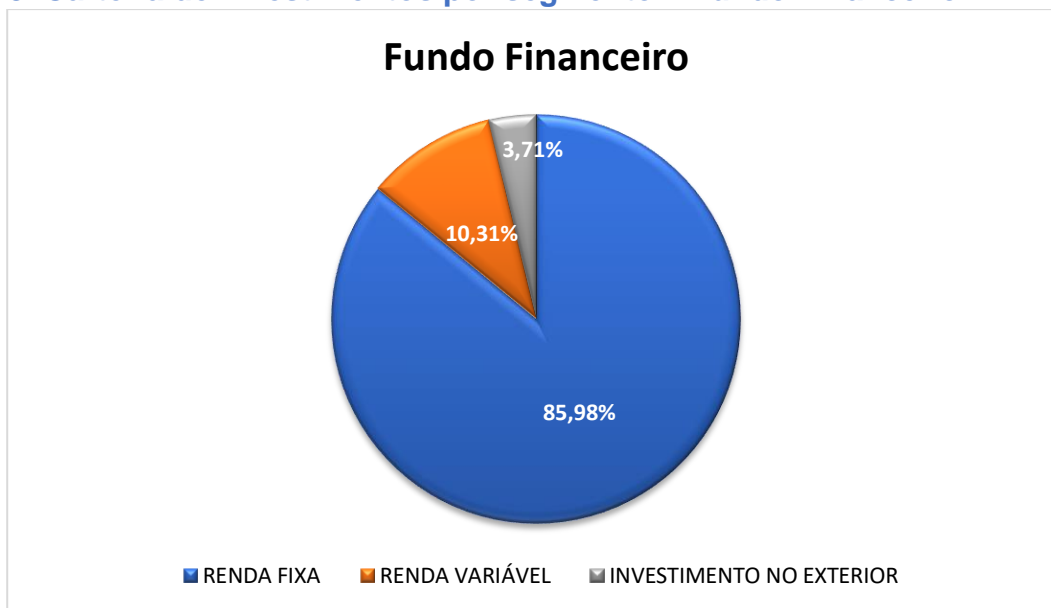
7. Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – 2023

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	8.400,00	0,00	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%
MARÇO	1.029.705.535,15	134.134.699,30	141.254.436,99	8.400,00	0,00	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	8.400,00	0,00	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	8400,00	8.249.869,40	17.225.387,19	1.092.281.902,27	1,60%	0,68%
TOTAL RETORNO				461.447,36	12.284.294,51	48.538.456,58		4,86%	5,12%

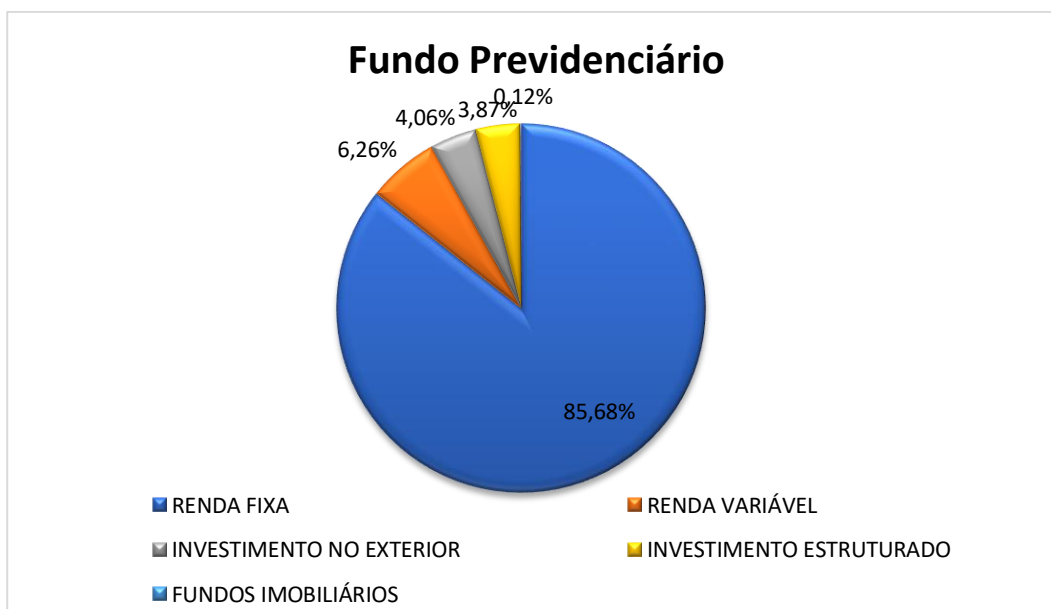
Vê-se que no mês de maio de 2023 a GuarujáPrev teve o retorno de 1,60% e a Meta Atuarial o percentual de 0,68%, alcançando a meta do mês. Ao longo do ano, a rentabilidade da carteira é de 4,86% perante uma Meta Atuarial de 5,12



8. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro



9. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Previdenciário





10. Carteira de Investimentos por segmento– Consolidado





GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Pró-Gestão

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

ATIVIDADE	MAIO
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, 14 de julho 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**