

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

JUNHO DE 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 JUNHO 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 – JUNHO DE 2023.....	6
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – JUNHO 2023	9
8. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO FINANCEIRO	10
9. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO– FUNDO PREVIDENCIÁRIO	10
.....	11



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 junho de 2023.

2. Cenário junho de 2023

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

MERCADOS INTERNACIONAIS

Ao longo do trimestre, mesmo com uma recuperação após a crise bancária do início do ano, as incertezas econômicas e as preocupações com a inflação persistiram nas economias, criando um ambiente de cautela e incertezas para os mercados globais. Nos EUA, apesar do aperto monetário, os dados mais fortes de atividade e emprego, bem como a diminuição do estresse financeiro, gerado pela insolvência dos bancos regionais, abrem a possibilidade para novas elevações da taxa básica de juros. Em contrapartida, o efeito sobre a curva de juros foi o aumento das taxas no final do trimestre, voltando aos patamares próximos dos observados antes da crise dos bancos regionais no início do ano. Na Zona do Euro, ainda há uma dinâmica desfavorável para o Banco Central. Onde, a inflação continua pressionada, com queda ainda ocorrendo de forma gradual. Adicionalmente, o mercado de trabalho está apertado e desacelerando apenas modestamente seguindo como um risco para a inflação. Além disso, a atividade econômica está desacelerando, sendo afetada pela diminuição da demanda por bens e pelo aperto das condições de crédito, resultando em uma dinâmica desafiadora para a região. Na China, no segundo trimestre de 2023, mesmo que ainda apresentando resultados positivos em decorrência do encerramento da política de covid zero, começou a demonstrar sinais de desaceleração no dinamismo de recuperação econômica. Onde, há poucos sinais de avanço, onde o setor de imóveis encontra-se em estagnação. Assim, a economia chinesa parece passar por desaquecimento mais intenso que o previsto. Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos no trimestre. Assim, no 2º trimestre de 2023 o MSCI ACWI e o S&P 500 respectivamente renderam +5,58%



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

e +8,30%. Assim, no acumulado dos últimos 12 meses obtiveram retorno de +14,42% e +17,57%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, devido a desvalorização do Dólar frente ao Real, o MSCI ACWI e o S&P 500 subiram +0,15% e +2,73% no segundo trimestre de 2023, enquanto, no acumulado dos últimos 12 meses apresentaram retorno de +5,27% e +8,17%.

BRASIL

Localmente, ao longo do trimestre, houve a queda dos juros que foi sustentada pelo alívio nas expectativas de inflação para este ano, a aprovação do novo arcabouço fiscal e a manutenção da meta de inflação para os próximos anos. A inflação seguiu um estágio de desaceleração lento ao longo do trimestre, apresentando uma melhora somente em junho, ainda com medida do núcleo em patamar elevado e acima da meta. 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, vale destacar a redução das expectativas para inflação observada no Boletim Focus nos períodos mais longos. No fim do trimestre, houve a reunião do CMN a respeito das metas de inflação, as quais foram um dos principais temas abordados ao longo do ano. Assim, as metas até 2025 foram mantidas e a de 2026 foi fixada em 3,0%. Após a reunião, o Ministro da Fazenda anunciou que haverá uma alteração na forma como a consecução da meta seria aferida a partir de 2025, com o estabelecimento de um horizonte móvel, mas ainda sem divulgar os detalhes sobre a nova mecânica. A taxa Selic não sofreu alteração ao longo do trimestre, sendo mantida em 13,75%. Entretanto, a comunicação do Copom foi tornando-se mais branda. Adicionalmente, após a última reunião do trimestre, houve a retirada na ata da reunião a frase que previa a possibilidade de aumento dos juros caso o processo de desinflação não ocorresse conforme o desejado. Assim, o mercado ainda possui a expectativa de que o fim do ciclo de aperto monetário está próximo. Em consequência as decisões do CMN e Copom, houve redução das taxas da curva de juros. Na renda variável, os índices Ibovespa e SMLL seguiram a dinâmica dos índices internacionais, fechando o trimestre em território positivo. Respectivamente,



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050 

@guarujaprevidencia 

@guarujaprevidencia 

guarujaprevidencia.sp.gov.br 

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

apresentando um retorno de +15,91% e +25,16% no 2º trimestre de 2023, e de +19,83% e +19,79% no acumulado dos últimos 12 meses.

3. Desafios para os próximos meses

A SELIC continuou com a taxa de 13,75% e durante o mês de junho o IPCA veio com deflação de -0,08%.

O Comitê continuará realocando os seus ativos, quando possível a fim de se alcançar a Meta Atuarial em 2023 e está observando os movimentos das taxas de juros. Espera-se que nesta reunião o COPOM reduza a taxa básica de juros da economia. Com isso o Comitê já começará a fazer movimentações na carteira a fim de captar essa queda na Selic.



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 junho de 2023

Pontos de atenção:

A Var do Fundo GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE reduziu para 12,93% o que está dentro do limite estipulado pelo Comitê de 20%. Essa redução reflete a valorização das bolsas internacionais durante o período.



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 em Títulos Públicos 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 e no dia 22/06/2023 – 6ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos.

Verifica-se que foram realizadas todas as aplicações.

6. Carteira de Investimentos – Junho de 2023.

CARTEIRA DE INVSETIMENTOS – JUNHO DE 2023								
RENDA FIXA								
85,35%								
Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)								
Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	
			Dia	Mês	Ano			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	2,39	0,06	0,95	5,67	25.224.336,94	2,26	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,396600%)	3,92	0,02	0,31	0,31	988.519,61	0,09	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,47	0,02	0,49	6,42	33.220.481,40	2,98	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,600500%)	3,92	0,02	0,32	0,32	2.629.191,75	0,24	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	2,94	0,02	0,48	6,34	24.561.633,34	2,2	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,47	0,02	0,5	6,46	60.068.040,99	5,38	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,02	0,51	6,53	2.998.325,81	0,27	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,548000%)	3,86	0,02	0,03	0,03	5.482.600,12	0,49	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,595500%)	3,89	0,02	0,32	0,32	2.473.680,39	0,22	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	3,93	0,02	0,35	0,35	11.492.404,73	1,03	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,080000%)	2,97	0,02	0,48	1,78	4.888.203,21	0,44	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	3,29	0,02	0,49	6,39	57.095.728,45	5,12	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	3,02	0,02	0,49	2,27	22.741.891,73	2,04	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	3,03	0,02	0,49	2,65	5.314.755,87	0,48	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	14,77	0,02	0,5	6,46	39.172.702,71	3,51	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,325000%)	0,47	0,02	0,5	6,49	4.473.847,81	0,4	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	3,08	0,02	0,5	3,16	20.545.334,39	1,84	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,600000%)	3,96	0,02	0,52	6,62	4.141.913,88	0,37	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,47	0,02	0,49	6,45	15.202.017,66	1,36	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	11,75	0,02	0,49	6,43	44.786.855,40	4,01	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	10,17	0,08	0,49	6,4	40.364.080,75	3,62	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	14,1	0,02	0,5	6,46	33.815.362,22	3,03	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,385000%)	4,37	0,02	0,51	3,17	22.695.720,93	2,03	



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,427000%)	4,39	0,02	0,51	4,69	32.561.137,10	2,92				
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		6,14	0,03	0,51	6,45	516.938.767,19	46,34				
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					
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,06	1,13	4,78	6.020.538,41	0,54	14.603.622.203,04	0,04	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,39	0,06	0,93	5,55	8.443.195,19	0,76	3.755.106.041,15	0,22	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,1	0,69	2,18	11,77	1.938.548,61	0,17	968.017.898,56	0,2	
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	6,13	0,69	2,18	11,76	4.730.835,40	0,42	240.605.691,57	1,97	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,7	0,17	1,04	6,6	35.465.856,74	3,18	5.947.143.642,03	0,6	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,39	0,29	2,1	9,56	113.938.166,77	10,21	1.551.038.458,72	7,35	
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,15	0,05	0,93	5,54	2.845.807,27	0,26	210.464.460,25	1,35	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		2,93	0,26	1,77	8,65	173.382.948,39	15,54				
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	0,47	0,05	1,12	5,8	115.005.260,70	10,31	784.172.066,94	14,67	
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	7,65	0,17	-0,57	-0,57	10.493.238,31	0,94	223.357.903,09	4,7	
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1	5,98	1.625.315,77	0,15	4.278.810.513,26	0,04	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	0,99	5,64	458.951,09	0,04	743.796.291,54	0,06	
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	1,13	3,68	44.988.771,07	4,03	8.773.662.957,45	0,51	
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,72	0,13	1,3	7,1	83.780.411,45	7,51	2.989.973.548,90	2,8	
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a		1,82	0,08	1,11	5,63	256.351.948,39	22,98				
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	2,34	0,15	0,99	6,68	5.505.080,01	0,49	313.921.376,41	1,75	
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b		2,34	0,15	0,99	6,68	5.505.080,01	0,49				
Renda Fixa			3,11	0,08	0,9	6,56	952.178.743,98	85,35			
RENDA VARIÁVEL 7,73%											
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	18,65	0,63	8,16	11,84	11.724.724,80	1,05	1.312.877.349,58	0,89	
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,05	0,73	9,39	6,66	39.253.412,00	3,52	1.451.994.845,07	2,7	
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,26	0,23	8	2,28	5.921.586,02	0,53	214.457.094,15	2,76	
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVSPA	20,93	-0,2	8,65	3,42	7.972.561,26	0,71	143.339.856,02	5,56	



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

ATIVO FIA										
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,1	-0,42	10,15	4,56	10.441.408,75	0,94	925.420.855,31	1,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,84	1,03	7,75	3,91	1.000.324,47	0,09	341.230.820,46	0,29
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	18,06	0,57	8,74	9,35	9.908.936,79	0,89	474.046.753,01	2,09
Sub-total Artigo 8º I			18,9	0,44	9,05	6,67	86.222.954,09	7,73		
Renda Variável			18,9	0,44	9,05	6,67	86.222.954,09	7,73		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 3,95%										
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	26,15	-0,23	-1,13	12,42	4.535.282,74	0,41	183.156.682,19	2,48
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	45,52	-0,56	4,02	20,87	4.015.100,99	0,36	187.616.356,82	2,14
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	33,3	-0,6	0,56	21,72	9.614.073,85	0,86	652.308.818,52	1,47
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	17,49	1,01	5,07	16,96	15.018.381,82	1,35	318.681.812,62	4,71
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	23,97	-0,73	-2,57	2,86	10.875.592,38	0,97	288.636.067,89	3,77
Sub-total Artigo 9º II			21,02	-0,05	1,37	13,94	44.058.431,78	3,95		
Investimentos no Exterior			20,12	-0,05	1,37	13,94	44.058.431,78	3,95		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,58%										
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	7,52	-0,15	-0,78	1,26	23.415.005,72	2,1	163.355.810,60	14,33
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	8,75	0,27	3,57	12,43	2.157.601,66	0,19	235.449.328,87	0,92
Sub-total Artigo 10º I			9,84	-0,12	-0,43	5,1	25.572.607,38	2,29		
Artigo 10º II (Fundo de Participação)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	18,87	-0,14	-0,14	8,3	3.163.919,99	0,28	95.334.478,35	3,32
Sub-total Artigo 10º II			18,87	-0,14	-0,14	8,3	3.163.919,99	0,28		
Investimentos Estruturados			9,11	-0,12	-0,4	5,25	28.736.527,37	2,58		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,39%										
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	CXRI11	21,56	0	16,31	30,34	1.180.200,00	0,11	143.138.450,33	0,82
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,5	-0,05	-0,05	103,75	3.223.166,12	0,29	315.113.130,83	1,02



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Sub-total Artigo 11º	50	-0,03	3,89	76,24	4.403.366,12	0,39	
Fundos Imobiliários	50	-0,03	3,89	76,24	4.403.366,12	0,39	
Total	3,93	0,1	1,49	6,42	1.115.600.023,34	100	

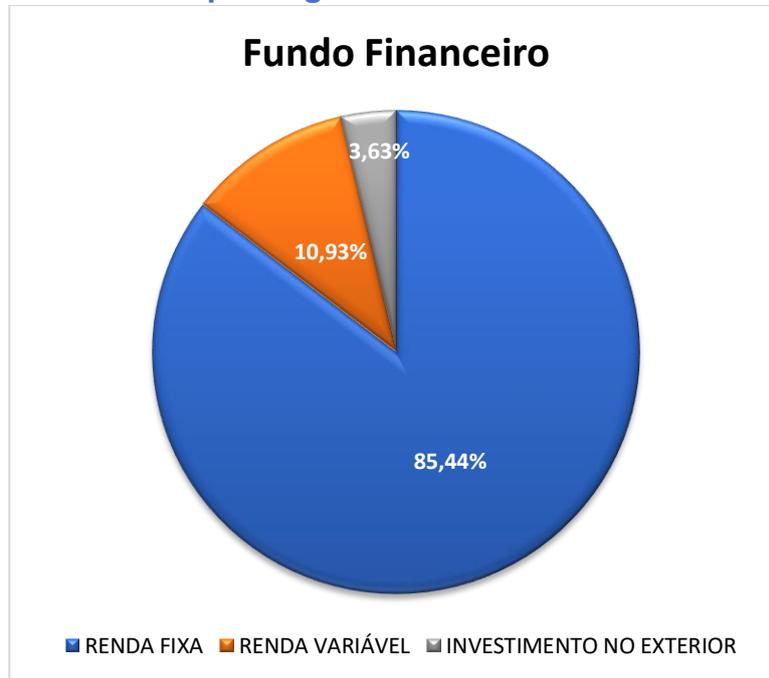
7. Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – junho 2023

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	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	-0,29%	1,21%
MARÇO	1.029.705.535,15	134.134.699,30	141.254.436,99	8.400,00	0	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	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	8.400,00	8.249.869,40	17.225.387,19	1.092.281.902,27	1,60%	0,68%
JUNHO	1.092.281.902,27	55.761.426,84	48.767.254,87	8.400,00	0,00	16.323.949,09	1.115.600.023,33	1,49%	0,35%
TOTAL RETORNO				469.847,36	12.284.294,51	64.862.405,67		6,43%	5,48%

Vê-se que no mês de junho de 2023 a GuarujáPrev teve o retorno de 1,49% e a Meta Atuarial o percentual de 0,35%, alcançando a meta do mês. Ao longo do ano, a rentabilidade da carteira é de 6,43% perante uma Meta Atuarial de 5,48.



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





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 junho 2023

ATIVIDADE	JUNHO
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

Guarujá, 18 de agosto 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

(Assinado Digitalmente)

(Assinado Digitalmente)



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050 

@guarujaprevidencia 

@guarujaprevidencia 

guarujaprevidencia.sp.gov.br 

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

Fábio Enrique Camilo José Esteves
Secretário do Comitê de Investimentos

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**



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 JUNHO 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 – JUNHO DE 2023.....	6
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – JUNHO 2023	9
8. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO FINANCEIRO	10
9. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO– FUNDO PREVIDENCIÁRIO	10
.....	11



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 junho de 2023.

2. Cenário junho de 2023

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

MERCADOS INTERNACIONAIS

Ao longo do trimestre, mesmo com uma recuperação após a crise bancária do início do ano, as incertezas econômicas e as preocupações com a inflação persistiram nas economias, criando um ambiente de cautela e incertezas para os mercados globais. Nos EUA, apesar do aperto monetário, os dados mais fortes de atividade e emprego, bem como a diminuição do estresse financeiro, gerado pela insolvência dos bancos regionais, abrem a possibilidade para novas elevações da taxa básica de juros. Em contrapartida, o efeito sobre a curva de juros foi o aumento das taxas no final do trimestre, voltando aos patamares próximos dos observados antes da crise dos bancos regionais no início do ano. Na Zona do Euro, ainda há uma dinâmica desfavorável para o Banco Central. Onde, a inflação continua pressionada, com queda ainda ocorrendo de forma gradual. Adicionalmente, o mercado de trabalho está apertado e desacelerando apenas modestamente seguindo como um risco para a inflação. Além disso, a atividade econômica está desacelerando, sendo afetada pela diminuição da demanda por bens e pelo aperto das condições de crédito, resultando em uma dinâmica desafiadora para a região. Na China, no segundo trimestre de 2023, mesmo que ainda apresentando resultados positivos em decorrência do encerramento da política de covid zero, começou a demonstrar sinais de desaceleração no dinamismo de recuperação econômica. Onde, há poucos sinais de avanço, onde o setor de imóveis encontra-se em estagnação. Assim, a economia chinesa parece passar por desaquecimento mais intenso que o previsto. Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos no trimestre. Assim, no 2º trimestre de 2023 o MSCI ACWI e o S&P 500 respectivamente renderam +5,58%



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

e +8,30%. Assim, no acumulado dos últimos 12 meses obtiveram retorno de +14,42% e +17,57%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, devido a desvalorização do Dólar frente ao Real, o MSCI ACWI e o S&P 500 subiram +0,15% e +2,73% no segundo trimestre de 2023, enquanto, no acumulado dos últimos 12 meses apresentaram retorno de +5,27% e +8,17%.

BRASIL

Localmente, ao longo do trimestre, houve a queda dos juros que foi sustentada pelo alívio nas expectativas de inflação para este ano, a aprovação do novo arcabouço fiscal e a manutenção da meta de inflação para os próximos anos. A inflação seguiu um estágio de desaceleração lento ao longo do trimestre, apresentando uma melhora somente em junho, ainda com medida do núcleo em patamar elevado e acima da meta. 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, vale destacar a redução das expectativas para inflação observada no Boletim Focus nos períodos mais longos. No fim do trimestre, houve a reunião do CMN a respeito das metas de inflação, as quais foram um dos principais temas abordados ao longo do ano. Assim, as metas até 2025 foram mantidas e a de 2026 foi fixada em 3,0%. Após a reunião, o Ministro da Fazenda anunciou que haverá uma alteração na forma como a consecução da meta seria aferida a partir de 2025, com o estabelecimento de um horizonte móvel, mas ainda sem divulgar os detalhes sobre a nova mecânica. A taxa Selic não sofreu alteração ao longo do trimestre, sendo mantida em 13,75%. Entretanto, a comunicação do Copom foi tornando-se mais branda. Adicionalmente, após a última reunião do trimestre, houve a retirada na ata da reunião a frase que previa a possibilidade de aumento dos juros caso o processo de desinflação não ocorresse conforme o desejado. Assim, o mercado ainda possui a expectativa de que o fim do ciclo de aperto monetário está próximo. Em consequência as decisões do CMN e Copom, houve redução das taxas da curva de juros. Na renda variável, os índices Ibovespa e SMLL seguiram a dinâmica dos índices internacionais, fechando o trimestre em território positivo. Respectivamente,



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050 

@guarujaprevidencia 

@guarujaprevidencia 

guarujaprevidencia.sp.gov.br 

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

apresentando um retorno de +15,91% e +25,16% no 2º trimestre de 2023, e de +19,83% e +19,79% no acumulado dos últimos 12 meses.

3. Desafios para os próximos meses

A SELIC continuou com a taxa de 13,75% e durante o mês de junho o IPCA veio com deflação de -0,08%.

O Comitê continuará realocando os seus ativos, quando possível a fim de se alcançar a Meta Atuarial em 2023 e está observando os movimentos das taxas de juros. Espera-se que nesta reunião o COPOM reduza a taxa básica de juros da economia. Com isso o Comitê já começará a fazer movimentações na carteira a fim de captar essa queda na Selic.



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 junho de 2023

Pontos de atenção:

A Var do Fundo GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE reduziu para 12,93% o que está dentro do limite estipulado pelo Comitê de 20%. Essa redução reflete a valorização das bolsas internacionais durante o período.



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 em Títulos Públicos 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 e no dia 22/06/2023 – 6ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos.

Verifica-se que foram realizadas todas as aplicações.

6. Carteira de Investimentos – Junho de 2023.

CARTEIRA DE INVSETIMENTOS – JUNHO DE 2023								
RENDA FIXA								
85,35%								
Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)								
Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	
			Dia	Mês	Ano			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	2,39	0,06	0,95	5,67	25.224.336,94	2,26	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,396600%)	3,92	0,02	0,31	0,31	988.519,61	0,09	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,47	0,02	0,49	6,42	33.220.481,40	2,98	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,600500%)	3,92	0,02	0,32	0,32	2.629.191,75	0,24	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	2,94	0,02	0,48	6,34	24.561.633,34	2,2	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,47	0,02	0,5	6,46	60.068.040,99	5,38	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,02	0,51	6,53	2.998.325,81	0,27	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,548000%)	3,86	0,02	0,03	0,03	5.482.600,12	0,49	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,595500%)	3,89	0,02	0,32	0,32	2.473.680,39	0,22	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	3,93	0,02	0,35	0,35	11.492.404,73	1,03	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,080000%)	2,97	0,02	0,48	1,78	4.888.203,21	0,44	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	3,29	0,02	0,49	6,39	57.095.728,45	5,12	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	3,02	0,02	0,49	2,27	22.741.891,73	2,04	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	3,03	0,02	0,49	2,65	5.314.755,87	0,48	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	14,77	0,02	0,5	6,46	39.172.702,71	3,51	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,325000%)	0,47	0,02	0,5	6,49	4.473.847,81	0,4	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	3,08	0,02	0,5	3,16	20.545.334,39	1,84	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,600000%)	3,96	0,02	0,52	6,62	4.141.913,88	0,37	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,47	0,02	0,49	6,45	15.202.017,66	1,36	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	11,75	0,02	0,49	6,43	44.786.855,40	4,01	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	10,17	0,08	0,49	6,4	40.364.080,75	3,62	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	14,1	0,02	0,5	6,46	33.815.362,22	3,03	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,385000%)	4,37	0,02	0,51	3,17	22.695.720,93	2,03	



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,427000%)	4,39	0,02	0,51	4,69	32.561.137,10	2,92				
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		6,14	0,03	0,51	6,45	516.938.767,19	46,34				
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					
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,06	1,13	4,78	6.020.538,41	0,54	14.603.622.203,04	0,04	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,39	0,06	0,93	5,55	8.443.195,19	0,76	3.755.106.041,15	0,22	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,1	0,69	2,18	11,77	1.938.548,61	0,17	968.017.898,56	0,2	
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	6,13	0,69	2,18	11,76	4.730.835,40	0,42	240.605.691,57	1,97	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,7	0,17	1,04	6,6	35.465.856,74	3,18	5.947.143.642,03	0,6	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,39	0,29	2,1	9,56	113.938.166,77	10,21	1.551.038.458,72	7,35	
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,15	0,05	0,93	5,54	2.845.807,27	0,26	210.464.460,25	1,35	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		2,93	0,26	1,77	8,65	173.382.948,39	15,54				
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	0,47	0,05	1,12	5,8	115.005.260,70	10,31	784.172.066,94	14,67	
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	7,65	0,17	-0,57	-0,57	10.493.238,31	0,94	223.357.903,09	4,7	
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1	5,98	1.625.315,77	0,15	4.278.810.513,26	0,04	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	0,99	5,64	458.951,09	0,04	743.796.291,54	0,06	
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	1,13	3,68	44.988.771,07	4,03	8.773.662.957,45	0,51	
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,72	0,13	1,3	7,1	83.780.411,45	7,51	2.989.973.548,90	2,8	
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a		1,82	0,08	1,11	5,63	256.351.948,39	22,98				
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	2,34	0,15	0,99	6,68	5.505.080,01	0,49	313.921.376,41	1,75	
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b		2,34	0,15	0,99	6,68	5.505.080,01	0,49				
Renda Fixa			3,11	0,08	0,9	6,56	952.178.743,98	85,35			
REDA VARIÁVEL 7,73%											
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	18,65	0,63	8,16	11,84	11.724.724,80	1,05	1.312.877.349,58	0,89	
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,05	0,73	9,39	6,66	39.253.412,00	3,52	1.451.994.845,07	2,7	
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,26	0,23	8	2,28	5.921.586,02	0,53	214.457.094,15	2,76	
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA	20,93	-0,2	8,65	3,42	7.972.561,26	0,71	143.339.856,02	5,56	



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

ATIVO FIA										
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,1	-0,42	10,15	4,56	10.441.408,75	0,94	925.420.855,31	1,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,84	1,03	7,75	3,91	1.000.324,47	0,09	341.230.820,46	0,29
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	18,06	0,57	8,74	9,35	9.908.936,79	0,89	474.046.753,01	2,09
Sub-total Artigo 8º I			18,9	0,44	9,05	6,67	86.222.954,09	7,73		
Renda Variável			18,9	0,44	9,05	6,67	86.222.954,09	7,73		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 3,95%										
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	26,15	-0,23	-1,13	12,42	4.535.282,74	0,41	183.156.682,19	2,48
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	45,52	-0,56	4,02	20,87	4.015.100,99	0,36	187.616.356,82	2,14
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	33,3	-0,6	0,56	21,72	9.614.073,85	0,86	652.308.818,52	1,47
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	17,49	1,01	5,07	16,96	15.018.381,82	1,35	318.681.812,62	4,71
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	23,97	-0,73	-2,57	2,86	10.875.592,38	0,97	288.636.067,89	3,77
Sub-total Artigo 9º II			21,02	-0,05	1,37	13,94	44.058.431,78	3,95		
Investimentos no Exterior			20,12	-0,05	1,37	13,94	44.058.431,78	3,95		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,58%										
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	7,52	-0,15	-0,78	1,26	23.415.005,72	2,1	163.355.810,60	14,33
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	8,75	0,27	3,57	12,43	2.157.601,66	0,19	235.449.328,87	0,92
Sub-total Artigo 10º I			9,84	-0,12	-0,43	5,1	25.572.607,38	2,29		
Artigo 10º II (Fundo de Participação)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	18,87	-0,14	-0,14	8,3	3.163.919,99	0,28	95.334.478,35	3,32
Sub-total Artigo 10º II			18,87	-0,14	-0,14	8,3	3.163.919,99	0,28		
Investimentos Estruturados			9,11	-0,12	-0,4	5,25	28.736.527,37	2,58		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,39%										
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	CXRI11	21,56	0	16,31	30,34	1.180.200,00	0,11	143.138.450,33	0,82
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,5	-0,05	-0,05	103,75	3.223.166,12	0,29	315.113.130,83	1,02



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Sub-total Artigo 11º	50	-0,03	3,89	76,24	4.403.366,12	0,39	
Fundos Imobiliários	50	-0,03	3,89	76,24	4.403.366,12	0,39	
Total	3,93	0,1	1,49	6,42	1.115.600.023,34	100	

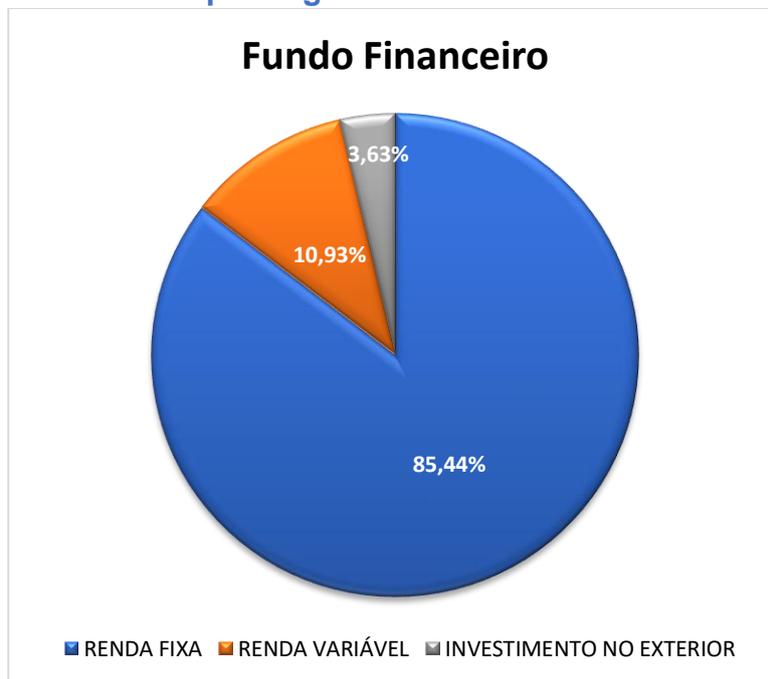
7. Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – junho 2023

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	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	-0,29%	1,21%
MARÇO	1.029.705.535,15	134.134.699,30	141.254.436,99	8.400,00	0	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	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	8.400,00	8.249.869,40	17.225.387,19	1.092.281.902,27	1,60%	0,68%
JUNHO	1.092.281.902,27	55.761.426,84	48.767.254,87	8.400,00	0,00	16.323.949,09	1.115.600.023,33	1,49%	0,35%
TOTAL RETORNO				469.847,36	12.284.294,51	64.862.405,67		6,43%	5,48%

Vê-se que no mês de junho de 2023 a GuarujáPrev teve o retorno de 1,49% e a Meta Atuarial o percentual de 0,35%, alcançando a meta do mês. Ao longo do ano, a rentabilidade da carteira é de 6,43% perante uma Meta Atuarial de 5,48.



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





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 junho 2023

ATIVIDADE	JUNHO
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

Guarujá, 18 de agosto 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

(Assinado Digitalmente)

(Assinado Digitalmente)



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Fábio Enrique Camilo José Esteves
Secretário do Comitê de Investimentos

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**