

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

AGOSTO 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 AGOSTO 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:	5
6. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – JUNHO DE 2023.....	5
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – AGOSTO 2023	10
8. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO FINANCEIRO	11
9. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO– FUNDO PREVIDENCIÁRIO	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 agosto de 2023.

2. Cenário agosto de 2023

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

MERCADOS INTERNACIONAIS

Julho foi um mês relativamente calmo para o mercado internacional, com oscilações moderadas dos juros globais, acrescido do aumento da expectativa sobre a probabilidade de um “pouso suave” das economias, em virtude de uma melhora no cenário inflacionário. Ainda assim, os principais bancos centrais voltaram a elevar os juros, em linha com o esperado. Nos EUA, o Fed elevou os juros em 0,25%, mas apesar do aperto monetário, os dados de atividade econômica demonstram resiliência, com expansão do PIB no segundo trimestre e um mercado de trabalho ainda aquecido. Já o núcleo da inflação ao consumidor (CPI) encontra-se em níveis ainda pressionados, entretanto a inflação divulgada foi mais baixa do que o consenso do mercado, com bom desempenho das medidas de núcleo. Na Zona do Euro, banco central europeu subiu os juros em 0,25%, em resposta a uma inflação ainda pressionada. Assim como nos EUA, ainda há o movimento de elevação do PIB, entretanto a atividade já mostra certa acomodação, com um fraco desempenho na Alemanha. Na economia chinesa, os dados de atividade continuaram a mostrar nível de atividade abaixo das expectativas, enquanto a economia avança de forma moderada e as pressões deflacionárias se intensificaram. Desta forma, o governo vem adotando medidas de estímulo e maior apoio ao setor privado. Vale destacar que apesar de uma certa recuperação dos preços das commodities neste mês, a leitura é de que a atividade econômica global vem desacelerando, o que dessa forma dá suporte a expectativa do fim do ciclo de alta dos juros nas economias desenvolvidas e o início do ciclo de redução dos juros nas economias emergentes. Assim, no mês de julho de 2023, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +3,55% e



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

+3,11%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +10,88% e +11,11%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +1,88% e +1,45%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +1,33% e +1,54% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, os juros oscilaram com dados de inflação mais benignos, que levaram ao mercado a ajustar apostas sobre o ritmo esperado de queda dos juros. Além disso, houve a aprovação da Reforma Tributária, na Câmara, e a alteração da nota de risco do Brasil pela Fitch Ratings. O projeto de Reforma Tributária, um assunto politicamente complicado e que já vinha sendo discutido há anos, foi aprovado pela Câmara em julho. Sendo este um importante passo para a melhora fiscal do país. Entretanto, é um tema a ser observado nos próximos meses, uma vez que ainda há a necessidade de ser aprovado no Senado, onde pode sofrer modificações. Alinhado à perspectiva de uma melhora no cenário fiscal, a Fitch Ratings decidiu elevar a nota de risco soberano do Brasil de BB- para BB. Vale destacar que o mercado brasileiro de juros, como geralmente acontece, já havia precificado essa melhora da nota do Brasil, com o forte rally dos últimos 3 meses, ainda que este tenha sido um movimento comum a todos os emergentes. A inflação continua evoluindo de forma favorável, com destaque para a continuidade da desaceleração das medidas de núcleo. No entanto, ainda é necessário observar o núcleo do grupo de serviços que apresentam níveis elevados quando observados nos últimos doze meses. Já no começo de agosto, em acordo com as expectativas do mercado, o Copom iniciou o ciclo de redução dos juros com um corte de 0,50% da taxa Selic para 13,25%. A expectativa no mercado estava dividida entre um corte de 0,25% e 0,50%. 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 10.08.2023, 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 5,08% a.a., continuando acima da taxa máxima pré-fixada de



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

4,90% limitada pela SPREV para o ano de 2023. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo a direção dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +3,27% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +11,13% e de +18,20% 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 abaixou para 13,25% e durante o mês de agosto o IPCA foi de 0,23%.

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.



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 agosto de 2023

Todos os fundos ficaram dentro da VaR estipulada por este Comitê.

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 16/08/2023 – 8ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos foram todas realizadas.

6. Carteira de Investimentos – Junho de 2023.

RENDA FIXA 85,83%							
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	2,05	-0,02	0,93	7,8	24.989.625,88	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,396600%)	3,92	0,03	0,67	1,43	999.570,04	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,41	0,04	0,74	7,74	33.634.329,00	2,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470100%)	3,87	0	0	0	399.308,13	0,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,480000%)	3,87	0	0	0	44.813,24	0
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,500000%)	3,88	0,03	0,11	0,11	5.628.577,75	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,600500%)	3,93	0,03	0,69	1,48	2.659.460,12	0,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	2,94	0,03	0,72	7,63	24.861.011,44	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,41	0,04	0,74	7,8	60.824.122,59	5,3
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,04	0,76	7,89	3.036.748,56	0,26



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 150555 (5,548000%)	3,87	0,03	0,69	1,18	5.545.244,38	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,595500%)	3,89	0,03	0,69	1,48	2.502.138,62	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	3,93	0,03	0,7	1,51	11.626.018,09	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,080000%)	2,97	0,04	0,73	3,03	4.948.301,96	0,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	3,29	0,04	0,73	7,71	57.802.786,28	5,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	3,02	0,04	0,74	3,55	23.026.300,20	2,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	3,03	0,04	0,74	3,94	5.381.397,64	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	14,31	0,04	0,75	7,8	39.666.425,86	3,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,325000%)	0,41	0,04	0,75	7,84	4.530.635,13	0,4
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	3,08	0,04	0,75	4,48	20.807.681,65	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,600000%)	2,59	0,04	0,77	8,02	4.075.219,41	0,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,610000%)	4,18	0,04	0,12	0,12	3.249.990,28	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,620000%)	4,18	0	0	0	160.835,59	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,41	0,04	0,74	7,78	14.945.738,58	1,3
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,390000%)	3,89	0,07	0,17	0,17	1.323.374,45	0,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	11,43	0,04	0,74	7,76	44.020.165,67	3,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,520000%)	3,89	0,03	0,09	0,09	3.877.810,04	0,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	10,01	0,04	0,67	7,65	39.647.792,29	3,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	13,66	0,04	0,75	7,8	33.226.916,74	2,9
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,385000%)	3,08	0,04	0,75	4,49	22.295.167,66	1,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,427000%)	3,1	0,04	0,76	6,04	31.983.517,83	2,79
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		5,98	0,03	0,74	7,81	531.721.025,10	46,37



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

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	0,05	1,09	7,03	6.149.524,24	0,54	13.160.867.738,74	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,05	-0,02	0,91	7,64	8.387.656,54	0,73	3.750.659.519,40	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	5,43	-0,23	0,39	13,01	1.911.537,83	0,17	965.375.479,99	0,2
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	5,43	-0,23	0,39	12,99	4.669.710,06	0,41	237.496.916,65	1,97
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,23	-0,08	0,84	1,31	8.407.627,92	0,73	1.465.202.121,99	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,9	-0,18	-0,18	-0,18	143.029.713,34	12,47	5.309.374.754,65	2,69
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	-0,04	0,95	8,6	8.902.605,03	0,78	5.516.538.099,11	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,26	0	0,94	11,56	0	0	1.943.645.723,80	0
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,04	-0,02	0,91	7,62	2.818.326,31	0,25	208.432.079,44	1,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,82	-0,15	0,79	10,5	184.276.701,27	16,07		

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	0,05	1,22	8,29	117.712.546,93	10,27	811.898.527,09	14,5
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5,36	-0,41	0,98	1,91	10.754.811,38	0,94	228.925.713,85	4,7
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1	8,1	1.782.658,00	0,16	3.793.232.762,71	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	1	7,75	868.831,14	0,08	881.606.538,97	0,1
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,05	1,21	6,18	46.073.062,36	4,02	8.968.256.185,51	0,51
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,82	0,04	0,81	9,03	85.291.819,09	7,44	2.925.279.416,29	2,92



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 7º III, Alínea a	1,3	0,03	1,07	7,94	262.483.728,90	22,89		
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	-0,03	0,94	8,74	5.611.332,49	0,49	315.699.063,91	1,78
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			2	-0,03	0,94	8,74	5.611.332,49	0,49		
Renda Fixa			2,98	0	0,85	8,28	984.092.787,76	85,83		
RENDA VARIÁVEL 7,36%										
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	18,4	-0,62	-	9,87	11.518.417,73	1	1.313.889.736,12	0,88
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,26	-0,78	-	3,41	38.058.648,33	3,32	1.389.120.196,78	2,74
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,05	-1,05	-	-0,32	5.771.255,43	0,5	207.226.931,24	2,78
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	20,36	-0,61	-	2,52	7.903.192,90	0,69	140.307.149,09	5,63
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,02	-0,67	-	2,76	10.262.072,76	0,89	885.787.929,12	1,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,42	-1,13	-	1,06	972.880,51	0,08	267.773.857,00	0,36
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	18,17	-0,61	-	8,87	9.865.891,28	0,86	472.120.939,19	2,09
Sub-total Artigo 8º I			18,67	-0,73	-	4,36	84.352.358,94	7,36		
Renda Variável			18,67	-0,73	-	4,36	84.352.358,94	7,36		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 3,91%										
Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)										



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. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,22	0,84	2,16	16,96	4.718.638,99	0,41	179.099.433,54	2,63
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	41,23	2,3	- 8,17	17,08	3.889.222,15	0,34	156.523.260,17	2,48
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,01	1,83	- 1,18	24,58	9.839.923,55	0,86	649.622.429,90	1,51
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	16,58	0,58	- 0,82	19,97	15.404.599,55	1,34	318.417.658,62	4,84
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	22,52	1,77	- 0,62	4,07	11.003.543,87	0,96	291.814.609,44	3,77
Sub-total Artigo 9º II			19,34	1,32	- 1,23	16	44.855.928,11	3,91		
Investimentos no Exterior			18,72	1,32	- 1,23	16	44.855.928,11	3,91		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,52%										
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	7,68	-0,09	- 0,65	13,92	2.186.278,05	0,19	270.528.141,73	0,81
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,16	0,11	- 0,27	1,84	23.548.398,48	2,05	164.286.427,41	14,33
Sub-total Artigo 10º I			8,93	0,09	-0,3	5,76	25.734.676,53	2,24		
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	18,58	0	0	8,13	3.159.088,11	0,28	96.341.363,51	3,28
Sub-total Artigo 10º II			18,58	0	0	8,13	3.159.088,11	0,28		
Investimentos Estruturados			8,25	0,08	- 0,27	5,82	28.893.764,64	2,52		



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

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	19,91	0	0,71	34,62	1.201.200,00	0,1	144.265.006,25	0,83
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,6	0	0	103,53	3.219.645,84	0,28	314.625.245,47	1,02
Sub-total Artigo 11º			49,38	0	0,19	77,65	4.420.845,84	0,39		
Fundos Imobiliários			49,38	0	0,19	77,65	4.420.845,84	0,39		
Total			3,55	0	0,29	7,81	1.146.615.685,29	100		

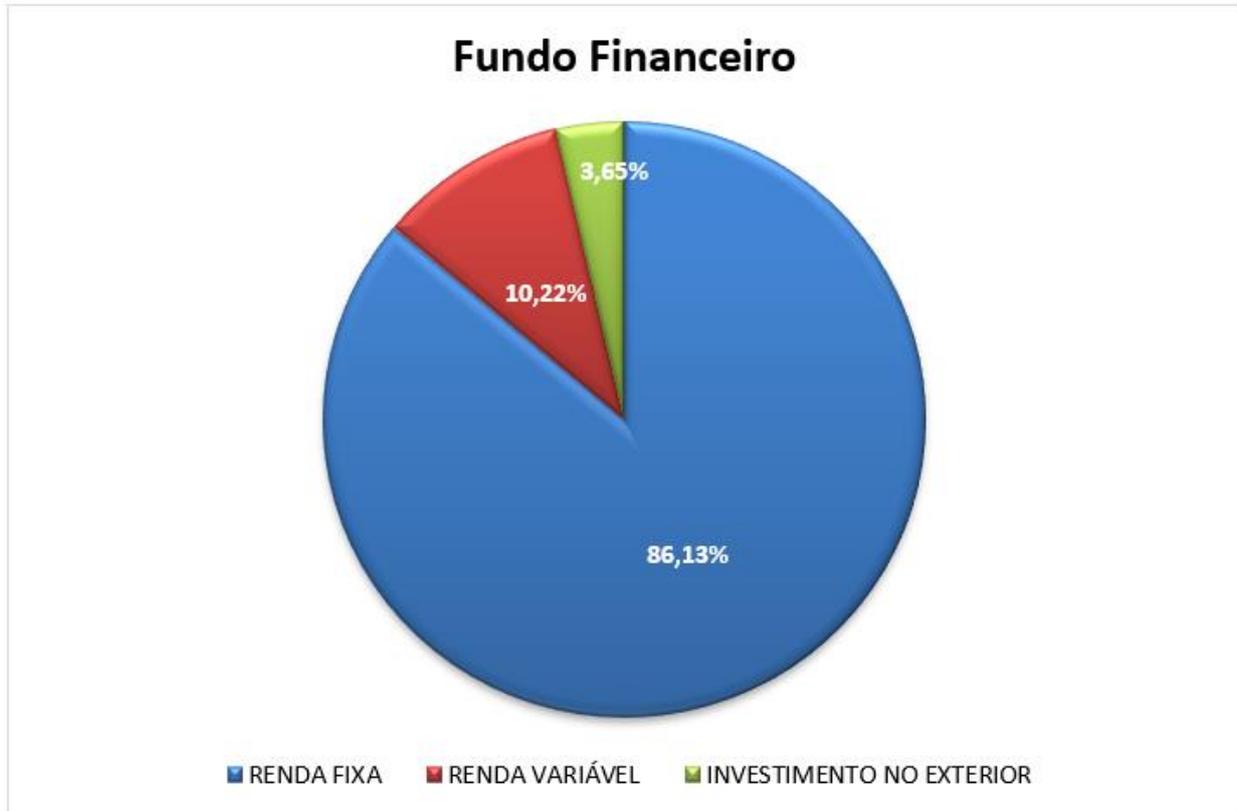
7. Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – agosto 2023

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%
JULHO	1.115.600.023,33	20.135.364,25	12.128.000,94	9.000,00	0,00	11.367.425,41	1.134.974.812,05	1,10%	0,55%
AGOSTO	1.134.974.812,05	185.056.224,35	169.738.143,42	384.173,15	6.512.987,81	1.897.048,27	1.145.301.330,29	0,77%	0,70%
TOTAL				863.020,51	18.797.282,32	78.126.879,35		8,43%	6,80%

Vê-se que no mês de agosto de 2023 a GuarujáPrev teve o retorno de 0,77% e a Meta Atuarial o percentual de 0,70%, alcançando a meta do mês. Ao longo do ano, a rentabilidade da carteira é de 8,43% perante uma Meta Atuarial de 6,80%.



8. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro



9. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Previdenciário



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

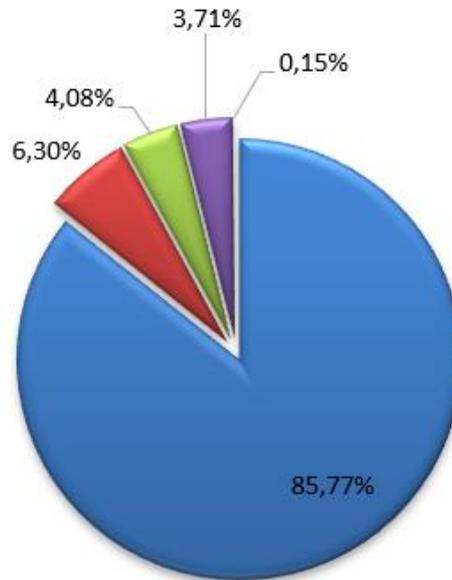
@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Fundo Previdenciário



RENDA FIXA

RENDA VARIÁVEL

INVESTIMENTO NO EXTERIOR

INVESTIMENTO ESTRUTURADO

FUNDOS IMOBILIÁRIOS



GUARUJÁPREV

Pró-Gestão

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

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

ATIVIDADE	JUNHO
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

Guarujá, 30 de outubro 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**