

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

SETEMBRO 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 SETEMBRO 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 – SETEMBRO DE 2023.....	5
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – SETEMBRO 2023	11
8. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO FINANCEIRO	12
9. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO– FUNDO PREVIDENCIÁRIO	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 setembro de 2023.

2. Cenário setembro de 2023

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

MERCADOS INTERNACIONAIS

No mês de agosto, no cenário internacional, os juros globais tiveram alta, especialmente os mais longos, seguindo a expectativa de que a atividade econômica mais resiliente nos EUA possa resultar em taxas de juros mais altas por mais tempo. Nos EUA, os dados mostram uma economia sólida, avançando além do esperado, sugerindo que a alta das taxas de juros até agora vem tendo efeito menos restritivo que o previsto. O mercado de trabalho segue aquecido, ainda que em trajetória de desaceleração. Esse ambiente aponta para uma chance menor de recessão. Ainda nos EUA, não houve alteração relevante nas expectativas para a política monetária. É provável que o FED tenha encerrado o ciclo de alta dos juros, com a taxa seguindo em 5,5%, ainda que um ajuste residual seja possível. Ao longo do ano de 2024, espera-se o início de um movimento de redução dos juros, que deve ocorrer de forma suave. Na zona do euro, os dados econômicos seguem demonstrando sinais de fraquezas no lado da atividade, mas ainda exibe uma inflação resiliente, com destaque para desaceleração mais forte do crédito e acomodação da expectativa de crescimento, entretanto, ainda apresenta um fraco desempenho na Alemanha. A China tem realizado esforços para conter a desaceleração do setor de construção civil, que apresenta graves problemas de excesso de oferta, falta de demanda e dificuldades financeiras das empresas. O desempenho do setor será fundamental para ditar os rumos da economia chinesa, com repercussões importantes nos mercados emergentes. Nesse ambiente, a China deverá continuar crescendo abaixo do potencial. Assim, no mês de agosto de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, acompanhando o movimento de alta das curvas de juros, o



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -2,96% e -1,77%, 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 +11,91% e +13,97%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +0,73% e +1,97%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +6,36% e +8,32% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, as curvas de juros tiveram alta, acompanhando o movimento do exterior. O mercado passou a refletir expectativas de queda de juros em um ritmo mais lento que o esperado. Assim, o Ibovespa teve retornos negativos, com queda mais acentuada que a das Bolsas globais. O PIB voltou a surpreender favoravelmente no segundo trimestre, superando as expectativas, com contribuição positiva dos setores industrial e de serviços, reforçando a percepção de uma economia resiliente. O setor agropecuário mostrou leve queda, após uma performance forte no primeiro trimestre, quando havia sido o principal fator impulsionando o crescimento naquele período. A inflação continua seguindo em uma direção mais construtiva. O núcleo do IPCA vem passando por desaceleração, com efeito benigno dos preços de bens, enquanto a inflação de serviços passa por descompressão mais gradual. Espera-se uma continuidade desse movimento nos próximos meses, ainda que num ritmo gradual. 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% e a sinalização de que este ritmo deverá ser mantido nas próximas reuniões. 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 11.09.2023, 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 5,42% 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 negativa, seguindo a direção dos índices globais. Apresentando um retorno negativo de -5,09% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +5,47% e de +5,68%



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050 

@guarujaprevidencia 

@guarujaprevidencia 

guarujaprevidencia.sp.gov.br 

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

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 diminuiu para 12,75% e durante o mês de setembro o IPCA foi de 0,35%.

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 ter mais cortes na reunião do Copom de outubro de 2023.



4. Análise do Relatório de Gestão de Risco

O Núcleo de Investimentos entregou o Relatório de Gestão de Risco do mês de setembro 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 20/09/2023 – 9ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos foram todas realizadas.

O Fundo PATRIA PE VII ADVISORY FIP MULTI-CLASSE C chamou capital a integralizar no valor de R\$ 2.236.670,25, deste valor, R\$ 105.000,00 refere-se à taxa do gestor que incide sobre o valor total subscrito, no caso R\$ 15.000.000,00. Esse valor é cobrado uma única vez. Este valor veio descrito no termo convocação de integralização. A Gerente de Planejamento, Orçamento, Contabilidade e Finanças informou o Comitê assim que soube da convocação.

6. Carteira de Investimentos – setembro de 2023.

RENDA FIXA 85,88%							
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	1,87	0,16	1,12	8,99	25.266.829,57	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,396600%)	3,92	0,04	0,67	2,14	1.006.567,87	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,37	0,04	0,73	8,56	33.890.700,78	2,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470100%)	3,87	0,04	0,67	0,71	402.127,20	0,03



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 150545 (5,480000%)	3,87	0,04	0,67	0,71	45.129,97	0
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,500000%)	3,88	0,04	0,68	0,82	5.668.443,82	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,600500%)	3,93	0,04	0,68	2,2	2.678.511,30	0,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	2,94	0,04	0,71	8,44	25.047.256,61	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,37	0,04	0,73	8,63	61.291.630,08	5,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,04	0,74	8,73	3.060.425,18	0,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,548000%)	3,87	0,04	0,68	1,9	5.584.733,87	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,595500%)	3,89	0,04	0,68	2,2	2.520.050,69	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	3,93	0,04	0,69	2,25	11.709.934,94	1,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,080000%)	2,96	0,04	0,72	3,81	4.985.628,19	0,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	3,28	0,04	0,72	8,53	58.241.353,75	5,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	3,01	0,04	0,73	4,34	23.202.367,97	2,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	3,02	0,04	0,73	4,73	5.422.629,38	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	11,86	0,04	0,73	8,63	39.971.601,60	3,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,325000%)	0,37	0,04	0,74	8,67	4.565.690,08	0,4
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	3,08	0,04	0,74	5,29	20.969.443,20	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,461000%)	4,17	0,04	0,1	0,1	853.243,48	0,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,600000%)	2,59	0,04	0,76	8,88	4.107.633,84	0,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,610000%)	4,18	0,04	0,76	0,92	3.275.867,66	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,620000%)	4,18	0,04	0,76	0,8	162.117,41	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,37	0,04	0,73	8,61	15.060.371,35	1,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,390000%)	3,89	0,04	0,67	0,84	1.332.197,76	0,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	9,7	0,04	0,73	8,58	44.356.425,47	3,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,520000%)	3,89	0,04	0,68	0,8	3.905.340,98	0,34



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 (5,797500%)	4,03	0,04	0,09	0,09	1.581.638,78	0,14	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	8,44	0,1	0,72	8,53	39.974.246,35	3,47	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	11,34	0,04	0,73	8,63	33.482.568,19	2,9	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,385000%)	3,08	0,04	0,74	5,3	22.468.730,21	1,95	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,427000%)	3,1	0,04	0,75	6,87	32.233.546,65	2,8	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		5,03	0,05	0,75	8,66	538.324.984,18	46,68	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Cartei ra	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,05	0,95	8,09	6.210.783,17	0,54	13.380.727.353,70	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,87	0,16	1,1	8,81	8.479.145,40	0,74	3.791.584.166,14	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	5,46	0,51	-1,21	10,9	1.875.923,78	0,16	952.566.946,89	0,2
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	5,47	0,51	-1,22	10,88	4.582.411,80	0,4	233.057.013,22	1,97
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,2	0,22	0,12	1,18	8.397.499,07	0,73	1.463.677.152,69	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,96	0,51	-0,96	-1,76	140.764.095,71	12,21	5.222.821.325,49	2,7
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,35	0,19	0,36	8,79	8.918.753,67	0,77	5.412.384.350,74	0,16
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,86	0,16	1,09	8,79	2.848.963,16	0,25	210.697.857,72	1,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,05	0,44	-0,66	9,18	182.077.575,76	15,79		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Cartei ra	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE	0,46	0,06	1,08	9,52	99.006.060,43	8,59	634.090.364,97	15,61



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

		INVESTIMENTO								
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5,14	0,06	0,21	1,96	10.760.356,89	0,93	229.043.752,42	4,7
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,13	0,21	-0,2	-0,2	19.959.354,53	1,73	877.465.492,31	2,27
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,9	9,12	1.577.080,14	0,14	3.380.807.738,12	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,04	0,9	8,77	895.042,11	0,08	861.359.920,43	0,1
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,05	7,35	46.581.619,30	4,04	8.906.699.435,49	0,52
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,86	0,17	0,42	9,32	85.516.923,13	7,42	2.836.954.249,95	3,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,16	0,1	0,8	8,77	264.296.436,53	22,92		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilib. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Cartei ra	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,88	0,18	0,56	9,22	5.636.506,47	0,49	307.061.696,92	1,84
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,88	0,18	0,56	9,22	5.636.506,47	0,49		
		Renda Fixa	2,53	0,14	0,5	8,72	990.335.502,94	85,88		

**RENDA VARIÁVEL
7,22%**

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilib. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Cartei ra	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	18,26	0,53	-1	6,85	11.201.779,89	0,97	1.281.232.542,36	0,87
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI FIA	19,99	0,58	0,62	2,66	37.783.899,79	3,28	1.378.543.679,32	2,74
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	19,86	0,98	1,19	-1,01	5.731.483,77	0,5	192.590.528,76	2,98
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO	19,91	0,67	0,19	1,26	7.805.791,84	0,68	138.506.257,17	5,64



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

		FIA								
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,5	0,59	0,79	2,14	10.199.833,12	0,88	774.960.951,78	1,32
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,38	1,41	-0,53	-1,58	947.483,03	0,08	260.783.503,19	0,36
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	18,09	1,05	-1,06	5,63	9.571.879,42	0,83	456.255.433,09	2,1
Sub-total Artigo 8º I			18,4	0,67	0,21	2,98	83.242.150,86	7,22		
Renda Variável			18,4	0,67	0,21	2,98	83.242.150,86	7,22		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 3,81%										
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	23,6	-0,27	-4,1	14,59	4.622.927,72	0,4	178.380.358,26	2,59
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	39,47	2,72	-3,03	17,47	3.902.029,81	0,34	107.698.562,46	3,62
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,81	2,4	-3,77	22,95	9.710.770,69	0,84	634.297.137,32	1,53
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	15,6	-0,17	-3,46	15,52	14.833.393,88	1,29	301.757.180,74	4,92
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	22,05	1,53	-2,96	2,95	10.884.687,06	0,94	288.512.148,38	3,77
Sub-total Artigo 9º II			18,64	1,05	-3,44	13,67	43.953.809,16	3,81		
Investimentos no Exterior			18,19	1,05	-3,44	13,67	43.953.809,16	3,81		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,7%										
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)										
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

ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	6,94	0,24	-0,07	13,42	2.176.775,05	0,19	304.104.012,39	0,72
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,18	-0,32	0,32	2,38	23.673.314,40	2,05	165.157.910,12	14,33
Sub-total Artigo 10º I			8,15	-0,27	0,28	6,24	25.850.089,45	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				
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	37,15	-3,26	-3,26	-3,26	2.163.859,10	0,19	183.802.266,19	1,18
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	18,58	-0,18	-0,18	7,72	3.146.896,88	0,27	95.823.010,30	3,28
Sub-total Artigo 10º II			13,53	-1,46	-1,46	6,34	5.310.755,98	0,46		
Investimentos Estruturados			7,56	-0,47	0,04	5,99	31.160.845,43	2,7		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,38%										
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	CXR11	20,52	-2,9	-2,25	38,04	1.223.400,00	0,11	144.843.948,62	0,84
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,6	-0,07	-0,07	103,14	3.213.476,52	0,28	314.249.684,12	1,02
Sub-total Artigo 11º			49,33	-0,87	-0,68	78,63	4.436.876,52	0,38		
Fundos Imobiliários			49,33	-0,87	-0,68	78,63	4.436.876,52	0,38		
Total			3,12	0,19	0,3	8,01	1.153.129.184,91	100		



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

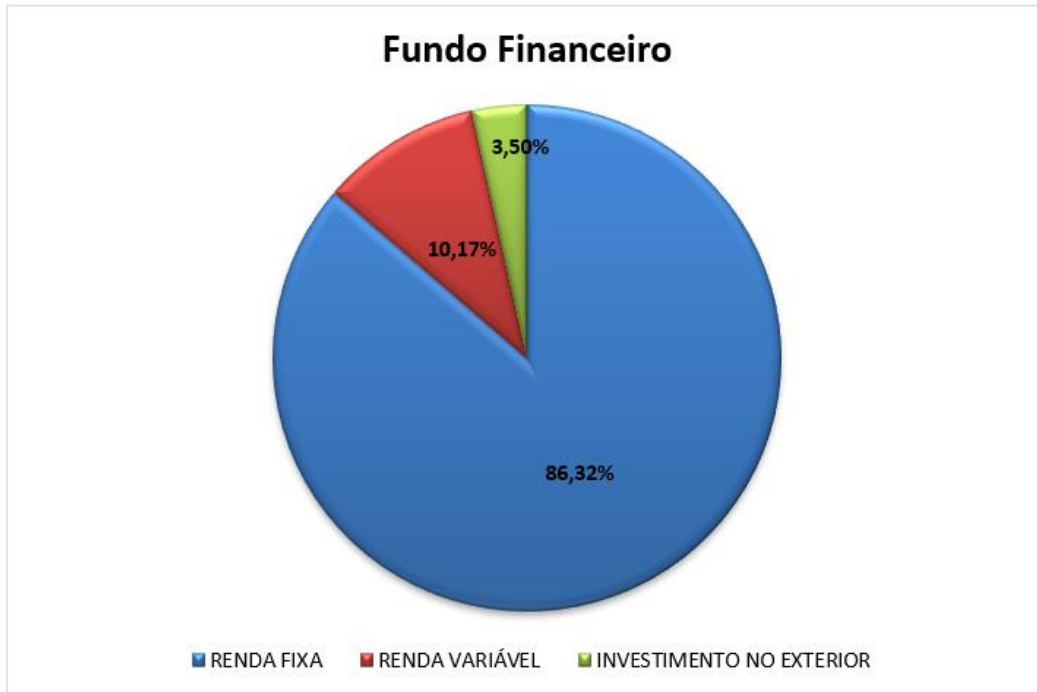
7. Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – setembro 2023

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	0,94%	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	1,01%	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%
SETEMBRO	1.145.301.330,29	48.894.921,26	44.432.146,65	0,00	8.550,00	3.365.080,03	1.153.129.184,93	0,29%	0,67%
TOTAL				863.020,51	18.805.832,32	81.491.959,38	-----	8,76%	7,51%

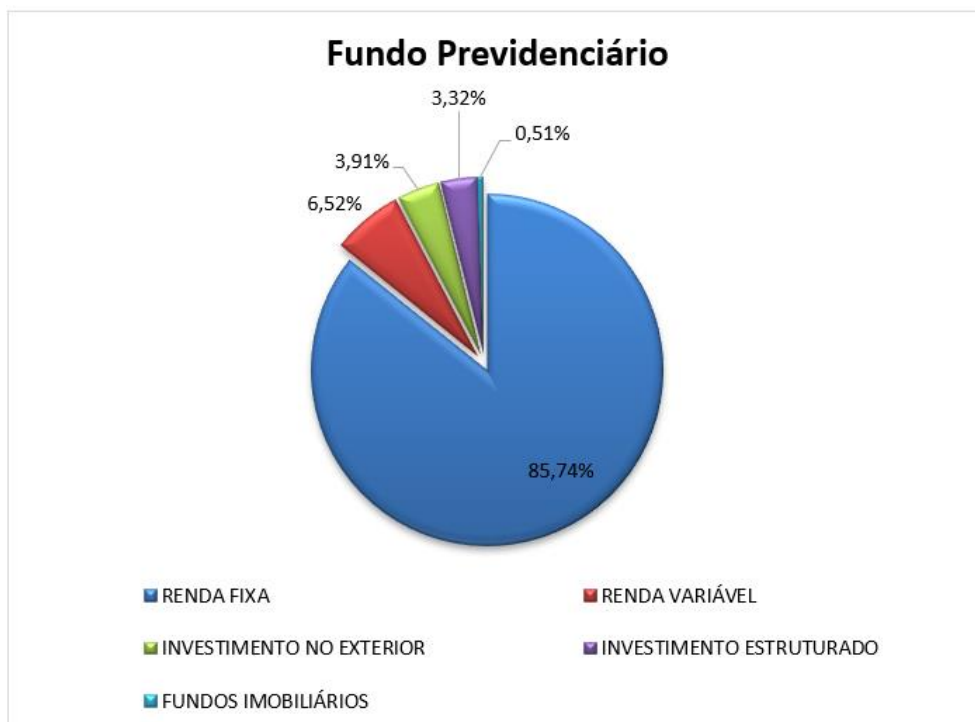
Vê-se que no mês de setembro de 2023 a GuarujáPrev teve o retorno de 0,29% e a Meta Atuarial o percentual de 0,67%, não alcançando a meta do mês. Ao longo do ano, a rentabilidade da carteira é de 8,76% perante uma Meta Atuarial de 7,51%.



8. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro



9. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Previdenciário





10. Carteira de Investimentos por segmento– Consolidado





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 setembro de 2023

ATIVIDADE	SETEMBRO
Propor, anualmente, a política de investimentos, bem como eventuais revisões, submetendo-as à Diretoria, para posterior encaminhamento e aprovação pelo Conselho Administrativo	Em andamento
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**