

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

MARÇO 2024



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 MARÇO DE 2024	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 – MARÇO DE 2024.....	5
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – MARÇO DE 2024.....	9
8. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO FINANCEIRO	10
9. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO– FUNDO PREVIDENCIÁRIO	11



1. Objetivo

Este relatório visa demonstrar as atividades mensais do Comitê de Investimentos relativo ao mês de março de 2024.

2. Cenário março de 2024

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

“ MERCADOS INTERNACIONAIS

No mês de fevereiro, continuando o movimento observado no mês anterior, houve uma alta de juros globais. Sendo este movimento originado pelas discussões sobre o início do ciclo de redução de juros norte-americanos e economia do país ainda aquecida. Nos EUA, a atividade segue em uma direção robusta, com o PIB forte e o mercado de trabalho ainda aquecido. Os dados recentes de inflação se mostraram mais pressionados que o esperado, sugerindo que a desinflação deve ocorrer de maneira mais lenta do que o previsto. Desta forma, houve uma diminuição da confiança no cenário de pouso suave da economia americana. A narrativa da diminuição de confiança no cenário de pouso suave ganhou força ao longo mês e impactou o discurso de alguns membros do FED, levando-os a uma postura mais conservadora. Assim, houve uma precificação na curva de juros americanos e conseqüentemente em novas discussão sobre a expectativa de quando se dará o início do movimento de redução dos juros. Desta forma, diversos diretores de bancos centrais dos países desenvolvidos sinalizaram cautela para que haja o início de um ciclo de afrouxamento monetário, sendo necessária maior confiança na convergência da inflação para a meta. Já na China, ainda permanece um cenário de cautela. Onde, apesar dos estímulos do governo, o setor imobiliário residencial mostra elevado nível de fragilidade. Adicionalmente, a queda nos preços aos consumidores, produtores e imóveis residenciais sugerem a possibilidade de intensificação das pressões deflacionárias e pode ter repercussões globais importantes. Assim, no mês de fevereiro de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +4,17% e +5,17%, 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 +21,03% e +28,36%,



respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +4,79% e +5,80%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +15,81% e +22,83% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, as curvas de juros futuras aumentaram no mês, acompanhando, mesmo que em menor intensidade, o movimento observado dos juros globais. Com relação aos dados fiscais, as notícias foram marginalmente positivas, devido a uma arrecadação acima das expectativas. A inflação continuou seguindo uma tendência positiva, com desaceleração e de melhora da sua composição. Entretanto, os resultados de curto prazo trouxeram uma inflação de serviços mais pressionada que o esperado, sendo este fator algo a ser observado. Além disso, em linha com o esperado pelo mercado, o PIB do 4º trimestre de 2023 ficou em território estável. Assim, se consolidou a dinâmica de moderação do crescimento. Na parte fiscal, ainda que os desafios de médio prazo persistam, a melhora na arrecadação no primeiro bimestre do ano afasta a necessidade de um grande contingenciamento em março, consequentemente minimiza a possibilidade de mudança da meta para o resultado primário de 2024. Dessa forma, não havendo motivo para movimentos relevantes no curto prazo, o cenário ratifica as expectativas de que o Banco Central continue o movimento de redução de juros. Assim, as expectativas ainda são da continuidade ritmo de cortes de juros adotado até o momento. 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 01.03.2024, e apresentada no item 3 deste relatório como “Taxa de Juros Real”, a taxa de juros real com vencimento para 10 anos apresentava taxa de retorno estimada em 5,66% a.a., continuando acima da taxa máxima pré-fixada de 5,10% limitada pela SPREV para o ano de 2024. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo na direção dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +0,99% no mês. Entretanto, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -3,85% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +22,96%. 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 NTNBS atualmente, a estratégia de compra direta de NTNBS, 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

Durante o mês de março, o principal índice da Bolsa Brasileira – Ibovespa – encerrou o mês com variação de -1%. A Meta Atuarial foi de 0,57% e a rentabilidade mensal da carteira da GuarujáPrev foi de 0,80%, atingindo assim, a Meta Atuarial.

Na 261ª Reunião do Copom realizada nos dias 19 e 20 de março de 2024, o Comitê decidiu reduzir a taxa básica de juros em 0,50 ponto percentual, para 10,75% a.a.. O FED, por sua vez, manteve a taxa de juros americana na faixa de 5,25% e 5,50% a.a. e previu 03 cortes durante o ano de 2024.

O Comitê continuará a observar as políticas de juros interna e externa e a verificar se as taxas continuam se abrindo, caso isso aconteça voltar-se-á a compra de Títulos a fim de atingir o ALM e segurar as taxas para o longuíssimo prazo com marcação na curva, diminuindo assim, a volatilidade da carteira.

Houve atraso na publicação deste relatório, pois estava esperando o sistema LDB arrumar as informações dos Fundos para então apresentar os dados.



4. Análise do Relatório de Gestão de Risco

O Núcleo de Investimentos entregou o Relatório de Gestão de Risco do mês de março de 2024.

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, demonstrou que todas as orientações de aplicações dadas por este Comitê foram realizadas no mês de abril.

6. Carteira de Investimentos – março de 2024.

POSIÇÃO DE ATIVOS E ENQUADRAMENTO							
RENDA FIXA 84,6%							
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	4,15	0,04	0,93	2,86	25.794.114,17	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,396600%)	2,81	0,03	0,97	2,99	1.031.269,94	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,45	0,04	1,03	3,17	34.790.810,39	2,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470100%)	2,79	0,03	0,98	3	412.562,98	0,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,480000%)	2,8	0,03	0,98	3,01	46.301,86	0
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,500000%)	2,8	0,03	0,98	3,01	5.815.828,33	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,600500%)	2,84	0,03	0,99	3,04	2.748.587,83	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	0,56	0,03	1,02	3,13	25.718.608,22	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,57	0,04	1,04	3,19	62.956.215,51	4,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,58	0,04	1,05	3,22	3.144.140,51	0,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,548000%)	2,81	0,03	0,98	3,02	5.734.342,80	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,595500%)	2,83	0,03	0,99	3,03	2.587.680,45	0,2
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	2,86	0,03	0,99	3,05	12.025.037,23	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,080000%)	0,65	0,03	1,02	3,15	5.121.617,10	0,4
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	0,65	0,04	1,03	3,16	59.832.520,60	4,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	0,65	0,04	1,03	3,18	23.837.667,42	1,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	0,65	0,04	1,04	3,18	5.571.192,64	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	0,66	0,04	1,04	3,19	41.067.953,41	3,22



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 (6,325000%)	0,66	0,04	1,04	3,21	4.691.108,84	0,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	0,66	0,04	1,05	3,22	21.546.221,04	1,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,461000%)	2,98	0,04	1,05	3,24	876.046,44	0,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,600000%)	0,27	0,04	1,06	3,27	4.219.999,25	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,610000%)	2,98	0,04	1,06	3,27	3.365.624,42	0,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,620000%)	2,98	0,04	1,06	3,28	166.566,81	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,37	0,04	1,04	3,19	15.458.967,21	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,390000%)	2,81	0,03	0,97	2,99	1.365.828,57	0,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	0,51	0,04	1,03	3,18	45.547.907,54	3,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,520000%)	2,83	0,03	0,98	3,02	4.008.817,39	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,797500%)	2,93	0,03	1	3,08	1.624.095,52	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,77	0,1	1,03	3,16	41.062.869,10	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	0,62	0,04	1,04	3,19	34.399.260,42	2,7
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,385000%)	0,63	0,04	1,05	3,22	23.086.601,97	1,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,427000%)	0,63	0,04	1,05	3,23	33.121.338,63	2,6
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,6	0,04	1,03	3,16	552.777.704,54	43,37

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				
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	5,18	0	-0,14	-0,14	15.063.531,21	1,18	286.627.961,42	5,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,04	0,79	2,55	6.546.965,11	0,51	13.231.140.496,66	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,9	0,04	0,92	2,78	8.656.067,91	0,68	3.885.045.033,34	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,08	0,04	0	0,25	1.907.406,00	0,15	1.001.832.564,15	0,19
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	4,09	0,04	0	0,25	4.656.450,66	0,37	236.822.555,91	1,97
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,69	0,08	0,75	2,01	8.816.261,49	0,69	1.549.129.506,23	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,88	0	0,06	0,13	147.575.406,11	11,58	5.029.824.301,86	2,93
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,21	0,02	0,5		4.541.588,96	0,36	2.457.483.202,76	0,18
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,9	0,04	0,91	2,77	2.906.499,44	0,23	214.953.010,34	1,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,92	0,01	0,15	0,45	200.670.176,89	15,74		

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	0,12	0,04	0,92	2,81	104.854.141,03	8,23	719.237.821,91	14,58
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	8,06	0,11	1,42	3,13	11.095.877,12	0,87	236.185.618,53	4,7
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,18	0	0,71	2,29	20.992.131,06	1,65	903.504.638,73	2,32
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,75	2,38	9.906.793,56	0,78	4.354.660.093,34	0,23



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	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,05	0,04	0,75	2,37	964.941,01	0,08	1.092.831.104,05	0,09
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	0,91	2,92	126.103.328,87	9,89	10.645.688.775,75	1,18
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,84	0,04	0,63	2,06	44.934.793,70	3,53	2.253.416.840,75	1,99
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,42	0,04	0,87	2,7	318.852.006,35	25,02		
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	1,28	0,06	0,77	2,39	5.924.768,73	0,46	311.881.894,95	1,9
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,28	0,06	0,77	2,39	5.924.768,73	0,46		
Renda Fixa			0,69	0,04	0,82	2,54	1.078.224.656,51	84,6		
RENDA VARIÁVEL 7,89%										
Artigo 8º I (Fundos de Ações)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VINCI	BEM	VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	13,49	0	1,28	2,71	8.727.543,92	0,68	122.919.369,41	7,1
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	13,79	0,07	1,06	-1,63	12.332.964,51	0,97	1.507.978.500,81	0,82
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,21	0,24	0,22	-0,8	42.283.343,14	3,32	1.424.304.935,88	2,97
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	15,67	-0,12	-1,71	-5,68	6.217.998,94	0,49	172.740.145,92	3,6
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	15,27	0,34	-0,9	-5,04	8.476.687,02	0,67	126.475.150,17	6,7
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	14,77	0,32	-1,5	-4,14	11.079.676,67	0,87	883.741.463,99	1,25
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,04	-0,03	0,83	-5,43	977.926,82	0,08	177.754.327,52	0,55
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	16,17	0,07	2,29	0,89	10.453.680,06	0,82	454.743.237,83	2,3
Sub-total Artigo 8º I			14,94	0,17	0,22	-1,81	100.549.821,08	7,89		
Renda Variável			14,94	0,17	0,22	-1,81	100.549.821,08	7,89		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 4,29%										
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	16,66	0,6	2,36	15,54	5.911.703,87	0,46	191.471.747,14	3,09
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	27,49	0,88	2,58	8,83	4.903.628,67	0,38	134.712.820,08	3,64
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,82	1,35	2,16	15,24	12.562.397,19	0,99	769.263.355,99	1,63
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	11,38	0,56	3,35	10,46	18.329.967,82	1,44	413.689.904,13	4,43



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,32	0,92	3,31	9,3	12.938.501,93	1,02	340.339.443,53	3,8
Sub-total Artigo 9º II			12,2	0,86	2,89	11,62	54.646.199,48	4,29		
Investimentos no Exterior			12,2	0,86	2,89	11,62	54.646.199,48	4,29		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,71%										
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	5,28	0,17	1,32	1,24	2.359.007,51	0,19	415.276.687,50	0,57
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7	0,25	-0,96	-3,24	25.520.387,81	2	178.044.107,12	14,33
Sub-total Artigo 10º I			6,53	0,24	-0,77	-2,87	27.879.395,32	2,19		
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	13,37	4,55	4,55	2,22	3.259.608,74	0,26	108.653.624,60	3
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	9,42	-0,18	-0,18	8,01	3.410.733,52	0,27	96.158.964,58	3,55
Sub-total Artigo 10º II			6,71	2,08	2,01	5,19	6.670.342,26	0,52		
Investimentos Estruturados			5,43	0,59	-0,26	-1,45	34.549.737,58	2,71		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,51%										
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	36,52	-21,33	-20,89	2,18	1.203.600,00	0,09	145.891.177,54	0,82
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,9	-0,1	-0,1	-9,48	5.329.665,18	0,42	654.137.410,24	0,81
Sub-total Artigo 11º			49,4	-4,83	-4,71	-7,49	6.533.265,18	0,51		
Fundos Imobiliários			49,4	-4,83	-4,71	-7,49	6.533.265,18	0,51		
Total			1,62	0,07	0,8	2,39	1.274.503.679,83	100		



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

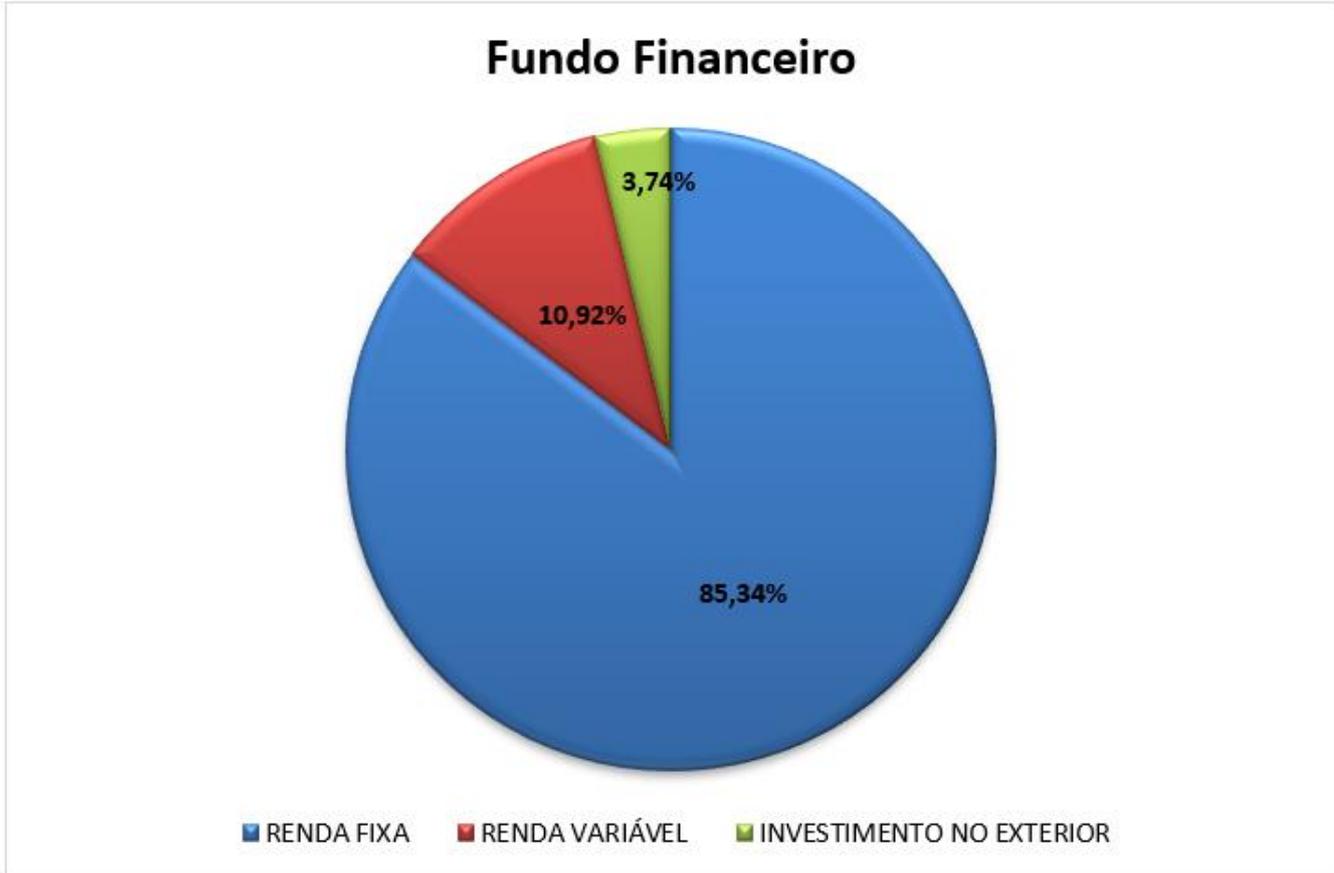
7. Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – março de 2024

MÊS	SALDO ANTERIOR (R\$)	APLICAÇÕES (R\$)	RESGATES (R\$)	AMORTIZAÇÃO (R\$)	JUROS (R\$)	RETORNO (R\$)	SALDO NO MÊS	RETORNO (%)	META (%)
JANEIRO	1.216.270.162,04	25.821.101,62	13.378.423,36	0,00	8.850,00	5.056.252,02	1.233.769.092,32	0,41%	0,87%
FEVEREIRO	1.233.769.092,32	29.053.374,13	13.054.093,16	425.868,62	6.964.319,21	14.435.809,26	1.256.822.694,72	1,16%	1,22%
MARÇO	1.256.822.694,72	27.950.853,57	20.356.071,51	0,00	8.700,00	10.086.203,05	1.274.503.679,83	0,80%	0,57%
TOTAL				425.868,62	6.981.869,21	29.578.264,33		2,39%	2,68%

Vê-se que no mês de fevereiro de 2024 a GuarujáPrev teve o retorno de 0,80% e a Meta Atuarial o percentual de 0,57%. Ao longo do ano a rentabilidade da carteira foi de 2,39% e a Meta Atuarial de 2,68%.

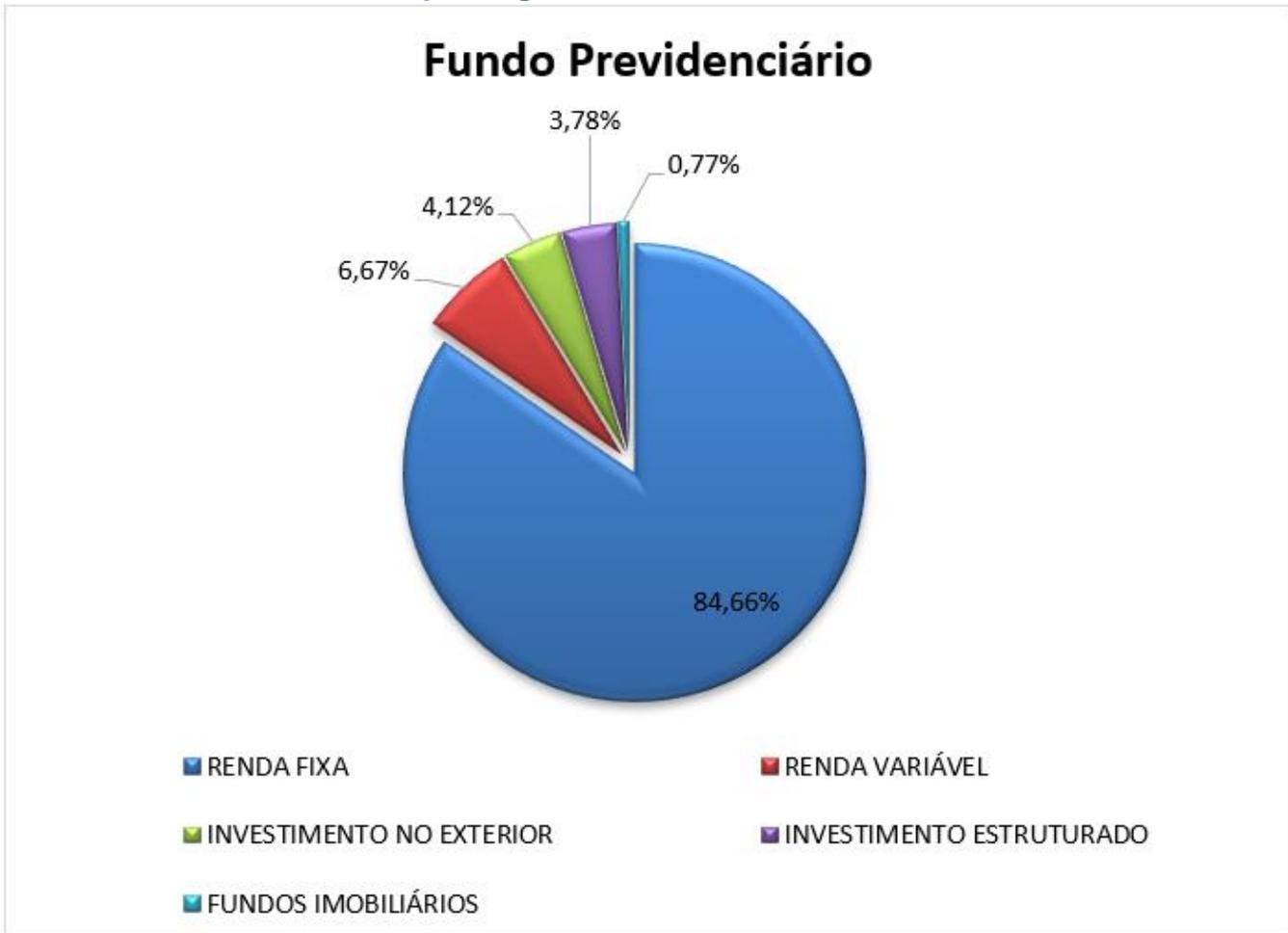


8. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro





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

Pró-Gestão

O quadro abaixo, relata as atividades do Comitê de Investimentos relacionadas com o Pró-Gestão de março de 2024

ATIVIDADE	JANEIRO
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, 13 de maio de 2024

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

(Assinado Digitalmente)
Zaqueu Elias da Silva Ferreira
Vice-Secretário 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)
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**