

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

OUTUBRO 2024



Comitê de Investimentos

SUMÁRIO

1. OBJETIVO	2
2. CENÁRIO OUTUBRO DE 2024.....	2
3. DESAFIOS PARA OS PRÓXIMOS MESES	4
4. ANÁLISE DO RELATÓRIO DE GESTÃO DE RISCO	4
5. DAS APLICAÇÕES ORIENTADAS PELO COMITÊ DE INVESTIMENTOS:	4
6. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – OUTUBRO DE 2024.....	5
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – OUTUBRO DE 2024	10
8. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO FINANCEIRO	11
9. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO.....	11
10. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – CONSOLIDADO.....	12

1. Objetivo

Este relatório visa demonstrar as atividades mensais do Comitê de Investimentos referentes ao mês de outubro de 2024.

2. Cenário outubro de 2024

MERCADOS INTERNACIONAIS

Em outubro, o cenário internacional apresentou um ambiente mais desafiador, apresentando uma reprecificação no ritmo de redução de juros americanos e consequente aumento da curva de juros, o que gerou um impacto negativo sobre os ativos de risco. Além disso, a eleição americana foi o tema de atenção no mercado.

Nos EUA, os dados de atividade seguem sólidos, com particular bom desempenho do consumo das famílias, demonstrando assim sinais de uma economia ainda aquecida. O que, por sua vez, gerou um aumento na curva de juros. Além disso, houve a reprecificação da expectativa do ritmo de redução de juros. Diante desse cenário, os membros do FED adotaram um tom mais cauteloso. Além disso, a diminuição da intensidade de corte de juros foi confirmada com a decisão de tomada no início de novembro, o qual foi promovido uma redução de 0,25%.

As eleições americanas trouxeram volatilidade aos mercados, à medida que as pesquisas mostraram um desempenho progressivamente melhor do candidato republicano. Dessa forma, aumentando a probabilidade do Executivo e Legislativo serem controlados pelo mesmo partido. Neste cenário, a adoção de políticas de tarifas protecionistas, aumento de tarifas comerciais, redução de impostos e restrição à imigração se torna mais provável.

Na Zona do Euro, o Banco Central cortou novamente a taxa de juros em 0,25% e destacou que as próximas decisões serão tomadas com base nas informações disponíveis em cada reunião. Por sua vez, os dados de inflação de serviços ainda permanecem em patamares elevados.

Na China, dados preliminares mostram alguma recuperação da atividade após os estímulos anunciados. Entretanto, ainda há a necessidade de incentivos fiscais para complementarem o pacote monetário anunciado em setembro.

Assim, no mês de outubro de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, renderam cerca de -2,29% e -0,99%, 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 +30,73% e +36,04%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, valorizaram +3,63% e +5,00%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +49,35 e +55,42% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, as curvas de juros apresentaram alta, refletindo parte do movimento observado no mercado internacional e principalmente o aumento do risco fiscal, o qual foi o tema de foco ao longo do mês, consequentemente o Ibovespa apresentou queda no mês.

Em relação à política fiscal, as discussões voltaram a se intensificar com questionamentos sobre a viabilidade futura do arcabouço fiscal. A deterioração do sentimento fiscal e seu impacto nos preços dos ativos levaram autoridades a mencionar um novo pacote de ajuste focado na contenção de gastos, ainda sem detalhes concretos. Dessa forma, até o anúncio deste pacote, os ativos domésticos estão sujeitos a especulações e flutuações dos mercados globais.

Os dados econômicos recentes indicam um bom crescimento, mas menos intenso do que antes. A taxa de desemprego caiu, apesar de salários mais fracos. A inflação piorou nos núcleos, com serviços e bens industriais subindo.

O câmbio, por sua vez, continua sendo preocupante em um cenário em que a política monetária norte-americana dificulta o desempenho das moedas em relação ao dólar e o real pressionado pela falta de confiança do mercado na política fiscal nacional.

Neste cenário, no início de novembro, conforme expectativas do mercado, o Copom acelerou o ritmo de aperto monetário com a elevação da taxa selic em 0,50%. Além disso, destacou o ambiente externo desafiador, a atividade econômica mais forte que o esperado e o risco fiscal.

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 01.11.2024, 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 6,81% 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 negativa, seguindo na mesma direção observada nos índices globais. Apresentando a performance de -1,60% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -3,33% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +14,64%.

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

O principal índice da Bolsa de Valores Brasileira, o Ibovespa, fechou o mês de setembro com uma variação negativa de 1,60%. A Meta Atuarial foi de 0,99% e a rentabilidade mensal da carteira da GuarujáPrev foi de 1,02%.

Com a aproximação do final do ano e com o objetivo de alcançar a meta em 2024, o Comitê optou por estratégias mais conservadoras na alocação dos recursos do mês. A decisão foi aplicar em fundos de Renda Fixa com referência no CDI, um padrão que deve manter-se nos meses subsequentes.

4. Análise do Relatório de Gestão de Risco

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

6. Carteira de Investimentos – outubro de 2024.

POSIÇÃO DE ATIVOS E ENQUADRAMENTO								
RENTA FIXA 80,19%								
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 150525 (5,970000%)	2,92	0,05	1,04	5,71	1.568.903,47	0,11	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,211000%)	2,93	0,05	1,06	5,4	21.881.364,48	1,56	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,080000%)	2,92	0,05	1,05	4,76	1.771.956,47	0,13	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,170000%)	2,92	0,05	1,06	5,38	20.468.995,27	1,46	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,242500%)	5,69	0,05	1,06	2,21	1.600.717,61	0,11	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,300000%)	4,13	0,05	1,07	2,06	1.537.910,70	0,11	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,420000%)	4,18	0,05	1,08	2,33	37.604.718,42	2,68	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,500000%)	2,95	0,05	1,09	3,24	4.590.334,20	0,33	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,34	0,05	1,06	9,39	15.913.726,97	1,13	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,396600%)	0,39	0,04	0,99	8,66	1.058.273,77	0,08	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,41	0,05	1,06	9,34	35.800.110,29	2,55	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,390000%)	0,44	0,04	0,99	8,65	1.402.110,64	0,1	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	0,48	0,05	1,06	9,36	46.867.740,25	3,34	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470100%)	0,51	0,04	1	8,72	423.731,27	0,03	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,480000%)	0,51	0,04	1	8,73	47.556,45	0	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,500000%)	0,51	0,05	1	8,75	5.973.710,88	0,43	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,600500%)	0,52	0,05	1,01	8,84	2.823.915,26	0,2	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,931500%)	4,07	0,05	1,04	1,98	6.923.918,65	0,49	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	0,54	0,05	1,05	9,2	26.450.124,51	1,88	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,060000%)	2,93	0,05	1,05	5,32	47.000.920,78	3,35	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,105000%)	4,15	0,05	1,05	2,33	10.719.907,03	0,76	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,131000%)	4,16	0,05	1,06	1,88	18.721.573,32	1,33	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,142000%)	5,06	0,05	1,06	7,87	6.622.979,71	0,47	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,55	0,05	1,07	9,41	64.784.157,90	4,61	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,381000%)	4,28	0,05	1,08	3,2	16.947.059,24	1,21	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,55	0,05	1,08	9,53	3.236.476,73	0,23	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,520000%)	0,56	0,05	1	8,76	4.118.633,92	0,29	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,797500%)	0,57	0,05	1,03	9,01	1.669.572,90	0,12	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,75	0,11	1,06	9,3	42.241.872,15	3,01	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	0,6	0,05	1,07	9,42	35.396.466,34	2,52	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,385000%)	0,6	0,05	1,08	9,52	23.761.189,84	1,69	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,427000%)	0,6	0,05	1,08	9,55	34.091.922,18	2,43	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,548000%)	0,6	0,05	1	8,79	5.892.479,82	0,42	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,595500%)	0,6	0,05	1,01	8,83	2.659.281,07	0,19	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	0,6	0,05	1,02	8,9	12.359.488,07	0,88	



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 (6,080000%)	0,62	0,05	1,05	9,25	5.267.969,91	0,37			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	0,62	0,05	1,06	9,3	61.548.250,50	4,38			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	0,63	0,05	1,06	9,37	24.524.391,60	1,75			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	0,63	0,05	1,06	9,38	5.731.890,68	0,41			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	0,63	0,05	1,07	9,42	42.255.430,33	3,01			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,325000%)	0,63	0,05	1,07	9,47	4.827.201,28	0,34			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	0,63	0,05	1,08	9,51	22.173.059,39	1,58			
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,76	0,05	1,06	9,95	731.261.994,25	52,05			
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	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	3,7	0,02	-0,5	0,56	4.542.094,73	0,32	231.006.525,51	1,97
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,69	0,02	-0,5	0,58	1.858.983,52	0,13	1.019.002.515,34	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,1	0,04	0,95	8,79	6.945.351,56	0,49	11.268.222.308,52	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,03	0,03	0,64	3,72	151.057,06	0,01	16.830.769.133,26	0
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	5,91	-0,2	-0,8	-2,3	14.742.412,25	1,05	224.664.434,54	6,56
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,61	0,02	0,72	5,92	9.154.166,20	0,65	1.565.421.659,02	0,58
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,08	-0,1	-0	1,81	37.394.065,32	2,66		
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				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,04	0,85	8,1	1.827.162,30	0,13	4.036.357.184,84	0,05
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,1	0,04	0,93	9,68	172.614.362,61	12,29	15.416.999.740,59	1,12
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,26	0,04	0,76	6,44	21.842.034,44	1,55	371.906.331,41	5,87
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,04	0,04	0,84	8,06	445.480,10	0,03	1.224.652.546,18	0,04
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,61	0,05	0,93	9,03	48.002.586,05	3,42	2.137.392.859,66	2,25
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	9,29	0,03	1,88	10,5	11.887.743,09	0,85	253.041.188,17	4,7
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,04	0,92	1	3.847.056,02	0,27	3.555.599.377,38	0,11
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,07	0,05	0,94	9,55	91.285.018,79	6,5	674.062.219,88	13,54
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,37	0,04	0,95	9,28	351.751.443,40	25,04		
Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)										



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				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,53	0,01	0,32	5,67	6.114.833,53	0,44	210.982.426,16	2,9
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			2,53	0,01	0,32	5,67	6.114.833,53	0,44		
Renda Fixa			0,61	0,05	0,99	8,71	1.126.522.336,50	80,19		
RENTA VARIÁVEL 6,06%										
Artigo 8º I (Fundos de Ações)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	12,78	-0,1	0,13	0,81	10.445.722,05	0,74	401.576.805,70	2,6
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	13,38	-0,6	-0,4	-4,8	6.277.491,68	0,45	159.536.984,77	3,93
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	13,87	-0,9	-1,3	-10	38.382.919,75	2,73	973.064.809,21	3,94
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	12,51	-0,4	-1,4	-5,5	5.793.707,01	0,41	1.242.883.390,90	0,47
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	12,11	-0,6	-1,8	-4,7	3.723.562,41	0,27	96.493.263,21	3,86
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	14,61	-0,5	-2,1	-12	912.460,14	0,06	85.449.898,34	1,07
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	11,14	-0,8	-1,5	-5,9	10.877.733,05	0,77	769.284.212,45	1,41
VINCI	BEM	VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	11,15	-0,7	-1,4	3,24	8.772.746,21	0,62	129.150.351,74	6,79
Sub-total Artigo 8º I			12,23	-0,7	-1,3	-6,3	85.186.342,30	6,06		
Renda Variável			12,23	-0,7	-1,3	-6,3	85.186.342,30	6,06		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 7,24%										
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	18,05	0,2	6,75	45,1	7.426.193,09	0,53	189.968.769,51	3,91
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	26,27	-1,3	12,2	39,3	6.278.680,00	0,45	138.994.582,89	4,52
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,68	-2,4	6,62	44,6	15.764.485,28	1,12	825.916.041,18	1,91
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA	11,85	0,17	-0,1	22,4	20.314.753,64	1,45	513.196.994,84	3,96



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Ademar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio

Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

SCHRODER	INTRAG	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	15,28	-1,4	2,17	30,5	15.444.229,23	1,1	368.225.833,40	4,19
Sub-total Artigo 9º II			12,74	-1	3,89	33,2	65.228.341,24	4,64		
Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	16	-1,3	6,42	25,3	36.457.505,93	2,6	1.887.417.257,23	1,93
Sub-total Artigo 9º III			16	-1,3	6,42	25,3	36.457.505,93	2,6		
Investimentos no Exterior			12,84	-1,1	4,78	33,8	101.685.847,17	7,24		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 6,04%										
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	-0,1	0,57	6,13	2.473.084,73	0,18	443.407.585,42	0,56
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	10,03	-0,6	-0,4	5,39	25.293.794,53	1,8	288.973.097,72	8,75
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II FIF MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	3,9	-0,7	-0,9	-0,7	9.619.273,74	0,68	141.098.930,04	6,82
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	12,12	-1,8	-0,3	8,23	38.568.355,03	2,75	572.667.773,13	6,73
		Sub-total Artigo 10º I	9,01	-1,2	-0,4	0,63	75.954.508,03	5,41		
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	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA	46,69	-16	-16	-43	200.895,48	0,01	15.994.176,56	1,26
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	69,49	-0,2	-0,2	14,1	2.541.003,89	0,18	76.507.874,15	3,32
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	14,79	0,27	0,27	7,88	6.226.112,09	0,44	290.999.588,76	2,14
Sub-total Artigo 10º II			31,29	-0,3	-0,3	14,4	8.968.011,46	0,64		
Investimentos Estruturados			8,86	-1,1	-0,4	4,51	84.922.519,49	6,04		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,47%										
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)										



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

Av. Adhemar de Barros, 230 - Bairro Santo Antônio

Guarujá/SP - CEP 11430 - 000

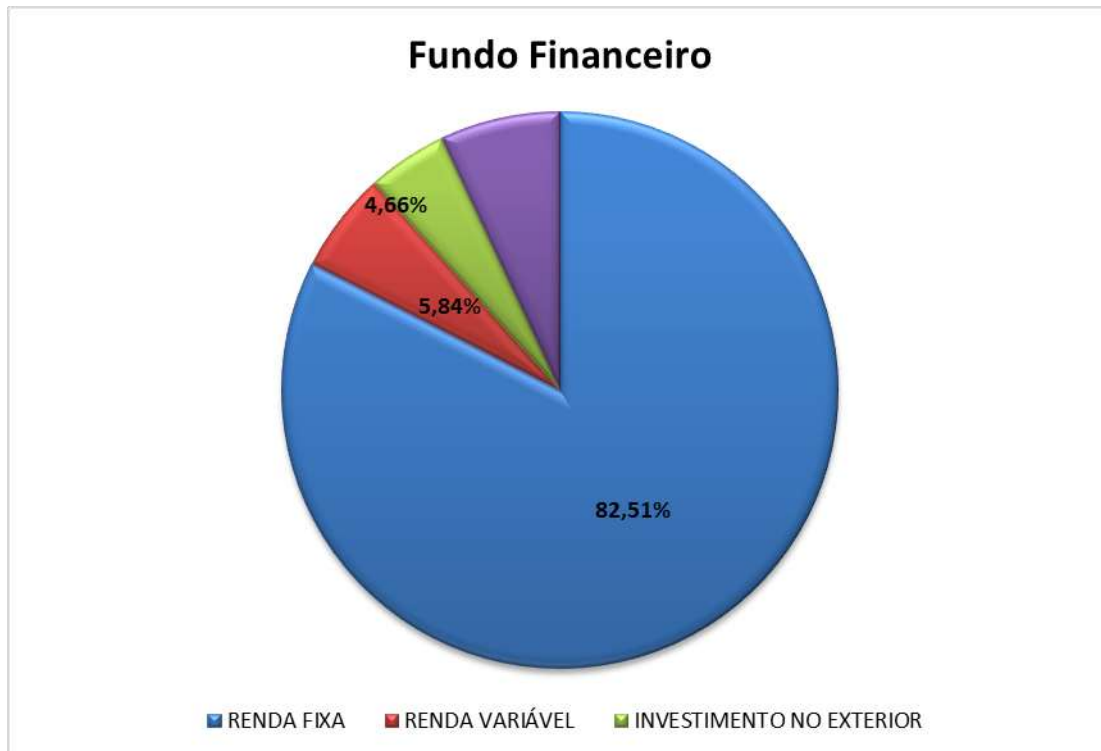
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	CEF	CXRI11	32,92	-7,4	-6,7	0,55	1.125.000,00	0,08	129.223.138,22	0,87
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,18	2,52	2,52	-7,3	5.458.526,75	0,39	652.863.701,14	0,84
Sub-total Artigo 11º			48,63	0,67	0,81	-5,9	6.583.526,75	0,47		
Fundos Imobiliários			48,63	0,67	0,81	-5,9	6.583.526,75	0,47		
Total			1,6	-0,2	1,02	8,64	1.404.900.572,21	100		

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

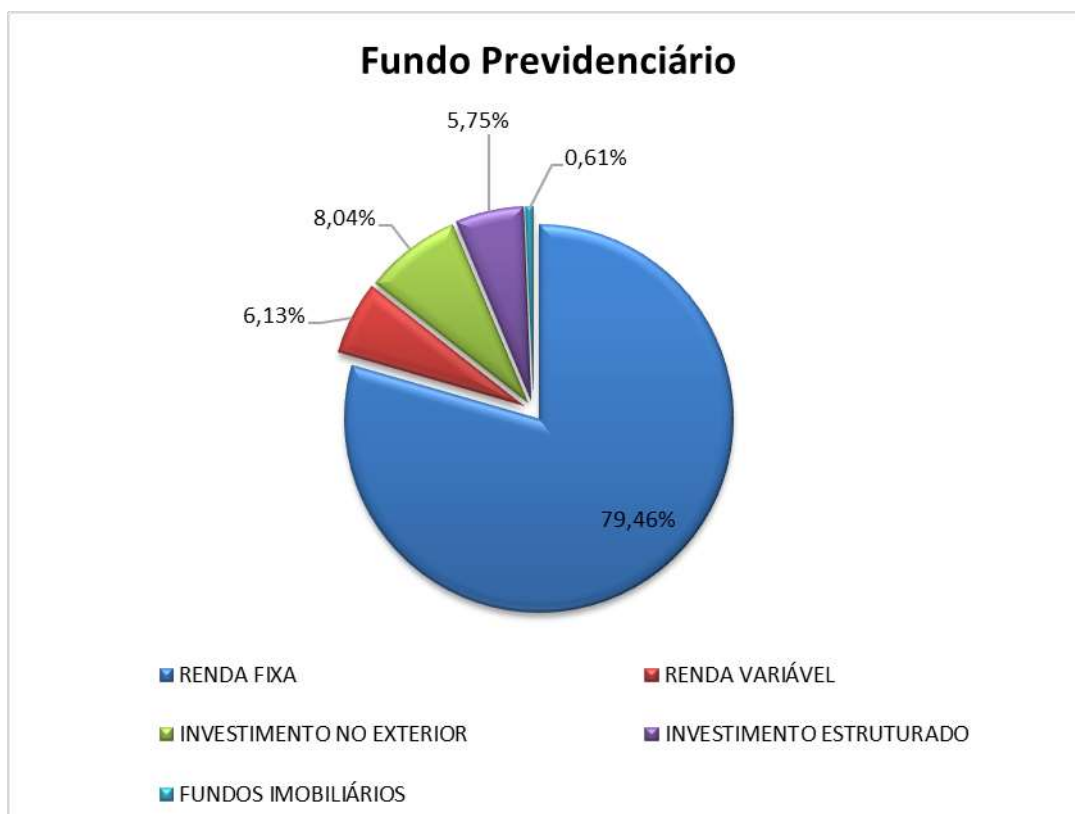
MÊS	SALDO ANTERIOR (R\$)	APLICAÇÕES (R\$)	RESGATES (R\$)	AMORTIZAÇÃO (R\$)	JUROS (R\$)	RETORNO (R\$)	SALDO NO MÊS	RETORNO (%)	META (%)
JANEIRO	1.216.270.162,04	25.821.101,62	13.378.423,36	0,00	8.850,00	5.056.252,02	1.233.769.092,32	0,41%	0,87%
FEVEREIRO	1.233.769.092,32	29.053.374,13	13.054.093,16	425.868,62	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%
ABRIL	1.274.503.679,83	148.147.438,35	139.552.914,97	0,00	8.700,00	-2.260.036,65	1.280.838.166,56	-0,17%	0,83%
MAIO	1.280.838.166,56	32.536.832,40	12.276.715,70	0,00	11.582.468,21	7.816.839,67	1.297.341.504,72	0,62%	0,89%
JUNHO	1.297.341.504,72	62.728.062,60	56.045.037,17	0,00	8.850,00	14.425.150,53	1.318.449.680,68	1,11%	0,62%
JULHO	1.318.449.680,68	35.782.257,39	23.420.491,21	0,00	8.850,00	16.098.682,97	1.346.910.129,83	1,21%	0,85%
AGOSTO	1.346.910.129,83	306.219.975,03	288.706.957,72	1.994.820,54	6.931.009,17	21.327.966,36	1.376.835.380,83	1,83%	0,43%
SETEMBRO	1.376.835.380,83	19.342.709,21	15.373.078,38	1.621,24	10.309,75	4.595.529,11	1.385.398.919,53	0,33%	0,87%
OUTUBRO	1.385.398.919,53	83.585.861,83	78.065.437,56	1.648,21	10.305,53	14.215.758,31	1.405.133.453,90	1,02%	0,99%
TOTAL				2.423.958,61	25.542.361,87	105.798.154,63		8,64%	8,43%

No mês de outubro de 2024 a GuarujáPrev teve o retorno de 1,02% e a Meta Atuarial o percentual de 0,99%. Ao longo do ano a rentabilidade da carteira foi de 8,64% e a Meta Atuarial de 8,43%.

8. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro



9. Carteira de Investimentos por segmento– Fundo Previdenciário



10. Carteira de Investimentos por segmento– Consolidado



Pró-Gestão

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

ATIVIDADE	OUTUBRO
Propor, anualmente, a política de investimentos, bem como eventuais revisões, submetendo-as à Diretoria, para posterior encaminhamento e aprovação pelo Conselho Administrativo	Realizado
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, 28 de novembro de 2024

(Assinado Digitalmente)
Fernando A. G. de Melo
Gestor do Comitê de Investimentos
Responsável Técnico

(Assinado Digitalmente)
Liliane da Silva e Silva
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

(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