



GUARUJÁ PREVIDÊNCIA

Apresentação Carteira de Investimentos
2022 e 1º Trimestre de 2023

INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

2022 E 1º TRIMESTRE DE 2022

POR GESTOR – SEM TÍTULO PÚBLICO



GUARUJÁPREV

GESTOR	VALOR 2022 (R\$)	% 2022	% CATEIRA TOTAL 2022	VALOR 1º TRIM 2023(R\$)	% 1º TRIM 2023	% CATEIRA TOTAL 1º TRIM 2023
CEF	152.034.495,47	23,80%	14,73%	R\$ 163.563.623,88	27,55%	15,84%
Itaú/Unibanco	128.122.885,51	20,06%	12,41%	R\$ 103.002.612,40	17,35%	9,98%
Icatu	58.565.432,87	9,17%	5,67%	R\$ 33.166.958,10	5,59%	3,21%
Western	50.837.586,10	7,96%	4,92%	R\$ 111.435.914,51	18,77%	10,79%
XP Gestão	46.984.261,46	7,36%	4,55%	R\$ 9.103.673,20	1,53%	0,88%
BTG Pactual	45.044.947,01	7,05%	4,36%	R\$ 37.235.565,50	6,27%	3,61%
Az Quest	29.025.405,13	4,54%	2,81%	R\$ 8.564.872,81	1,44%	0,83%
Rio Bravo	24.068.108,57	3,77%	2,33%	R\$ 24.633.769,89	4,15%	2,39%
Safra	20.643.858,94	3,23%	2,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Banco do Brasil	13.245.537,06	2,07%	1,28%	R\$ 13.245.543,91	2,23%	1,28%
Santander	12.840.582,69	2,01%	1,24%	R\$ 14.052.743,59	2,37%	1,36%
Schroder	10.573.141,48	1,66%	1,02%	R\$ 10.889.428,20	1,83%	1,05%
Constância	10.483.676,32	1,64%	1,02%	R\$ 9.926.517,96	1,67%	0,96%
Occam	9.986.203,49	1,56%	0,97%	R\$ 9.331.916,74	1,57%	0,90%
Daycoval	7.709.019,43	1,21%	0,75%	R\$ 7.115.906,05	1,20%	0,69%
Bahia/XP	5.789.782,29	0,91%	0,56%	R\$ 5.289.725,24	0,89%	0,51%
BNP PARIBAS	4.034.397,20	0,63%	0,39%	R\$ 4.408.079,35	0,74%	0,43%
Bradesco	3.831.544,23	0,60%	0,37%	R\$ 21.874.918,87	3,68%	2,12%
Genial	3.321.830,06	0,52%	0,32%	R\$ 3.679.343,94	0,62%	0,36%
Legatus	1.581.904,81	0,25%	0,15%	R\$ 3.233.805,22	0,54%	0,31%
TOTAL	638.724.600,12	100,00%	61,87%	R\$ 593.754.919,36	100,00%	57,52%



2022

CUSTÓDIA	VALOR (R\$)	%	% Carteira Total
XP Custódia	196.651.809,56	56,23%	19,89%
BTG Custódia	153.079.680,16	43,77%	15,49%
Total	349.731.489,72	100,00%	35,38%

1º Trimestre de 2023

CUSTÓDIA	VALOR (R\$)	%	% Carteira Total
XP Custódia	277.914.059,07	63,37%	26,92%
BTG Custódia	160.669.406,96	36,63%	15,56%
Total	438.583.466,03	100,00%	42,48%

INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

2022 e 1º Trimestre de 2023

DISTRIBUIÇÃO – FUNDOS DE INVESTIMENTOS E TÍTULOS PÚBLICOS

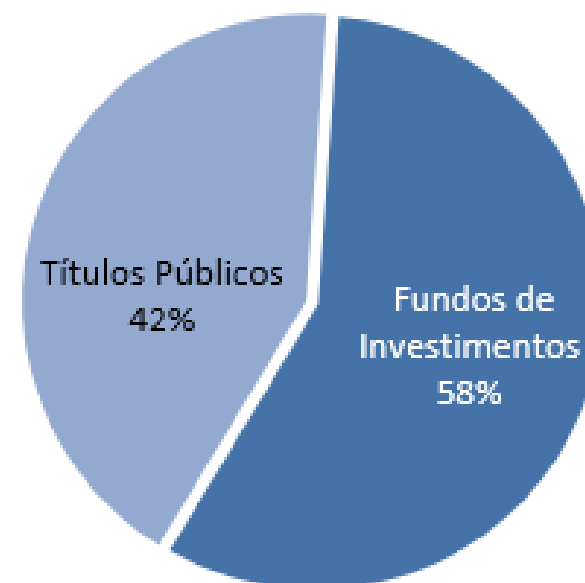


GUARUJÁPREV

Distribuição Carteira GuarujáPRev - Fundos de Investimentos e Títulos Públicos 2022



Distribuição Carteira GuarujáPRev - Fundos de Investimentos e Títulos Públicos 1º Trimestre de 2023



INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

1º TRIMESTRE DE 2023

INDICADOR - BENCHMARK

BENCHMARK	VALOR 2022 (R\$)	2022 %	VALOR 1º TRIM 2023 (R\$)	1º TRIM 2023 %
NTN-B 2024	5.358.488,43	0,54%	5.404.821,79	0,52%
NTN-B 2030	14.708.628,39	1,49%	14.818.884,74	1,44%
NTN-B 2035	32.152.713,46	3,25%	33.358.201,71	3,23%
NTN-B 2040	43.349.518,86	4,39%	43.662.068,44	4,23%
NTN-B 2045	84.824.492,62	8,58%	88.008.062,64	8,53%
NTN-B 2050	71.808.620,68	7,26%	126.160.482,02	12,22%
NTN-B 2055	97.529.027,28	9,87%	127.170.944,69	12,32%
CDI	157.878.540,71	15,97%	250.957.280,15	24,31%
AÇÕES LIVRES	111.671.391,64	11,30%	105.534.472,88	10,22%
IRF-M	104.000.518,96	10,52%	108.031.533,96	10,46%
MULTIMERCADO	51.005.625,02	5,16%	25.702.420,99	2,49%
AÇÕES SETORIAIS	49.461.126,72	5,00%	8.564.872,81	0,83%
IMA-B	40.474.833,64	4,09%	15.237.078,33	1,48%
IPCA	39.085.960,31	3,95%	0,00	0,00%
IDKA 2A	33.270.740,00	3,37%	34.724.247,65	3,36%
ISE	10.573.141,48	1,07%	10.889.428,20	1,05%
IMA-B5	9.481.365,25	0,96%	0,00	0,00%
IBOVESPA	7.709.019,43	0,78%	7.115.906,05	0,69%
IMA-B5+	6.147.209,64	0,62%	6.229.605,90	0,60%
CRÉDITO PRIVADO	5.160.528,53	0,52%	5.378.340,79	0,52%
FIP	4.503.371,53	0,46%	3.130.853,14	0,30%
RUSSEL 1000	4.034.397,20	0,41%	4.408.079,35	0,43%
GROWTH	3.321.830,06	0,34%	3.679.343,94	0,36%
FUNDO IMOBILIÁRIO	945.000,00	0,10%	4.171.455,22	0,40%
AÇÕES INDEXADO	0,00	0,00%	0,00	0,00%
BDR	0,00	0,00%	0,00	0,00%
IDKA 5A	0,00	0,00%	0,00	0,00%
IMA-GERAL	0,00	0,00%	0,00	0,00%
TOTAL	988.456.089,84	100,00%	1.032.338.385,39	100,00%



GUARUJÁPREV

INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

RETORNO E META

MÊS	SALDO ANTERIOR (R\$)	APLICAÇÕES (R\$)	RESGATES (R\$)	AMORTIZAÇÃO (R\$)	JUROS (R\$)	RETORNO (R\$)	SALDO NO MÊS	RETORNO (%)	META (%)
JANEIRO	875.501.350,93	19.991.781,89	8.963.212,66	0,00	8.250,00	-9.768.897,70	876.761.022,46	-1,13	0,94
FEVEREIRO	876.761.022,46	15.160.850,26	7.910.943,63	0,00	352.305,95	-4.024.703,50	879.633.919,64	-0,44	1,38
MARÇO	879.633.919,64	70.624.998,53	63.240.165,19	0,00	7.650,00	22.017.854,31	909.036.607,29	2,46	2,05
ABRIL	909.036.607,29	46.311.381,65	39.246.919,68	0,00	7.650,00	-15.821.058,35	900.280.010,91	-1,72	1,43
MAIO	900.280.010,91	178.215.600,77	170.647.992,70	0,00	7.950,00	4.218.450,33	912.066.069,31	0,48	0,89
JUNHO	912.066.069,31	105.020.783,47	98.986.965,53	0,00	8.250,00	-16.993.180,10	901.106.707,15	-1,85	1,07
JULHO	901.106.707,15	540.449.428,05	532.758.947,53	0,00	9.600,00	15.200.490,42	923.997.678,09	1,70	-0,28
AGOSTO	923.997.678,09	267.420.574,96	253.389.028,73	506.676,53	6.275.974,24	10.851.691,56	946.413.070,78	1,50	0,08
SETEMBRO	946.413.070,77	35.833.536,28	28.034.740,22	0,00	8.250,00	1.096.686,73	955.308.553,56	0,12	0,11
OUTUBRO	955.308.553,56	57.103.198,52	48.707.225,44	361.247,95	8.250,00	21.723.572,58	985.066.851,27	2,21	0,97
NOVEMBRO	985.066.851,27	23.338.649,18	13.478.391,17	0,00	5.615.517,59	-19.942.132,15	974.984.977,13	-1,41	0,79
DEZEMBRO	974.984.977,13	48.788.917,30	36.425.594,56	243.955,13	8.250,00	1.351.745,10	988.456.089,84	0,,11	1,04
TOTAL RETORNO				1.111.879,61	12.317.897,78	9.910.519,23		1,92	10,97

A carteira da GuarujáPrev em 2022 teve rentabilidade de **R\$ 23.340.296,62**, representando **1,92%** da carteira, abaixo da Meta Atuarial de **10,97%**.

A Meta Atuarial é calculada pelo **IPCA + 4,92%**.

O IPCA de 2022 foi **5,79%**, o que somado ao percentual de **4,92%** dá o resultado de **10,97%**.



GUARUJÁPREV

INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

1º TRIMESTRE DE 2023

RETORNO E META



GUARUJÁPREV

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	0,00	8.400,00	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	0,02%	1,21%
MARÇO	1.029.705.535,15	134.134.699,30	141.254.436,99	0,00	8.400,00	9.752.587,93	1.032.338.385,39	0,95%	1,18%
TOTAL RETORNO				427.847,36	4.051.225,11	23.208.109,82		2,75%	3,40%

A meta atuarial anual de 2023 é **IPCA + 5,23%** e a mensal é **IPCA + 0,4257%** (arredondado).

$$\text{Retorno (\%)} = \frac{(\text{Amortização (R\$)} + \text{Juros (R\$)} + \text{Retorno (R\$)})}{(\text{Saldo Anterior (R\$)} + \text{Aplicações (R\$)} - \text{Resgates (R\$)})}$$

O IPCA de março de 2023 foi de 0,71%. O IPCA somado ao rendimento de juros real estipulado (0,4257%) resultou em meta estimada de 1,18%.

Durante o mês de março de 2023 foi obtida a rentabilidade de **0,95%**. No ano de 2023 a meta atuarial acumulada é de **3,40%** e o retorno acumulado, até o presente, é de **2,75%**.

INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

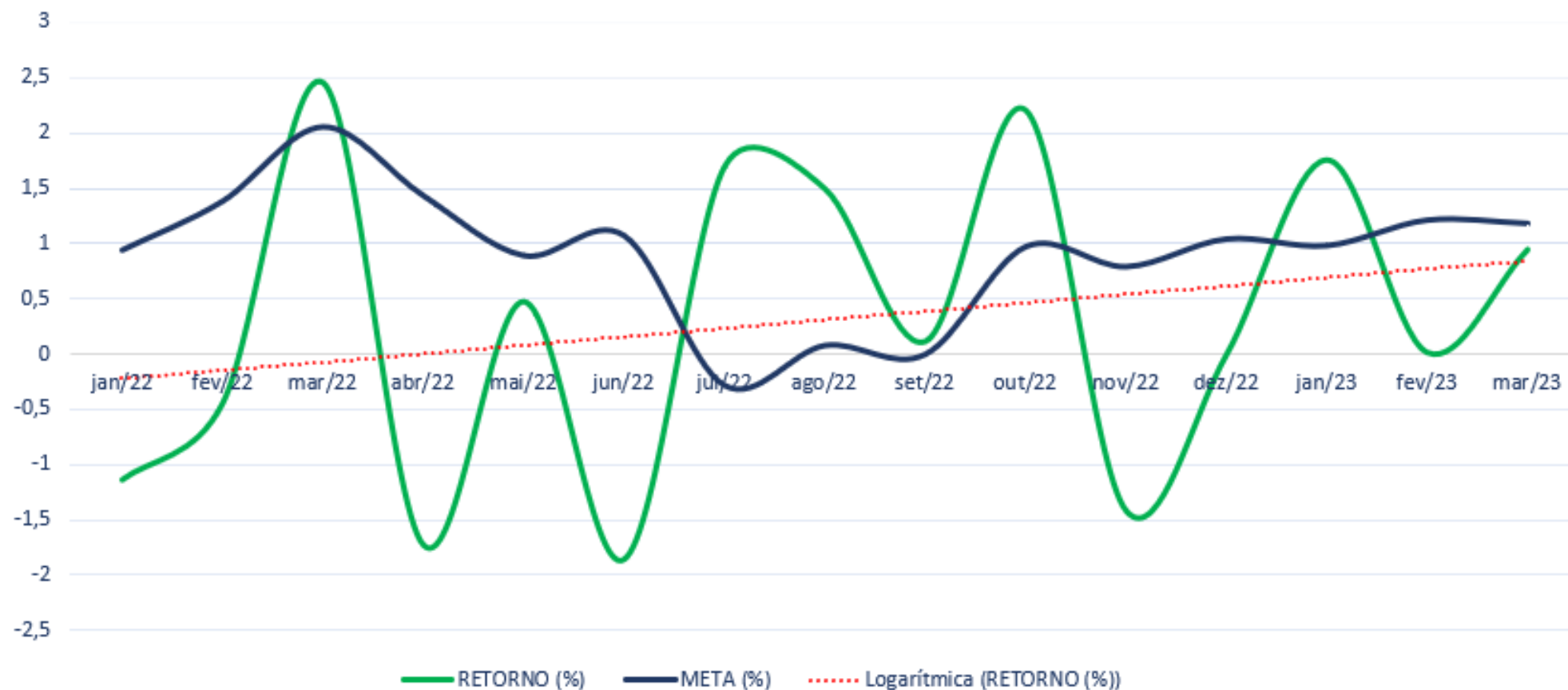
2022 AO 1º TRIMESTRE DE 2023

RETORNO E META



GUARUJÁPREV

Retorno X Meta Atuarial - 2022 até 1º Trimestre de 2023



INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022



GUARUJÁPREV

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA							
Política de Investimentos							Pró-Gestão Nível 3
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º, inc. I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	349.731.489,72	35,38	0	44,75	80	100
Artigo 7º, inc. I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	164.045.012,37	16,60	5	12,22	50	100
Artigo 7º, inc. III, alínea a	Fundos Renda Fixa	226.294.156,14	22,89	5	12,69	50	75
Artigo 7º, inc. V, alínea b	FI RF - Crédito Privado	5.160.528,53	0,52	0	2	5	15
Total Renda Fixa		745.231.186,76	75,39	----			100
Renda Variável							
Artigo 8º, inc. I	Fundos de Ações	148.102.653,95	14,98	5	11,12	20	45
Total Renda Variável		148.102.653,95	14,98	----			45
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º, inc. II	Fundos de Investimento no Exterior	38.668.252,58	3,91	0	4,97	10	10
Total Investimentos no Exterior		38.668.252,58	3,91	----			10
Investimentos Estruturados							
Artigo 10º, inc. I	Fundos Multimercados	51.005.625,02	5,16	0	7,72	10	15
Artigo 10º, inc. II	Fundo de Participação	4.503.371,53	0,46	0	0,5	2	10
Total Investimentos Estruturados		55.508.996,55	5,62	----			20
Fundos Imobiliários							
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	945.000,00	0,10	0	0,08	1	15
Total Fundos Imobiliários		945.000,00	0,10	----			15
Total Carteira		988.456.089,84	----				

INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS - 1º TRIMESTRE DE 2023



GUARUJÁPREV

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA						
Política de Investimentos						Pró-Gestão Nível 3
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo
Renda Fixa						
Artigo 7º, inc. I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	438.583.466,03	42,49	10	45,5	100
Artigo 7º, inc. I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	170.054.864,73	16,47	0	10,41	60
Artigo 7º, inc. III, alínea a	Fundos Renda Fixa	245.124.881,26	23,74	0	18,79	60
Artigo 7º, inc. V, alínea b	FI RF - Crédito Privado	5.378.340,79	0,5200	0	1,75	15
Total Renda Fixa		859.141.552,81	83,22	----		100
Renda Variável						
Artigo 8º, inc. I	Fundos de Ações	98.058.834,95	9,5	0	10,84	25
Total Renda Variável		98.058.834,95	9,5	----		45
Investimentos no Exterior						
Artigo 9º, inc. II	Fundos de Investimento no Exterior	42.133.268,28	4,090	0	5,42	10
Total Investimentos no Exterior		42.133.268,28	4,090	----		10
Investimentos Estruturados						
Artigo 10º, inc. I	Fundos Multimercados	25.702.420,99	2,49	0	6,46	12
Artigo 10º, inc. II	Fundo de Participação	3.130.853,15	0,3	0	0,63	2
Total Investimentos Estruturados		28.833.274,14	2,79	----		20
Fundos Imobiliários						
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	4.171.455,22	0,4	0	0,22	2
Total Fundos Imobiliários		4.171.455,22	0,4	----		15
Total Carteira		1.032.338.385,40	100,00	----		

INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

RESERVA DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO 2022



GUARUJÁPREV

MÊS	SALDO ANTERIOR (R\$)	APLICAÇÃO (R\$)	RESGATE (R\$)	RENDIMENTO (R\$)	VALOR TOTAL (R\$)	RENT. MÊS
JANEIRO	17.381.329,00	---	3.833.708,06	111.910,77	13.659.531,71	0,79%
FEVEREIRO	13.659.531,71	---	---	111.881,37	13.771.413,08	0,82%
MARÇO	13.771.413,08	---	---	102.957,36	127.559,61	0,93%
ABRIL	13.796.015,33	---	---	103.932,09	110.193,22	0,80%
MAIO	13.802.276,46	---	---	109.653,52	148.227,41	1,08%
JUNHO	13.840.850,35	---	106.703,43	146.131,68	13.880.278,60	1,06%
JULHO	13.880.278,60	---	---	139.759,36	14.020.037,96	1,01%
AGOSTO	14.020.037,96	---	---	166.451,07	14.186.489,03	1,19%
SETEMBRO	14.186.489,03	---	---	156.781,68	14.343.270,71	1,11%
OUTUBRO	14.343.270,71	---	---	148.047,14	14.491.317,85	1,03%
NOVEMBRO	14.343.270,71	---	---	148.047,14	14.491.317,85	1,03%
DEZEMBRO	14.641.752,42	---	---	168.335,53	14.810.087,95	1,15%

INVESTIMENTOS GUARUJÁPREV

RESERVA DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO – 1º TRIMESTRE 2023



GUARUJÁPREV

MÊS	SALDO ANTERIOR (R\$)	APLICAÇÃO (R\$)	RESGATE (R\$)	RENDIMENTO (R\$)	VALOR TOTAL (R\$)	RENT. MÊS
JANEIRO	14.810.087,95	100.847,94		162.259,19	15.073.195,08	1,09%
FEVEREIRO	15.073.195,08			120.493,42	15.193.688,50	0,80%
MARÇO	15.193.688,50			174.854,69	15.368.543,19	1,15%



GUARUJÁPREV

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

📞 (13) 3343-9050

📘 guarujaprevidencia

📷 guarujaprev

🌐 www.guarujaprevidencia.sp.gov.br

✉ atendimento@guarujaprevidencia.sp.gov.br