

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

FEVEREIRO 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 FEVEREIRO 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 – FEVEREIRO DE 2024.	5
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – FEVEREIRO DE 2024	14
8. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO FINANCEIRO	15
9. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO– FUNDO PREVIDENCIÁRIO	16



1. Objetivo

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

2. Cenário fevereiro de 2024

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

“ MERCADOS INTERNACIONAIS

O cenário internacional, embora em janeiro os índices de ações globais tenham apresentado retornos positivos, o mês foi marcado pela resiliência da economia norte-americana e pelas discussões sobre o início do ciclo de corte de juros nos EUA. O que resultou na alta dos juros futuros e, conseqüentemente, no ganho de força do dólar em relação às demais moedas. Em linhas gerais, a inflação seguiu surpreendendo para baixo na maioria das economias, com crescimento moderado da atividade e resiliência do mercado de trabalho. Desta forma, ao mesmo tempo que os Bancos Centrais dos países desenvolvidos mostram confiança no processo de desinflação, a perspectiva positiva para a economia justifica uma comunicação mais cautelosa quanto ao início e a extensão de um ciclo de afrouxamento monetário. Especificamente nos EUA, embora, a inflação caminha em uma direção positiva, os sinais de atividade econômica aquecida ainda estão presentes. Dessa forma, ainda há discussão sobre a expectativa de quando se dará o início do movimento de redução dos juros. Por sua vez, a comunicação do FED continuou na direção de suavização, com foco mais claro no processo de redução dos juros, discutindo o momento do seu início e as condições necessárias para tal. O principal ponto destacado é a necessidade de convicção suficiente na convergência da inflação para a meta. Já na China, a deterioração do setor imobiliário prossegue, limitando a efetividade dos estímulos adotados pelo governo. O quadro de excesso de oferta e pressões deflacionárias está se intensificando e pode ter repercussões globais importantes. Assim, no mês de janeiro de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +0,53% e +1,59%, 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 +12,72% e +18,86%,



respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +2,86% e +3,94%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +9,50% e +15,47% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, as curvas de juros futuras aumentaram no mês, acompanhando o movimento observado dos juros globais, além de terem sido impactadas negativamente com o anúncio do plano Nova Indústria Brasil, que fez ressuscitar fantasmas do passado, quando o BNDES foi extensivamente usado para subsidiar projetos duvidosos com alto custo fiscal. A inflação continuou seguindo uma tendência positiva, com desaceleração das medidas de núcleo. Além disso, os números de atividade sugerem que o PIB ficou de lado ou recuou marginalmente no último trimestre ano, de forma compatível com a desaceleração econômica esperada. O estágio mais lento do processo de desinflação, o desconforto com a desancoragem das expectativas de mercado e o fato de suas projeções para 2024 e 2025 estarem acima da meta contribuem para uma atuação mais conservadora adotada autoridade monetária. O Banco Central confirmou as expectativas do mercado, dando continuidade no movimento de redução de juros. Assim, reduzindo a taxa Selic em 0,5%, para 11,25%, enquanto em seu comunicado indicou a continuidade deste ritmo de cortes de juros. 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 02.02.2024, 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 5,57% 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 direção oposta dos índices globais e sendo impactada pela curva de juros. Apresentando um retorno negativo de -4,79% no mês. Entretanto, o Ibovespa possui um comportamento positivo de +12,63% no acumulado 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



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

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 fevereiro, o principal índice da Bolsa Brasileira – Ibovespa – ganhou um fôlego e encerrou o mês aos 128.481 pontos, tendo um aumento no mês de 1%. A Meta Atuarial foi de 1,22% e a rentabilidade mensal da carteira da GuarujáPrev foi de 1,16%. Apesar do retorno dos ativos da carteira terem sido positivos a inflação veio maior do que se esperava, encerrando fevereiro com 0,83%.

Em março terá a reunião do Copom e, de acordo com o mercado, espera-se que haja uma redução na Meta da Taxa Selic.

O Comitê continuará a analisar Ativos que melhor contribuam para a tentativa de atingir a Meta Atuarial.

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 fevereiro 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.

6. Carteira de Investimentos – fevereiro de 2024.

POSIÇÃO DE ATIVOS E ENQUADRAMENTO									
RENDA FIXA 84,5%									
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	4,16	0,01	0,67	1,91	25.555.190,61	2,03		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,396600%)	2,8	0,06	0,98	2	1.021.339,89	0,08		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,45	0,06	1,04	2,12	34.435.549,72	2,74		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470100%)	2,78	0,06	0,99	2,01	408.567,42	0,03		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,480000%)	2,78	0,06	0,99	2,01	45.853,13	0		



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 (5,500000%)	2,79	0,06	0,99	2,01	5.759.375,90	0,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,600500%)	2,82	0,06	1	2,03	2.721.703,23	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	0,57	0,06	1,03	2,09	25.459.130,04	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,58	0,06	1,05	2,13	62.309.613,76	4,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,59	0,06	1,06	2,15	3.111.522,59	0,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,548000%)	2,8	0,06	0,99	2,02	5.678.476,23	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,595500%)	2,82	0,06	1	2,03	2.562.378,17	0,2
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	2,84	0,06	1	2,04	11.906.788,67	0,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,080000%)	0,65	0,06	1,03	2,1	5.069.695,52	0,4
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	0,65	0,06	1,04	2,11	59.223.558,29	4,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	0,66	0,06	1,04	2,12	23.593.724,86	1,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	0,66	0,06	1,04	2,13	5.514.099,03	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	0,66	0,06	1,05	2,13	40.645.852,63	3,23



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	0,06	1,05	2,14	4.642.707,09	0,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	0,66	0,06	1,05	2,15	21.323.163,38	1,7
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,461000%)	2,96	0,06	1,06	2,16	866.919,59	0,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,600000%)	0,29	0,06	1,07	2,18	4.175.597,77	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,610000%)	2,97	0,06	1,07	2,19	3.330.191,78	0,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,620000%)	2,97	0,06	1,07	2,19	164.811,88	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,39	0,06	1,04	2,13	15.300.431,88	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,390000%)	2,8	0,06	0,98	1,99	1.352.683,08	0,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	0,52	0,06	1,04	2,12	45.082.121,69	3,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,520000%)	2,82	0,06	0,99	2,01	3.969.845,74	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,797500%)	2,92	0,06	1,01	2,06	1.607.972,17	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,78	0,13	1,04	2,11	40.644.911,00	3,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	0,63	0,06	1,05	2,13	34.045.732,27	2,71



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 (6,385000%)	0,63	0,06	1,05	2,15	22.847.356,74	1,82			
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,427000%)	0,63	0,06	1,06	2,16	32.777.088,12	2,61			
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,6	0,06	1,02	2,11	547.153.953,87	43,53			
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	0,09	0,05	0,79	1,74	6.495.384,34	0,52	13.568.473.477,14	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,05	0,01	0,73	1,85	8.577.397,16	0,68	3.849.726.917,00	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,22	0,2	0,6	0,25	1.907.377,00	0,15	997.345.488,00	0,19
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	4,22	0,2	0,6	0,25	4.656.457,15	0,37	236.822.886,64	1,97
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,75	0,1	0,58	1,24	8.750.275,48	0,7	1.502.463.249,65	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,94	0,13	0,54	0,07	147.491.888,32	11,74	5.024.622.442,53	2,94
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,31	0,16	0,43		4.518.989,97	0,36	2.421.981.010,50	0,19



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	1,05	0,01	0,73	1,84	2.880.185,00	0,23	213.006.900,19	1,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,95	0,12	0,56	0,3	185.277.954,42	14,74		
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	0,17	0,04	0,85	1,87	103.897.743,66	8,27	720.071.811,26	14,43
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	8,45	- 0,03	0,34	1,68	10.940.090,08	0,87	232.869.554,09	4,7
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,13	0,1	0,74	1,58	20.844.914,16	1,66	924.441.972,37	2,25
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,04	0,73	1,61	16.333.680,50	1,3	4.488.445.035,86	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,04	0,04	0,73	1,61	2.129.125,10	0,17	1.070.041.866,60	0,2
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,04	0,9	1,99	124.965.581,92	9,94	10.050.564.520,10	1,24



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,84	0,06	0,51	1,42	44.651.354,12	3,55	2.401.208.782,37	1,86
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,43	0,05	0,79	1,82	323.762.489,54	25,76		
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	1,3	0,13	0,7	1,61	5.879.493,40	0,47	309.498.585,41	1,9
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,3	0,13	0,7	1,61	5.879.493,40	0,47		
Renda Fixa			0,71	0,07	0,87	1,7	1.062.073.891,23	84,5		
RENDA VARIÁVEL 7,98%										
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	13,74	- 0,28	1,4	1,4	8.616.866,18	0,69	123.253.471,72	6,99
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,21	- 0,47	0,8	-2,66	12.204.184,83	0,97	1.513.325.475,39	0,81
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,03	- 1,06	2,43	-1,02	42.190.809,73	3,36	1.415.343.406,48	2,98
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	16,38	- 0,64	0,57	-4,04	6.326.242,66	0,5	176.238.694,66	3,59
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	15,92	- 0,76	0,48	-4,18	8.553.906,25	0,68	127.661.874,98	6,7
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	15,13	- 0,97	1,15	-2,69	11.248.039,12	0,89	871.177.158,08	1,29



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,75	-0,8	-0,02	-6,21	969.854,58	0,08	180.195.963,02	0,54
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	16,21	-0,27	1,76	-1,37	10.219.925,09	0,81	444.574.726,01	2,3
Sub-total Artigo 8º I			15,35	-0,78	1,67	-2,03	100.329.828,44	7,98		
Renda Variável			15,35	-0,78	1,67	-2,03	100.329.828,44	7,98		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR										
4,23%										
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	17,11	1,05	8,25	12,88	5.775.201,23	0,46	197.492.020,37	2,92
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	28,44	-0,81	10,8	6,09	4.780.395,26	0,38	131.192.634,72	3,64
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,5	1,52	8,42	12,8	12.296.410,62	0,98	763.217.450,44	1,61
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	11,84	0,51	4,48	6,88	17.736.445,13	1,41	381.871.439,24	4,64



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	14,65	0,32	2,92	5,8	12.524.423,76	1	329.505.382,91	3,8
Sub-total Artigo 9º II			12,69	0,63	5,94	8,49	53.112.876,00	4,23		
Investimentos no Exterior			12,69	0,63	5,94	8,49	53.112.876,00	4,23		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,74%										
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	5,27	- 0,12	0,89	-0,09	2.328.207,82	0,19	370.031.066,87	0,63
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	6,98	-0,7	0,69	-2,3	25.767.390,32	2,05	179.767.316,24	14,33
Sub-total Artigo 10º I			6,5	- 0,65	0,71	-2,12	28.095.598,14	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	8,4	-0,8	-0,8	-2,23	2.930.375,83	0,23	163.335.990,28	1,79
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	9,36	8,42	8,42	8,2	3.416.768,35	0,27	96.158.964,58	3,55
Sub-total Artigo 10º II			5,61	3,96	3,96	3,12	6.347.144,18	0,51		
Investimentos Estruturados			5,46	0,17	1,29	-1,19	34.442.742,32	2,74		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,55%										



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Artigo 11° (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	27,03	21	21,83	29,16	1.530.000,00	0,12	144.943.419,55	1,06
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,52	-0,1	-0,1	-9,39	5.334.862,52	0,42	654.770.428,64	0,81
Sub-total Artigo 11°			48,83	3,94	4,08	-2,92	6.864.862,52	0,55		
Fundos Imobiliários			48,83	3,94	4,08	-2,92	6.864.862,52	0,55		
Total			1,67	0,05	1,16	1,58	1.256.824.200,51	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 – fevereiro de 2024

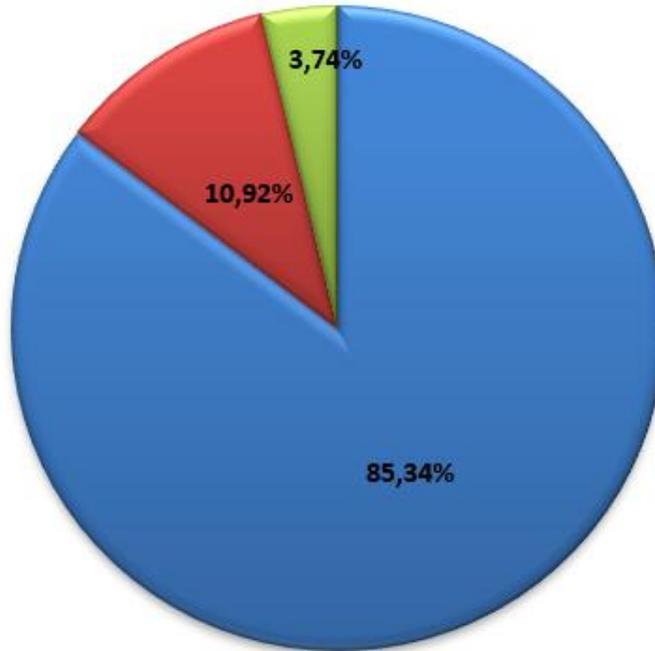
MÊS	SALDO ANTERIOR (R\$)	APLICAÇÕES (R\$)	RESGATES (R\$)	AMORTIZAÇÃO (R\$)	JUROS (R\$)	RETORNO (R\$)	SALDO NO MÊS	RETORNO (%)	META (%)
JANEIRO	1.216.270.162,04	25.821.101,62	13.378.423,36	0,00	8.850,00	5.056.252,02	1.233.769.092,32	0,41%	0,87%
FEVEREIRO	1.233.769.092,32	29.053.374,13	13.054.093,16	425.868,62	6.964.319,21	14.435.809,26	1.256.822.694,72	1,16%	1,22%
TOTAL				425.868,62	6.973.169,21	19.492.061,28		1,58%	2,10%

Vê-se que no mês de fevereiro de 2024 a GuarujáPrev teve o retorno de 1,16% e a Meta Atuarial o percentual de 1,22%. Ao longo do ano a rentabilidade da carteira foi de 1,58% e a Meta Atuarial de 2,10%.



8. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro

Fundo Financeiro



■ RENDA FIXA ■ RENDA VARIÁVEL ■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR



9. Carteira de Investimentos por segmento– Fundo Previdenciário





10. Carteira de Investimentos por segmento – Consolidado





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 fevereiro de 2024

ATIVIDADE	JANEIRO
Elaborar relatório de aderência de carteira de investimentos	Realizado
Elaborar o Relatório Anual de Atividades	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, 14 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



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050 

@guarujaprevidencia 

@guarujaprevidencia 

guarujaprevidencia.sp.gov.br 

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

**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**