

GUARUJÁPREV

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ABRIL 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 ABRIL 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 – ABRIL DE 2024.....	5
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – ABRIL 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 abril de 2024.

2. Cenário abril de 2024

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

“MERCADOS INTERNACIONAIS

Em março, o cenário internacional foi marcado pelas discussões sobre a velocidade da redução da inflação nas economias desenvolvidas e a manutenção da taxa de juros básica nos EUA. Além disso, houve continuidade do avanço dos ativos de risco nos mercados globais. Esse movimento ocorreu à medida que as curvas de juros mantiveram-se relativamente estáveis, apesar das declarações dos principais banqueiros centrais indicando que o início dos ciclos de redução de juros poderá ocorrer um pouco mais tarde. Nos EUA, as leituras de inflação seguem mais pressionadas do que o esperado e o mercado de trabalho continua em expansão. Desta forma, é fortalecida a hipótese que a trajetória do processo de desinflação ocorra de maneira gradual, num contexto de mercado de trabalho aquecido. Assim, é importante reconhecer que esses dados trazem um risco maior de que a inflação possa se mostrar mais resistente e, eventualmente, afete os próximos passos do FED. Na Zona do Euro, a situação econômica contrasta com a dos Estados Unidos, sendo marcada pela estagnação e a necessidade de políticas monetárias mais flexíveis. Onde, apesar da resiliência do mercado de trabalho, os indicadores dos setores de manufatura e serviços da região revelaram um desempenho modesto. Este contexto tem contribuído para a manutenção da tendência de queda nas taxas de inflação, colocando a Zona do Euro em uma posição favorável no que diz respeito ao controle inflacionário. Já na China, o setor industrial tem avançado mais fortemente desde o início do ano, sendo este um sinal positivo para a demanda global por bens industriais e para o comércio internacional. Entretanto, ainda permanece um cenário de cautela. Onde, o setor imobiliário ainda apresenta certa fragilidade e, além disso, a inflação encontra-se em patamares baixos, podendo estar associada a uma demanda interna mais fraca. Assim, no mês de março de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e



S&P 500, respectivamente, valorizaram +2,88% e +3,10%, 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 +21,09% e +27,86%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +3,14% e +3,37%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +19,08% e +25,75% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, as curvas de juros futuras aumentaram no mês, refletindo o aumento da incerteza sobre a condução da política econômica. Assim, o Ibovespa ficou em território negativo e o Real perdeu espaço frente ao dólar. Os dados de atividade econômica continuam fortes. As pesquisas sobre comércio e serviços superaram as expectativas, porém, mais uma vez, o mercado de trabalho se destacou. A taxa de desemprego continuou a diminuir e houve uma significativa criação de empregos formais, resultando em um contínuo crescimento substancial do salário real. A sustentação da demanda, em função deste aumento da renda e da expansão das concessões de crédito para pessoas físicas, tem se refletido em aumento gradual das previsões para o PIB deste ano. No entanto, a ausência de ociosidade no mercado de trabalho em conjunto com a elevação dos núcleos de inflação e da inflação subjacente de serviços exige cautela na condução da política monetária. Dito isso, números de inflação e de atividade acima das expectativas fizeram com que o Banco Central apresentasse uma mensagem mais conservadora em sua última reunião do Copom, sinalizando apenas mais um corte de 0,5% na Selic e deixando os próximos passos em aberto, a depender dos dados. 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 01.04.2024, 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 5,85% 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. Apresentando a performance de -0,71% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -4,53% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +25,74%. 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

Durante o mês de abril, o principal índice da Bolsa Brasileira – Ibovespa – encerrou o mês com variação de -2%. A Meta Atuarial foi de 0,83% e a rentabilidade mensal da carteira da GuarujáPrev foi de -0,17%, não atingindo assim, a Meta Atuarial.

O Comitê continuará a observar as aberturas de taxas da renda fixa como Título Público Federal pois estes continuam premiando acima da meta atuarial.

Apesar do mercado interno ter sofrido, caso surjam potenciais investimentos, o Comitê estará aberto a possibilidade de aplicações neste ramo afim de diversificar a carteira da GuarujáPrev.

4. Análise do Relatório de Gestão de Risco

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



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

6. Carteira de Investimentos – abril de 2024.

POSIÇÃO DE ATIVOS E ENQUADRAMENTO								
RENDA FIXA								
84,7%								
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	4,11	0,03	0,81	3,69	26.002.716,75	2,03	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,970000%)	4,11	0,04	0,6	0,6	1.537.315,01	0,12	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,211000%)	4,13	0,04	0,2	0,2	21.417.055,07	1,67	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,396600%)	2,79	0,04	0,7	3,7	1.038.442,72	0,08	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,44	0,04	0,76	3,96	35.055.433,74	2,74	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470100%)	2,77	0,04	0,7	3,73	415.457,39	0,03	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,480000%)	2,77	0,04	0,7	3,73	46.627,12	0	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,500000%)	2,78	0,04	0,7	3,74	5.856.778,89	0,46	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,600500%)	2,81	0,04	0,71	3,77	2.768.169,88	0,22	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	0,56	0,04	0,75	3,9	25.910.713,58	2,02	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,060000%)	4,13	0,04	0,19	0,19	46.039.196,34	3,59	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,57	0,04	0,77	3,98	63.439.226,33	4,95	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,58	0,04	0,78	4,03	3.168.628,95	0,25	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,548000%)	2,79	0,04	0,71	3,75	5.774.950,08	0,45	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,595500%)	2,81	0,04	0,71	3,77	2.606.105,25	0,2	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	2,83	0,04	0,72	3,79	12.111.410,07	0,95	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,080000%)	0,64	0,04	0,75	3,92	5.160.144,57	0,4	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	0,64	0,04	0,76	3,94	60.285.421,83	4,71	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	0,65	0,04	0,76	3,97	24.019.587,23	1,88	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	0,65	0,04	0,76	3,97	5.613.798,74	0,44	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	0,65	0,04	0,77	3,99	41.383.379,09	3,23	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,325000%)	0,65	0,04	0,77	4	4.727.353,60	0,37	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	0,65	0,04	0,78	4,02	21.713.537,86	1,7	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,461000%)	2,95	0,04	0,78	4,05	882.914,06	0,07	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,600000%)	0,26	0,04	0,8	4,09	4.253.560,24	0,33	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,610000%)	2,96	0,04	0,8	4,1	3.392.421,62	0,26	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,620000%)	2,96	0,04	0,8	4,1	167.894,39	0,01	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,170000%)	4,15	0,04	0,2	0,2	20.039.278,01	1,56	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,37	0,04	0,77	3,98	15.577.326,70	1,22	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,390000%)	2,79	0,04	0,69	3,7	1.375.320,35	0,11	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	0,5	0,04	0,76	3,96	45.895.093,06	3,58	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,520000%)	2,81	0,04	0,71	3,74	4.037.113,52	0,32	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,797500%)	2,91	0,04	0,73	3,83	1.635.932,80	0,13	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,77	0,1	0,76	3,94	41.373.642,30	3,23	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	0,62	0,04	0,77	3,99	34.663.493,77	2,71	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,385000%)	0,62	0,04	0,78	4,02	23.266.128,30	1,82	



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 (6,427000%)	0,62	0,04	0,78	4,04	33.380.045,60	2,61		
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a			0,59	0,04	0,76	3,95	646.031.614,81	50,44		
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	5,29	-	-	-2,36	14.729.458,97	1,15	232.845.220,27	6,33
				0,75	2,22					
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,05	0,03	0,08	0,08	139.485,48	0,01	18.854.174.956,96	0
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,12	0,03	0,8	3,37	6.599.244,06	0,52	11.874.033.922,49	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,85	0,03	0,79	3,6	8.724.442,61	0,68	3.916.733.878,71	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,03	-	-	-1,48	1.874.564,44	0,15	989.771.853,99	0,19
				0,46	1,72					
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	4,04	-	-	-1,48	4.576.119,01	0,36	232.736.966,32	1,97
				0,46	1,73					
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,75	-	-	1,79	8.797.091,78	0,69	1.562.879.428,83	0,56
				0,17	0,22					
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,89	-	-	-1,51	65.540.605,88	5,12	4.738.343.434,12	1,38
				0,62	1,64					
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,29	-	-		4.516.469,42	0,35	2.405.204.748,42	0,19
				0,34	0,55					
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI	0,85	0,03	0,79	3,58	2.929.338,79	0,23	216.642.117,39	1,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,02	-	-	-0,82	118.426.820,44	9,25		
				0,48	1,26					
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	0,05	0,94	3,77	105.836.852,82	8,26	719.903.936,32	14,7
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	7,71	-	0,12	3,25	11.109.719,88	0,87	236.480.254,03	4,7
				0,05						
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,48	-	-	1,41	20.810.300,69	1,62	717.136.929,11	2,9
				0,04	0,87					
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,8	3,2	3.112.427,20	0,24	4.150.521.759,60	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,04	0,8	3,19	955.309,55	0,07	1.048.477.905,07	0,09
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,1	0,04	0,95	3,9	127.298.026,76	9,94	11.563.181.980,10	1,1
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,82	0,08	1,19	3,27	45.468.070,42	3,55	2.243.451.902,02	2,03
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,42	0,04	0,82	3,55	314.590.707,32	24,56		
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	1,54	-	-	1,26	5.859.225,36	0,46	309.389.323,11	1,89
				0,48	1,11					



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,54	-	-	1,26	5.859.225,36	0,46		
Renda Fixa			0,71	-	0,43	2,98	1.084.908.367,93	84,7		
				0,02						
RENDA VARIÁVEL 7,44%										
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	13,4	-	-	-1,02	8.411.166,11	0,66	122.191.436,82	6,88
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	13,87	-	-	-7,21	11.633.901,46	0,91	1.422.830.590,23	0,82
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,74	-	-	-8,03	39.205.045,46	3,06	1.238.528.756,77	3,17
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	15,28	-1,4	-	-9,69	5.954.035,65	0,46	163.519.903,84	3,64
DAYCOVAL	DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	14,58	-	-	-7,04	8.298.375,91	0,65	112.826.923,20	7,35
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	14,33	-	-	-6,69	10.784.930,16	0,84	851.449.322,38	1,27
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	17,77	-	-	-	915.428,62	0,07	123.221.049,43	0,74
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	16,29	-	-3	-2,14	10.140.361,65	0,79	429.167.363,26	2,36
Sub-total Artigo 8º I			14,64	-	-	-6,9	95.343.245,02	7,44		
Renda Variável			14,64	-	-	-6,9	95.343.245,02	7,44		
				1,53	5,18					
				1,53	5,18					
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 4,69%										
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	16,99	-	-	13,95	5.830.061,42	0,46	184.972.616,20	3,15
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	27,65	0,59	-	3,5	4.663.671,16	0,36	127.888.813,77	3,65
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,91	1,18	-	14,58	12.490.124,07	0,98	752.291.945,66	1,66
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	11,69	-0,6	-	6,1	17.607.312,67	1,37	401.297.107,39	4,39
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,42	0,68	0,81	10,19	13.043.915,32	1,02	341.578.666,14	3,82
Sub-total Artigo 9º II			12,37	0,23	-	9,56	53.635.084,64	4,19		
					1,85					
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	15,7	0,25	-	-2,22	6.394.936,80	0,5	1.534.932.972,37	0,42
Sub-total Artigo 9º III			15,7	0,25	-	-2,22	6.394.936,80	0,5		
Investimentos no Exterior			12,33	0,23	-	9,43	60.030.021,44	4,69		
					1,96					



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,66%										
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	5,33	- 0,58	- 1,51	-0,3	2.323.274,80	0,18	408.742.893,67	0,57
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,44	- 0,97	- 1,74	-4,92	25.076.761,00	1,96	174.949.119,95	14,33
Sub-total Artigo 10º I			6,99	- 0,94	- 1,72	-4,54	27.400.035,80	2,14		
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	12,35	- 0,74	- 0,74	1,46	3.235.439,85	0,25	108.653.624,60	2,98
BTG PACTUAL	CEF	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	9,29	-0,2 0,46	-0,2 0,46	7,79	3.403.991,34	0,27	103.651.536,46	3,28
Sub-total Artigo 10º II			6,59	- 0,46	- 0,46	4,7	6.639.431,19	0,52		
Investimentos Estruturados			5,76	- 0,84	- 1,48	-2,9	34.039.466,99	2,66		
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	36,26	- 1,35	- 0,63	1,54	1.187.400,00	0,09	143.558.792,74	0,83
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,39	0 0,25	0 0,12	-9,48	5.329.665,18	0,42	654.137.410,24	0,81
Sub-total Artigo 11º			49	- 0,25	- 0,12	-7,6	6.517.065,18	0,51		
Fundos Imobiliários			49	- 0,25	- 0,12	-7,6	6.517.065,18	0,51		
Total			1,66	- 0,14	- 0,17	2,22	1.280.838.166,56	100		



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

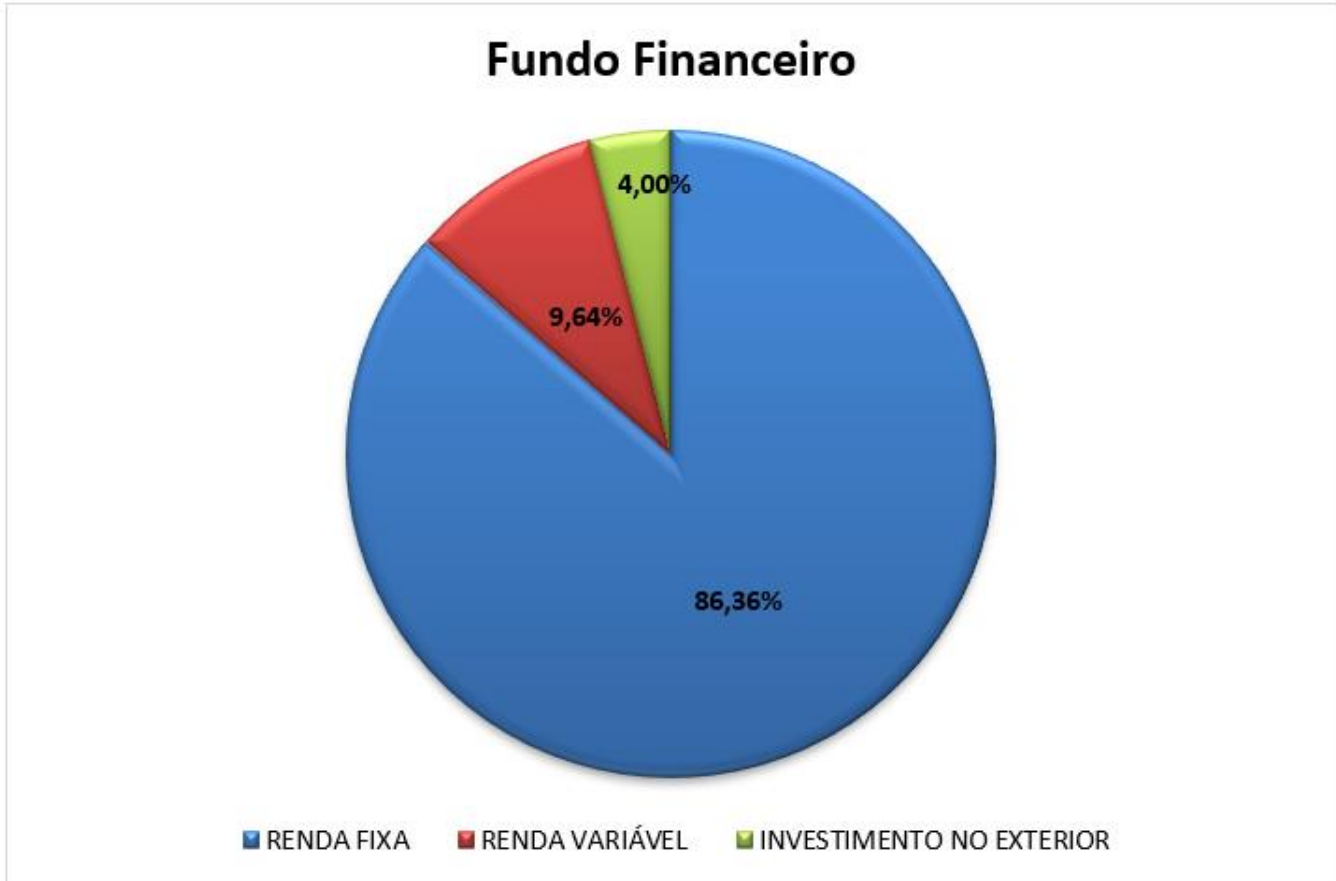
7. Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – abril de 2024

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%
TOTAL				425.868,62	6.990.569,21	27.318.227,68		2,22%	3,53%

Vê-se que no mês de abril de 2024 a GuarujáPrev teve o retorno de -0,17% e a Meta Atuarial o percentual de 0,83%. Ao longo do ano a rentabilidade da carteira foi de 2,22% e a Meta Atuarial de 3,53%.



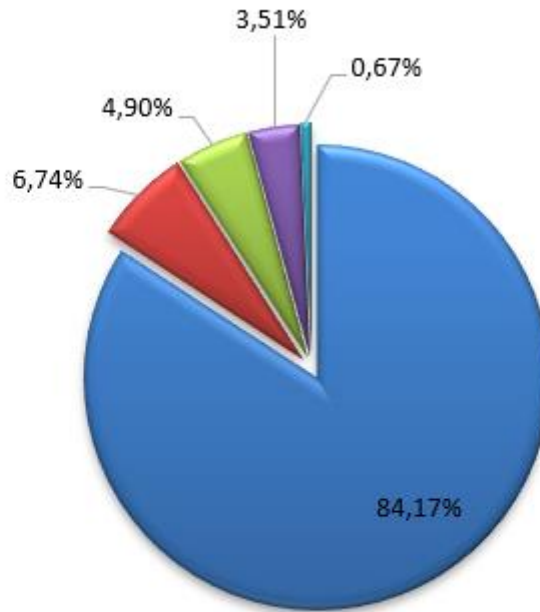
8. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro





9. Carteira de Investimentos por segmento– Fundo Previdenciário

Fundo Previdenciário



■ RENDA FIXA

■ RENDA VARIÁVEL

■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR

■ INVESTIMENTO ESTRUTURADO

■ FUNDOS IMOBILIÁRIOS



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 abril de 2024

ATIVIDADE	ABRIL
Elaborar relatório de aderência de carteira de investimentos	Realizado
Analisar o estudo ALM	Será apresentado ao Comitê em Junho de 2024
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, 29 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**