

SUMÁRIO

1. OBJETIVO.....	2
2. CENÁRIO MAIO 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 – MAIO DE 2024.	5
7. RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL – MAIO DE 2024	10
8. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO – FUNDO FINANCEIRO	11
9. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO– FUNDO PREVIDENCIÁRIO	12

1. Objetivo

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

2. Cenário maio de 2024

Segundo o relatório da empresa de consultoria, LDB:

“MERCADOS INTERNACIONAIS

Em abril, os mercados globais reagiram a dados mais resilientes de inflação e atividade nos EUA. Os juros futuros apresentaram alta, os índices de ações tiveram desempenho negativo e o dólar se valorizou frente às demais moedas. Além disso, houve a continuidade das discussões sobre o início do ciclo de redução dos juros americanos. Nos EUA, os indicadores de atividade seguem crescendo de forma robusta, com destaque para o bom desempenho do consumo das famílias. Da mesma forma, mercado de trabalho continua aquecido, com desemprego baixo e crescimento relevante dos salários. Já o processo de desinflação mostra-se mais gradual que o esperado, inclusive com o núcleo da inflação de serviços passando por aceleração recentemente. Assim, ainda nos EUA, o FED indicou ser necessário mais tempo para avaliar a convergência da inflação para a meta, sugerindo que não tem pressa para afrouxar a política monetária. Todavia, a instituição segue afirmando que a política monetária está apertada, sendo improvável nova elevação da taxa básica. Na zona do euro, a inflação de serviços mais resistente e a melhora da atividade também se destacam. Esta combinação acarretou na redução das expectativas do mercado em relação ao ciclo total de corte de juros por parte do Banco Central Europeu, apesar da instituição indicar um corte de juros em junho. Assim, no mês de abril de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -3,39% e -4,16%, 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 +15,51% e +20,78%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

de +0,00% e -0,79%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +19,47% e +24,91% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, as curvas de juros locais apresentaram alta e os ativos geral acompanharam o movimento dos mercados internacionais, devido expectativa de juros altos por mais tempo nos EUA, sendo também afetados pelas incertezas em relação à condução da política econômica local. Na parte fiscal, o governo enviou o projeto da Lei de Diretrizes Orçamentárias com um resultado primário inferior ao sinalizado anteriormente. Ainda assim, a meta permanece desafiadora e demanda uma elevação significativa das receitas. A economia local está mais forte que o previsto, o que dificulta a tarefa de desinflacionar a economia, podendo inclusive afetar desfavoravelmente a inflação projetada. Por outro lado, a inflação corrente ainda caminha numa direção de desaceleração, ainda que gradual e não homogênea. Neste contexto, o presidente do Banco Central suspendeu a sinalização de um corte de 0,5% na próxima reunião do Copom, condicionando esse movimento a uma melhora do cenário e tornando mais provável uma desaceleração do ritmo de afrouxamento monetário. Dessa forma, as expectativas, presentes no mercado, de um corte de juros de 0,25% em maio ganhou força. 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 07.05.2024, 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 6,17% 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 observada nos índices globais. Apresentando a performance de -1,70% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -6,16% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +20,58%. 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 maio, o principal índice da Bolsa Brasileira – Ibovespa – encerrou o mês com variação de -3,04%. A Meta Atuarial foi de 0,89% e a rentabilidade mensal da carteira da GuarujáPrev foi de 0,60%, 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.

Para seguir a política de investimento e ALM e aproveitando que fundos no seguimento de Multimercado estão com boa performance o comitê já solicitou análises e comparativos entre fundos indexador S&P 500.

4. Análise do Relatório de Gestão de Risco

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



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

6. Carteira de Investimentos – maio de 2024.

POSIÇÃO DE ATIVOS E ENQUADRAMENTO								
RENDA FIXA 85,07%								
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	4,12	0,08	0,9	4,63	26.237.758,83	2,02	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,461000%)	2,96	0,04	0,93	5,02	891.143,35	0,07	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,600000%)	0,25	0,04	0,94	5,07	4.293.675,50	0,33	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,610000%)	2,96	0,04	0,94	5,08	3.424.442,98	0,26	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,620000%)	2,96	0,04	0,94	5,08	169.480,35	0,01	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,970000%)	2,94	0,04	0,89	1,5	1.506.529,91	0,12	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,211000%)	2,94	0,04	0,91	1,11	20.990.802,84	1,62	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,080000%)	4,15	0,04	0,55	0,55	1.751.086,54	0,13	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,170000%)	4,15	0,04	0,91	1,11	20.221.435,56	1,56	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,240000%)	0,36	0,04	0,91	4,93	15.719.802,99	1,21	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,396600%)	0,4	0,04	0,85	4,58	1.018.587,58	0,08	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,180000%)	0,43	0,04	0,91	4,9	34.347.388,43	2,65	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,390000%)	2,79	0,04	0,85	4,58	1.386.970,46	0,11	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,200000%)	0,5	0,04	0,91	4,91	46.313.397,35	3,57	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,470100%)	0,53	0,04	0,85	4,61	407.717,77	0,03	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,480000%)	0,53	0,04	0,85	4,62	45.757,41	0	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,500000%)	0,53	0,04	0,86	4,62	5.747.254,15	0,44	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,600500%)	0,53	0,04	0,86	4,67	2.715.745,73	0,21	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,015000%)	0,55	0,04	0,9	4,84	25.393.900,68	1,96	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,060000%)	2,95	0,04	0,9	1,1	45.115.749,32	3,48	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,142000%)	5,09	0,04	3,51	3,51	6.355.217,31	0,49	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,260000%)	0,56	0,04	0,92	4,94	62.135.085,44	4,79	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,57	0,04	0,93	4,99	3.102.363,58	0,24	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,520000%)	2,81	0,04	0,86	4,63	4.071.726,97	0,31	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,797500%)	2,91	0,04	0,88	4,75	1.650.322,31	0,13	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,140000%)	0,77	0,1	0,91	4,89	41.748.631,25	3,22	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,270000%)	0,61	0,04	0,92	4,94	34.981.358,08	2,7	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,385000%)	0,62	0,04	0,93	4,99	23.481.569,50	1,81	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,427000%)	0,62	0,04	0,93	5	33.690.283,83	2,6	



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,548000%)	0,61	0,04	0,86	4,64	5.667.988,58	0,44		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,595500%)	0,62	0,04	0,86	4,66	2.557.469,63	0,2		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	0,62	0,04	0,87	4,69	11.882.673,18	0,92		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,080000%)	0,64	0,04	0,9	4,86	5.056.263,76	0,39		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,135000%)	0,64	0,04	0,91	4,88	59.061.508,10	4,55		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,210000%)	0,64	0,04	0,91	4,91	23.526.358,41	1,81		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,230000%)	0,64	0,04	0,91	4,92	5.498.177,19	0,42		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,270000%)	0,65	0,04	0,92	4,94	40.525.869,82	3,12		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,325000%)	0,65	0,04	0,92	4,96	4.628.589,82	0,36		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,372000%)	0,65	0,04	0,93	4,98	21.256.678,91	1,64		
Sub-total Artigo 7º I, Alinea a		0,59	0,05	0,94	4,92	648.576.763,40	49,99		
Artigo 7º I, Alinea b (Fundos 100% Títulos Públicos)									
Gestor	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano				
BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,86	0,08	0,88	4,5	2.955.208,00	0,23	218.555.299,50	1,35
CAIXA DTVM	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RF	3,95	0,19	1,38	-0,12	4.639.449,15	0,36	235.957.876,05	1,97
CAIXA DTVM	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,86	0,08	0,89	4,51	8.801.692,26	0,68	3.981.747.051,74	0,22
CAIXA DTVM	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,95	0,19	1,38	-0,11	1.900.525,62	0,15	1.010.421.816,77	0,19
CAIXA DTVM	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,85	0,24	1,3	-0,23	66.392.643,85	5,12	4.414.746.482,17	1,5
CAIXA DTVM	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,36	0,2	0,63		4.545.005,42	0,35	2.239.303.691,86	0,2
CAIXA DTVM	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,04	0,79	4,19	6.651.597,95	0,51	11.244.875.948,40	0,06
CAIXA DTVM	FIC FI CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,05	0,03	0,57	0,66	140.268,25	0,01	19.287.689.291,27	0
ICATU	ICATU VANGUARDA PRE FIXADO FIRF LP	5,44	0,4	0,42	-1,94	14.792.056,64	1,14	218.398.294,56	6,77
ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,73	0,1	1,03	2,84	8.887.869,48	0,69	1.577.510.449,17	0,56
Sub-total Artigo 7º I, Alinea b		3,07	0,22	1,08	0,26	119.706.316,62	9,23		
Artigo 7º III, Alinea a (Fundos Renda Fixa)									
Gestor	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano				
BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,03	0,75	3,97	15.211.212,56	1,17	4.168.595.178,55	0,36
BRAM	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,88	4,81	128.418.699,97	9,9	11.765.933.444,23	1,09
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,48	0,05	0,87	2,29	20.990.750,27	1,62	651.755.323,59	3,22



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

CAIXA DTVM	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,04	0,75	3,96	971.343,75	0,07	1.036.556.809,11	0,09
ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,81	0	0,87	4,17	45.864.208,22	3,54	2.230.492.743,54	2,06
RIO BRAVO	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	7,54	-0,01	1,03	4,32	11.223.886,17	0,87	238.910.403,24	4,7
WESTERN	WESTERN ASSET DI MAX RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,13	0,05	0,88	4,69	106.773.203,56	8,23	719.303.895,71	14,84
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a		0,42	0,04	0,88	4,46	329.453.304,50	25,39		
Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)									
Gestor	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano				
BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,64	0,2	1,34	2,61	5.937.567,97	0,46	296.095.526,15	2,01
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b		1,64	0,2	1,34	2,61	5.937.567,97	0,46		
Renda Fixa		0,7	0,06	0,94	3,95	1.103.673.952,49	85,07		
RENDA VARIÁVEL 7,10%									
Artigo 8º I (Fundos de Ações)									
Gestor	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	16,27	-0,57	-3,7	-5,76	9.764.722,13	0,75	413.269.308,38	2,36
BAHIA	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	15,15	-0,77	-4,19	-13,47	5.704.517,52	0,44	160.740.063,19	3,55
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,64	-0,54	-3,92	-11,63	37.666.837,23	2,9	1.162.832.876,92	3,24
CONSTANCIA	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14	-0,82	-2,99	-9,98	11.285.630,63	0,87	1.362.219.478,66	0,83
DAYCOVAL	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	14,03	-0,46	-3,43	-10,23	8.013.805,34	0,62	108.543.266,49	7,38
ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	17,52	-1,16	-4,91	-15,82	870.446,17	0,07	114.472.058,79	0,76
OCCAM	OCCAM FIC FIA	13,94	-0,36	-3,15	-9,63	10.445.423,15	0,81	814.344.532,62	1,28
VINCI	VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	13,14	-1,04	-0,85	-1,86	8.339.692,32	0,64	122.586.201,36	6,8
Sub-total Artigo 8º I		14,46	-0,62	-3,41	-10,07	92.091.074,49	7,1		
Renda Variável		14,46	-0,62	-3,41	-10,07	92.091.074,49	7,1		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 4,77%									
Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)									
Gestor	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano				
BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,6	-0,5	7,54	22,54	6.269.646,19	0,48	198.995.419,53	3,15



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

PLURAL	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	26,98	-0,58	-3,1	0,29	4.519.012,70	0,35	123.940.652,72	3,65
XP	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,35	-1,27	-0,58	13,92	12.418.095,55	0,96	739.157.547,45	1,68
SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	11,49	-0,35	4,63	11,02	18.422.916,68	1,42	413.446.661,71	4,46
SCHRODER	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	13,87	0,2	3,47	14,01	13.496.244,89	1,04	346.626.127,85	3,89
Sub-total Artigo 9º II		12,04	-0,46	2,78	12,6	55.125.916,01	4,25		
Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)									
Gestor	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano				
WESTERN	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	14,94	-1,06	5,25	2,91	6.730.592,87	0,52	1.609.569.676,98	0,42
Sub-total Artigo 9º III		14,94	-1,06	5,25	2,91	6.730.592,87	0,52		
Investimentos no Exterior		11,99	-0,53	3,04	12,76	61.856.508,88	4,77		
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 2,56%									
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)									
Gestor	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano				
ICATU	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,22	-0,16	0,25	-0,05	2.329.129,23	0,18	421.794.694,84	0,55
RIO BRAVO	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,66	-0,4	-3,18	-7,94	24.280.230,80	1,87	169.392.091,62	14,33
Sub-total Artigo 10º I		7,25	-0,38	-2,89	-7,3	26.609.360,03	2,05		
Artigo 10º II (Fundo de Participação)									
Gestor	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	9,09	-0,21	-0,21	7,56	3.396.691,95	0,26	103.651.536,46	3,28
PÁTRIA	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	11,59	-0,81	-0,81	0,64	3.209.349,87	0,25	106.978.329,00	3
Sub-total Artigo 10º II		6,3	-0,5	-0,5	4,18	6.606.041,82	0,51		
Investimentos Estruturados		5,94	-0,41	-2,42	-5,25	33.215.401,85	2,56		
FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,50%									
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)									
Gestor	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	CXRI11	35,55	-0,97	-0,23	1,3	1.175.850,00	0,09	142.581.297,65	0,82
LEGATUS	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,52	-0,02	-0,02	-9,5	5.328.717,01	0,41	653.383.873,16	0,82



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 11º	49,08	-0,19	-0,06	-7,65	6.504.567,01	0,5	
Fundos Imobiliários	49,08	-0,19	-0,06	-7,65	6.504.567,01	0,5	
Total	1,66	-0,03	0,62	2,85	1.297.341.504,72	100	



GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

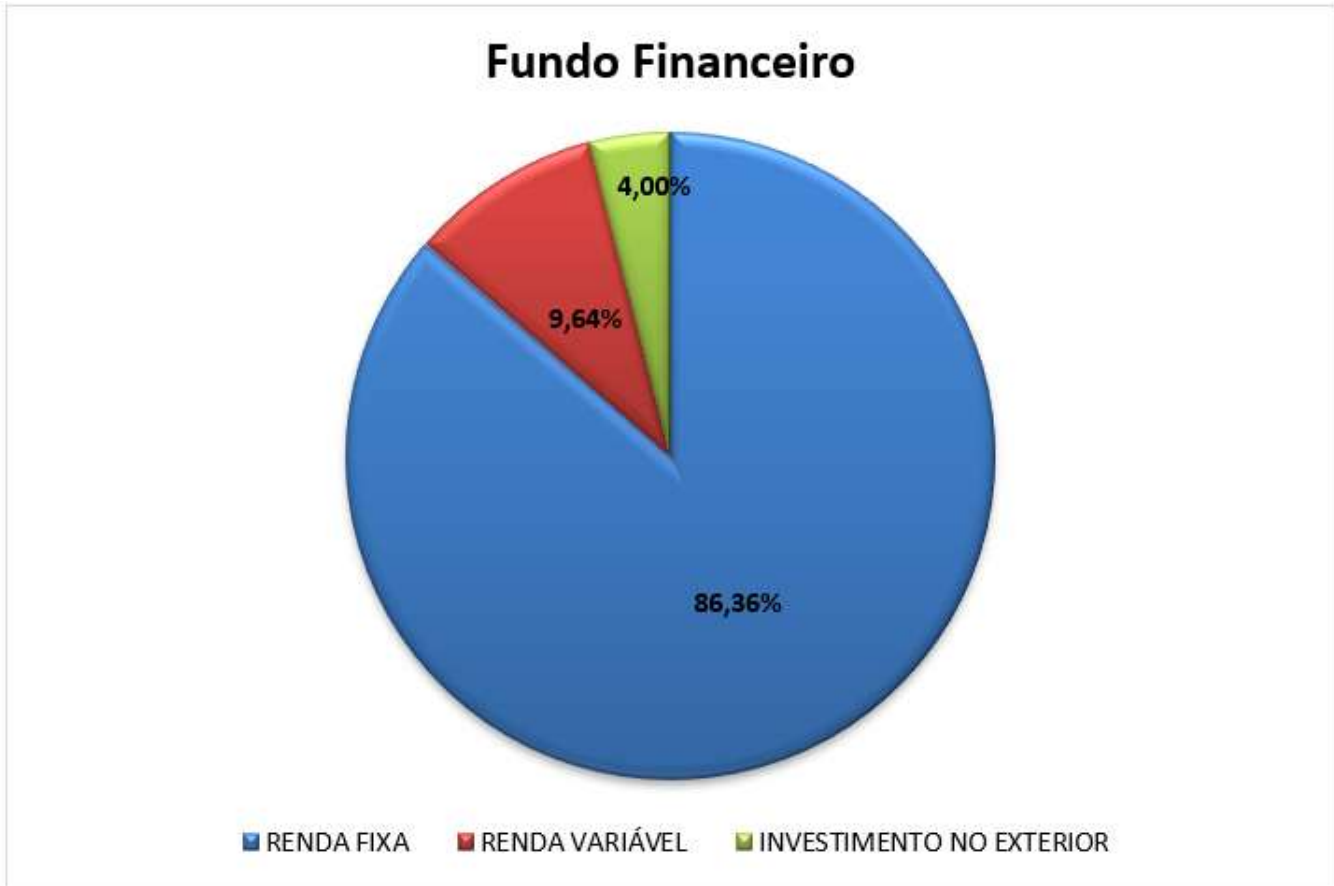
7. Rentabilidade da Carteira x Meta Atuarial – maio de 2024

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	0,60%	0,89%
TOTAL				425.868,62	18.573.037,42	35.135.067,35		2,83%	4,46%

Vê-se que no mês de maio de 2024 a GuarujáPrev teve o retorno de 0,60% e a Meta Atuarial o percentual de 0,89%. Ao longo do ano a rentabilidade da carteira foi de 2,83% e a Meta Atuarial de 4,46%.



8. Carteira de Investimentos por segmento – Fundo Financeiro





GUARUJÁPREV

(13) 3343-9050

@guarujaprevidencia

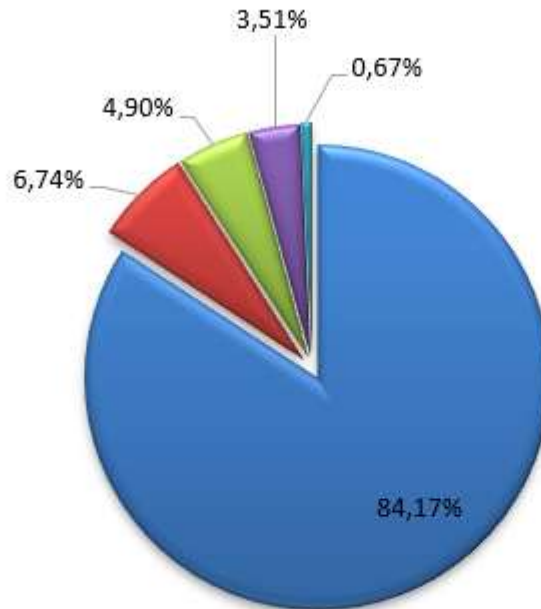
@guarujaprevidencia

guarujaprevidencia.sp.gov.br

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

9. Carteira de Investimentos por segmento– Fundo Previdenciário

Fundo Previdenciário



■ RENDA FIXA

■ RENDA VARIÁVEL

■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR

■ INVESTIMENTO ESTRUTURADO

■ FUNDOS IMOBILIÁRIOS



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 maio de 2024

ATIVIDADE	ABRIL
Elaborar relatório de aderência de carteira de investimentos	Realizado
Analisar o estudo ALM	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, 27 de junho 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



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**