

PARECER Nº 05/2023

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS REFERENTE AO MÊS DE SETEMBRO DE 2023

Este Relatório está em consonância com as disposições constantes no Manual do Pró Gestão RPPS e com o Decreto nº 3.122 de 25 de julho de 2018, que trata da criação e regulamentação do Comitê de Investimentos na Prev São José.

No dia 17 de outubro de 2023, às 09h00min, os membros do Comitê de Investimentos reuniram-se na sede da Autarquia para participar da 79ª Reunião Ordinária com o objetivo de analisar o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de Setembro de 2023.

Conforme pauta da Ata, foram analisados o enquadramento dos investimentos, análise de cenários, alocação de recursos novos o resultado do retorno de investimentos até o mês. Ainda, foi solicitada a Minuta da Política de Investimentos para 2024.

De acordo com o relatório de investimentos apresentado e elaborado pela Empresa Crédito e Mercado Consultoria de Investimentos, o qual contempla todos os itens da pauta, a carteira obteve o retorno percentual no mês de 0,00% ficando o retorno total da carteira no período (janeiro a setembro) em 9,07% e R\$ 132.277.325,88, sendo que no segmento de renda fixa o retorno foi de 0,00%, renda variável 0,36% e no segmento de Investimento no exterior a carteira teve retorno de -3,47%, a carteira de Investimentos da PREV SÃO JOSÉ fechou o mês com o PL total de R\$ 1.592.807.898,00, o IPCA teve uma variação no mês de 0,26%, com isso a meta atuarial para o período (janeiro a setembro) ficou em 7,34% com 123,59% de atingimento da meta para o período, a Consultoria indicou que a carteira da PREV SÃO JOSÉ, está com diversificação muito boa e com proteção adequada para o momento, com 87,50% em renda fixa, 11,39% renda variável e 1,11% de Investimentos no Exterior, os fundos atrelados ao IMAB-5+ tem a maior concentração da carteira, com 17,62%, seguido do CDI com 15,55% e dos fundos IMAB-5, com 15,65%. Todos os investimentos estão enquadrados tanto na Resolução de Investimentos quanto na Política de Investimentos aprovada em 31 de dezembro de 2022.

A consultoria sugeriu direcionar a alocação de recursos novos em títulos atrelados em IMAB ou ainda, alocar em renda variável no ativo estratégia valor do Banco do Brasil, sendo que o mercado ainda projeta uma valorização do IBOV em 130.000 pontos até o final do ano. Com relação aos recursos já alocados sugeriu a diminuição da exposição no curto prazo e direcionando para renda variável no ativo estratégia valor do Banco do Brasil. Comentou também para ficarmos atentos

a oportunidades no segmento em renda fixa, como exemplo: títulos públicos e fundos de vértice, auxiliando assim o atingimento da meta para 2023. Os membros deliberaram sobre as sugestões apresentadas e após várias análises e cenários apresentados decidiram o seguinte: Diminuir a exposição em IDKA e IMAB-5 canalizando os recursos para aumentar a exposição no curto prazo (Referenciado DI). SOLICITAÇÃO DA MINUTA DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS PARA 2024.

Ainda, SOLICITAÇÃO DA MINUTA DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS PARA 2024. O consultor informou que disponibilizará a minuta até o final do mês de outubro de 2023. Foi convencionado entre o Consultor e os membros do Comitê de Investimentos que a próxima reunião do Comitê de Investimentos será realizada na data de 20 de novembro de 2023, momento em que o consultor, de forma presencial na Prev São José, apresentará a política ao comitê de investimentos.

Assim sendo os Membros do Comitê de Investimentos, após análise do relatório apresentado, avaliaram que os recursos estão aplicados de acordo com a legislação vigente, estão aderentes ao que foi proposto na Política de Investimentos e a rentabilidade está em linha com o mercado, desta forma encaminha-se o presente ao Conselho Fiscal com parecer pela sua APROVAÇÃO.

LUIZ CARLOS BONATO
Presidente do Comitê

PAULO CESAR MAGNUSKEI
Membro

IVO CETNARSKI
Membro

IVAN FERREIRA DE MELO
Vice-Presidente