

PARECER Nº 06/2023

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO 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 novembro de 2023, às 09h00min, os membros do Comitê de Investimentos reuniram-se na sede da Autarquia para participar da 80ª Reunião Ordinária com o objetivo de analisar o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de Outubro de 2023 e Apresentação da Política de Investimentos para 2024.

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 apresentada pelo Assessor de Investimentos da Crédito e Mercado a Política de Investimentos para 2024 e aprovada pelos membros do Comitê de Investimentos.

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 -0,32% ficando o retorno total da carteira no período (janeiro a outubro) em 8,72% e R\$ 127.240.450,48, sendo que no segmento de renda fixa o retorno foi de 0,00%, renda variável -2,64% e no segmento de Investimento no exterior a carteira teve retorno de -1,47%, a carteira de Investimentos da PREV SÃO JOSÉ fechou o mês com o PL total de R\$ 1.593.267.072,26, o IPCA teve uma variação no mês de 0,24%, com isso a meta atuarial para o período (janeiro a outubro) ficou em 8,03% com 108,60% 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 87,82% em renda fixa, 11,09% renda variável e 1,09% de Investimentos no Exterior. Os fundos atrelados ao CDI tem a maior concentração da carteira, com 21,06%, seguido do IMAB-5+ com 17,49% e dos fundos IMAB-5, com 12,46%. 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 IDKA 2 A. Com relação aos recursos já alocados sugeriu a manutenção das aplicações, sem movimentações. 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.

Ainda, O senhor Victor Hugo Gomes, Assessor de Investimentos da Crédito e Mercado apresentou, presencialmente, aos membros do Comitê de Investimentos a minuta da Política de Investimentos para 2024, elaborada com base na Resolução CMN nº 4.963/2021 e suas alterações, contendo os segmentos e limites estabelecidos para alocação dos recursos da PREV SÃO JOSÉ, e, na sequência, foi desfazendo dúvidas quanto aos limites e segmentos constantes na apresentação, sendo que os mesmos foram ajustados, de acordo com o perfil da carteira da PREV SÃO JOSÉ. Por fim, ficou convencionado que a Política de Investimentos será apresentada, para apreciação e homologação, ao Conselho de Administração, no dia 29 de novembro.

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

ausente
IVO CETNARSKI
Membro

IVAN FERREIRA DE MELO
Vice-Presidente