

PARECER Nº 07/2023

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS REF AO MÊS DE NOVEMBRO 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 15 de dezembro de 2023, às 09h00min, os membros do Comitê de Investimentos reuniram-se na sede da Autarquia para participar da 81ª Reunião Ordinária com o objetivo de analisar o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de Novembro 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.

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 2,65% ficando o retorno total da carteira no período (janeiro a novembro) em 11,60% e R\$ 169.468.568,32, sendo que no segmento de renda fixa o retorno foi de 1,75%, renda variável 9,43% e no segmento de Investimento no exterior a carteira teve retorno de 6,31%, a carteira de Investimentos da PREV SÃO JOSÉ fechou o mês com o PL total de R\$ 1.637.066.511,94, o IPCA teve uma variação no mês de 0,28%, com isso a meta atuarial para o período (janeiro a novembro) ficou em 8,76% com 132,52% 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 87,07% em renda fixa, 11,81% renda variável e 1,13% de Investimentos no Exterior. Os fundos atrelados ao CDI tem a maior concentração da carteira, com 21,37%, seguido do IMAB-5+ com 17,00% e dos fundos IMAB-5, com 12,25%. Todos os fundos da carteira da PREV SÃO JOSÉ estão enquadrados nos limites previsto na Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021. 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.

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