

PARECER Nº 11/2024

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS REF AO MÊS DE MARÇO DE 2024

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 19 de abril de 2024, às 09h00min, os membros do Comitê de Investimentos reuniram-se na sede da Autarquia para participar da 85ª Reunião Ordinária com o objetivo de analisar o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de março de 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.

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 0,46% ficando o retorno total da carteira no período (janeiro a março) em 1,28%, sendo que no segmento de renda fixa o retorno foi de 0,51%, renda variável -0,14% e no segmento de Investimento no exterior a carteira teve retorno de 3,01%, a carteira de Investimentos da PREV SÃO JOSÉ fechou o mês com o PL total de R\$ 1.707.123.715,60, o IPCA teve uma variação no mês de 0,16%, com isso a meta atuarial para o período (janeiro a março) ficou em 2,61% com 48,86% 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 87,11% em renda fixa, 11,62% renda variável e 1,27% de Investimentos no Exterior. Os fundos atrelados ao CDI tem a maior concentração da carteira, com 20,11%, seguido do IMAB-5+ com 16,70% e dos fundos IMAB-5, com 12,10%. 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.

Com relação aos recursos novos a consultoria sugeriu para ficarmos atentos a oportunidades no segmento em renda fixa, no médio e curto prazo, aproveitando assim taxas atrativas oferecidas pelos bancos no período, como exemplo: Letra Financeira com vencimento para 5 anos e Título Público com vencimento em 15/08/2024. Sobre a Letra Financeira sugeriu alocar aproximadamente 5% da nossa Carteira, realocando recursos do IMAB-5, do DI, do IRFM e do IDKA para fazer frente a essa nova aplicação. Com relação aos recursos aplicados em Pré Fixados e Renda Variável sugeriu que não haja mudança. Após deliberação, os

membros do conselho decidiram acatar as sugestões da consultoria alocando, no fundo Previdenciário, R\$ 100.000.000,00 em Letra Financeira e R\$ 50.000.000,00 no fundo CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RF VÉRTICE ambos na Caixa Econômica Federal. Para fazer frente a esse investimento foi convencionado resgates na seguinte ordem: R\$ 30.000.000,00 do CAIXA FI BRASIL IRF-M TP RF LP, R\$ 20.000.000,00 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1, para aplicação no CAIXA BRASIL VÉRTICE 2024 X TP RF e resgate de R\$ 100.000.000,00 do fundo CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI TP RF, para aplicação em LETRA FINANCEIRA DA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL.

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