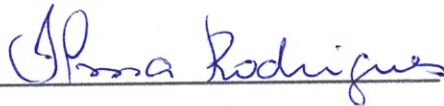


Ata de reunião extraordinária do mês de julho – 26/07/2023
Comitê de Investimentos do Comendador Levy Gasparian Prev

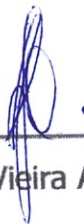
Aos vinte e seis dias do mês de julho do ano de dois mil e vinte e três, em cumprimento ao que determina a Lei 811/2013 e suas alterações, reuniram-se presencialmente os servidores membros do Comitê, Sra. Ilma Rodrigues, Sra. Jaqueline Cabral de Azevedo e Sr. José Luiz Vieira Assumpção. Pauta da reunião: término da elaboração do Relatório dos Investimentos do mês de junho de 2023 e Edital de Credenciamento das Instituições Financeiras. Iniciada a reunião, o Comitê de Investimentos deu prosseguimento à elaboração do Relatório de Investimentos adicionando informações referentes aos cenários econômicos nacional e internacional, bem como adicionando considerações da Consultoria de Investimentos Crédito & Mercado sobre o mesmo assunto. Após isso, o colegiado analisou os demais pontos do Relatório, finalizando-o. Em virtude da nomeação interina da servidora Raquel Zacarone para o cargo de Diretora Presidente do Levy Prev, o Comitê retomou o diálogo com a Diretoria Executiva a respeito do Edital de Credenciamento de Instituições. Foi informado que o Levy Prev dará início à elaboração do referido Edital. Não havendo mais nada a tratar no momento, a reunião foi encerrada.



Ilma Rodrigues



Jaqueline Cabral de Azevedo



José Luiz Vieira Assumpção

RELATÓRIO MENSAL

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Junho/2023



Sumário

Objetivo.....pág. 03
Cenário econômico.....pág. 03
Aplicações orientadas pelo Comitê de Investimentos.....pág. 05
Carteira de investimentos e enquadramentos por segmentos.....pág. 05
Retornos obtidos no mês.....pág. 06



Objetivo

Este relatório objetiva demonstrar as atividades realizadas pelo Comitê de Investimentos no mês de junho de 2023, bem como facilitar o acompanhamento da evolução do Plano de Benefícios do Levy Prev e cumprir exigências do Programa Pró Gestão RPPS.

Cenário econômico

O Comitê de Investimentos do Levy Prev destaca acontecimentos da economia global que podem influenciar nos investimentos deste RPPS.

Cenário internacional:

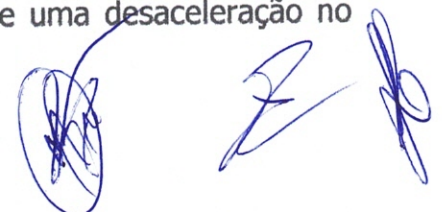
Nos Estados Unidos, os preços ao consumidor aumentaram de forma moderada em junho, registrando o menor aumento anual em mais de dois anos. Além disso, os dados mais recentes mostraram que o núcleo da inflação foi menor do que o esperado.

O Comitê Federal de Mercado Aberto (FOMC), do Federal Reserve (Fed), decidiu manter as taxas de juros dos EUA no intervalo entre 5% e 5,25%.

Na Zona do Euro, os dados indicam uma desaceleração na atividade econômica, afetando tanto o setor industrial quanto o de serviços.

Na Ásia, os dados mostram uma desaceleração na atividade do setor de serviços da China, assim como no setor composto, que engloba outros setores econômicos. Essa queda pode indicar uma redução no ritmo de crescimento econômico do país.

O Banco Central da China tomou a decisão de reduzir seus principais índices de referência de taxas de juros como resposta aos desafios econômicos que o país está enfrentando, incluindo os impactos da pandemia da Covid-19 e uma desaceleração no setor imobiliário.



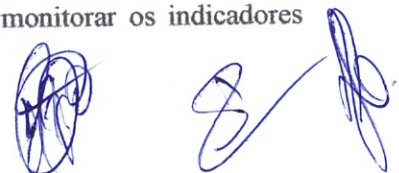
A Consultoria de Investimentos Crédito & Mercado destacou os seguintes pontos em sua conclusão sobre o mês de junho:

“É possível observar no cenário internacional que há sinais de desaceleração da inflação nos Estados Unidos, o que pode resultar influenciar nas decisões sobre taxas de juros pelo Federal Reserve. Além disso, a atividade econômica nos EUA também mostrou enfraquecimento, evidenciado pela queda nos índices de gerentes de compras (PMIs). Na zona do euro, a taxa de inflação também apresentou desaceleração, principalmente devido à redução nos preços da energia. Além disso, a atividade econômica na região registrou uma desaceleração, conforme indicado pelos índices de PMIs compostos.

No âmbito nacional, a atividade econômica brasileira registrou uma queda de 2% em maio, de acordo com o IBC-Br, sinalizando um desempenho desfavorável. No entanto, houve um saldo positivo na geração de empregos, com a criação de 155,27 mil postos de trabalho com carteira assinada em maio. A inflação, medida pelo IPCA, apresentou uma deflação de 0,08% em junho, indicando uma desaceleração nos preços. O Copom decidiu manter a taxa básica de juros em 13,75% ao ano, mas sinalizou a possibilidade de iniciar o processo de redução das taxas a partir de agosto. Além disso, houve mudanças no regime de metas de inflação, o que foi bem recebido pelo mercado.

No mercado financeiro, os índices relacionados à renda fixa apresentaram desempenho positivo, com destaque para o IDkA 20A (IPCA) e o IMA-B 5+. Na bolsa de valores, o Ibovespa teve um mês de forte alta, impulsionado por perspectivas de melhora na política monetária e fiscal. Nos Estados Unidos, os principais índices de ações também registraram ganhos.

Para os próximos meses, as perspectivas estão sujeitas a diversos fatores, como o desempenho inflacionário, a atividade econômica global e as decisões de política monetária dos bancos centrais. No Brasil, espera-se uma possível redução nas taxas de juros, conforme indicado pelo Copom, o que pode influenciar positivamente a economia. No entanto, é importante monitorar os indicadores



econômicos e a conjuntura internacional, que podem impactar os mercados e a dinâmica da economia brasileira.”

Aplicações orientadas pelo Comitê de Investimentos

O Comitê de Investimentos não orientou realocações na carteira de investimentos do Levy Prev no mês de junho em razão do término de mandato de dois de seus membros e incerteza quanto à manutenção dos mesmos no colegiado, bem como por não existirem desenquadramentos e posições desfavoráveis para o momento.

Carteira de investimentos e enquadramentos por segmentos

Para o mês de junho, o total da Carteira de Investimentos do Levy Prev foi de R\$ 33.840.454,47 sendo distribuídos em R\$ 24.093.825,61 em Renda Fixa, R\$ 8.230.119,14 em Renda Variável e R\$ 1.516.509,72 em Investimentos no Exterior.

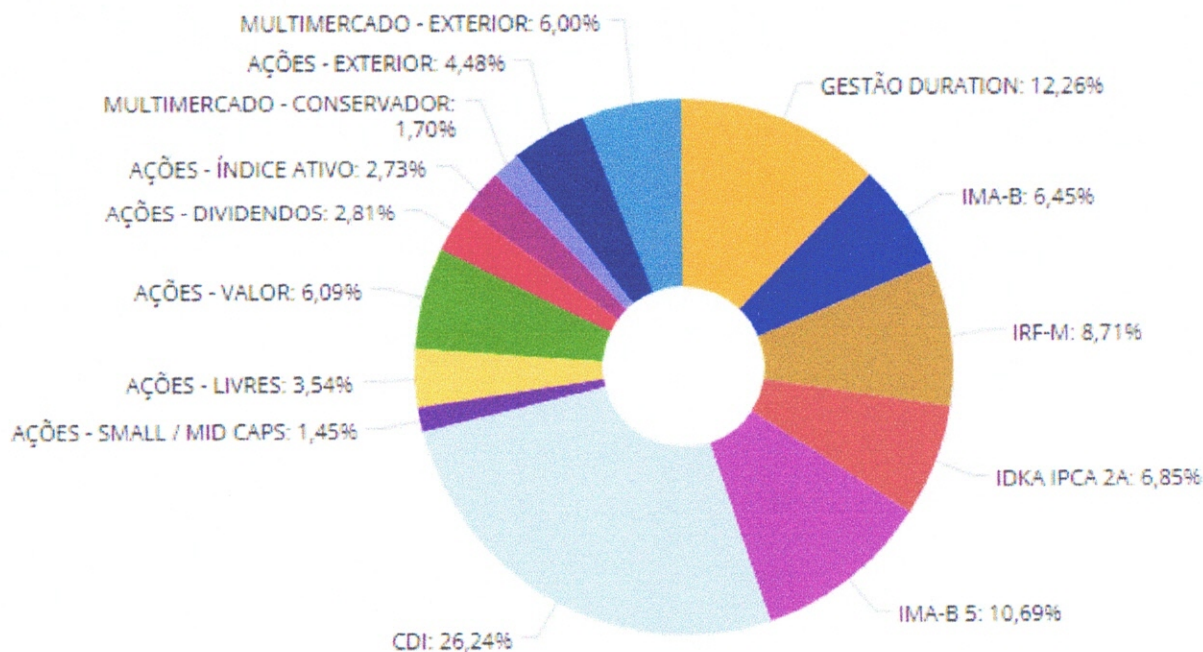
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,02%	61,95%	27.732.252,44
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	9.347.209,73	27,62%	20,48%	21,82%	61,95%	18.385.042,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	14.746.615,85	43,58%	20,88%	22,36%	60,00%	5.557.656,80
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	6.758.090,89
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.692.022,72
Total Renda Fixa	100,00%	24.093.825,61	71,20%	41,36%	68,00%	248,90%	

Artigos - Renda Variável - Estruturado - Fundo Imobiliário	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.625.484,01	16,62%	17,00%	19,00%	20,00%	1.142.606,88
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.604.635,13	7,70%	3,75%	7,00%	10,00%	779.410,32
Total Renda Variável / Estruturado / Fundo Imobiliário	30,00%	8.230.119,14	24,32%	20,75%	26,00%	30,00%	

Artigos Exterior	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite -			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.516.509,72	4,48%	0,00%	5,00%	10,00%	1.867.535,73
Total Exterior	10,00%	1.516.509,72	4,48%	0,00%	5,00%	10,00%	

Todos os investimentos do Levy Prev estão devidamente enquadrados nos limites legais da Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 4.963/2021.





Retornos obtidos no mês

O retorno obtido no mês de junho de 2023 foi de +2,74% frente à meta do mês de +0,32%. O retorno acumulado em 2023 atualmente é de +7,86% frente à meta acumulada de +5,30%.

Investimentos x Meta de Rentabilidade

