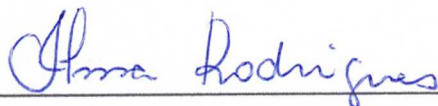


Ata de reunião extraordinária do mês de outubro – 19/10/2023

Comitê de Investimentos do Comendador Levy Gasparian Prev

Aos dezanove dias do mês de outubro 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: leitura do panorama dos investimentos disponibilizado pela Consultoria de Investimentos Crédito & Mercado, término do relatório dos investimentos e reunião com o Sr. Victor Gomes, Consultor de Investimentos do Levy Prev. Iniciada a reunião, o Comitê realizou a leitura do panorama dos investimentos disponibilizado pela Consultoria de Investimentos. Após, os membros do colegiado discutiram sobre pontos importantes relativos ao cenário econômico que têm relação direta com a carteira de investimentos do Levy Prev. Destacaram os seguintes: novo corte da taxa de juros realizado pelo Banco Central, expectativas sobre a taxa de juros até o final do ano, impacto sofrido pelo segmento da Renda Variável por conta da abertura da taxa de juros e incertezas quanto à discussão da reforma tributária no âmbito nacional, oscilações na Renda Fixa e fechamento do dólar. O Relatório do mês foi preenchido com essas informações e também foi adicionada a conclusão e perspectivas da Consultoria de Investimentos em adição às pontuações do Comitê. Foram inseridas informações quanto a aplicação orientada à Diretoria Executiva no mês de setembro e com isso o Relatório dos Investimentos do mês de setembro foi finalizado. Devido a um imprevisto, o Comitê necessitou remarcar a reunião com o Sr. Victor Gomes, que estava agendada para as 10h para as 16h. Nessa reunião, será discutido quanto às oportunidades e possibilidades de investimentos, em especial quanto ao subsegmento IMA-B (Renda Fixa) e Renda Variável. Não havendo mais nada a tratar no momento, a reunião foi encerrada.



Ilma Rodrigues



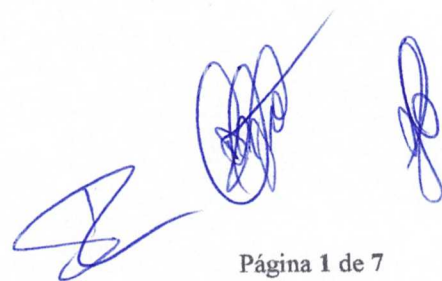
Jaqueline Cabral de Azevedo



José Luiz Vieira Assumpção

RELATÓRIO MENSAL COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Setembro/2023

Three blue ink signatures are present in the bottom right corner of the page. The first signature is on the left, the second is in the middle and appears to be a circular stamp or a very dense signature, and the third is on the right.

Sumário

Objetivo.....pág. 03
Cenário econômico.....pág. 03
Aplicações orientadas pelo Comitê de Investimentos.....pág. 04
Carteira de investimentos e enquadramentos por segmentos.....pág. 04
Retornos obtidos no mês.....pág. 06

Three handwritten signatures in blue ink are located in the bottom right corner of the page.

Objetivo

Este relatório objetiva demonstrar as atividades realizadas pelo Comitê de Investimentos no mês de **setembro** 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 os seguintes pontos a respeito do cenário econômico do mês de **setembro** no contexto da carteira de investimentos:




No dia 20/09/2023, o Banco Central realizou mais um corte da taxa de juros, chegando em 12,75% ao ano. Além desse corte que já era esperado, espera-se que até o final de 2023 alcance 11,75% ao ano.

A carteira de investimentos do Levy Prev performou negativamente com destaque para a Renda Variável por conta principalmente de influência vinda do exterior. Houve uma abertura da curva de juros que impactou fortemente o mercado de renda variável. Em adição a isso, existem muitas incertezas por parte do mercado a respeito da discussão da reforma tributária.

Em Renda Fixa, a curva de juros também impactou os indicadores como IMA-B e IMA-B 5, prejudicando seus retornos no mês.

Quanto ao dólar, a moeda vem exercendo pressão não somente sobre o real brasileiro, mas também sobre a maioria das moedas estrangeiras. No mês de setembro, o dólar fechou em R\$ 5,04.

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



“Em linha com a preocupação com a trajetória fiscal, o mercado segue preocupado e atento frente a possibilidade de votação do projeto de lei referente a tributação de fundos exclusivos e offshore.

O governo, para fechar as contas no azul, não parece querer adotar medidas para enxugamento dos gastos, portanto, a solução criada passa a ser a de maximizar a receita através da otimização de arrecadação tributária.

A efetividade e os efeitos dessas novas medidas devem ser sentidos de maneira mista ao longo dos meses.

Para o exterior, é esperado a manutenção do atual nível de juros por um período mais longo do que o inicialmente planejado, e portanto, trazendo desafio para as moedas dos demais países, e o fortalecimento do dólar.

No radar, é válido se manter informado e monitorando todos os indicadores que podem antecipar os movimentos do Federal Reserve.

Em especial, os indicadores de inflação (através do PCE, principal indicador utilizado pelo FED), além dos indicadores do mercado de trabalho, como índice Jolts e Nonfarm Payroll, além dos indicadores de crescimento econômico.




Nas últimas semanas de outubro, teremos a divulgação do PMI de diversos países, além dos dados de desemprego da Inglaterra, dado de venda de imóveis nos EUA, PCE dos EUA, IPCA-15 de outubro no dia 25, entre outros acontecimentos.”

Aplicações orientadas pelo Comitê de Investimentos

O Comitê de Investimentos orientou à Diretoria Executiva do Levy Prev:

- Direcionamento de R\$ 1.500.000,00 do Fundo de Investimento BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 13.077.415/0001-05) para o Fundo BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP (CNPJ: 13.077.418/0001-49).

A movimentação entre fundos do subsegmento CDI visa menor taxa de administração e conseqüentemente melhores retornos. A movimentação não altera a composição da carteira de investimentos.



Página 4 de 7

Para essa movimentação, o Comitê se atentou ao limite legal de 20% do Patrimônio Líquido do Levy Prev para um único fundo de investimento. Após a movimentação, o Levy Prev ficaria com percentual aproximado de 17% no referido Fundo.

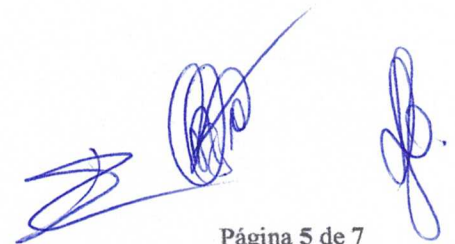
A movimentação ainda não foi realizada.

Carteira de investimentos e enquadramentos por segmentos

Para o mês de **setembro**, o total da Carteira de Investimentos do Levy Prev foi de R\$ 34.094.519,46 sendo distribuídos em R\$ 24.519.072,66 em Renda Fixa, R\$ 8.027.885,12 em Renda Variável e R\$ 1.547.561,68 em Investimentos no Exterior.

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	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%	18,82%	81,95%	27.940.458,70
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	9.393.871,69	27,55%	20,48%	21,82%	81,95%	18.546.587,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	15.125.200,97	44,36%	20,88%	22,36%	60,00%	5.331.510,71
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	6.818.903,89
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.704.725,97
Total Renda Fixa	100,00%	24.519.072,66	71,91%	41,36%	68,00%	248,90%	

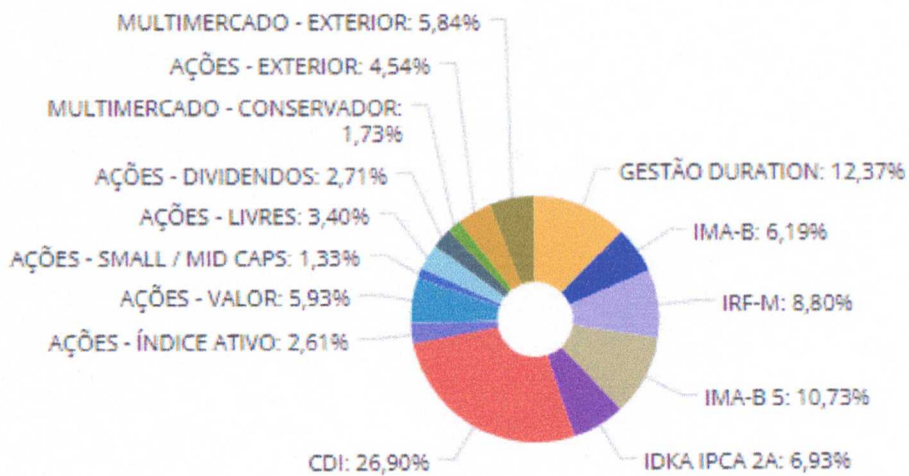
Artigos - Renda Variável Estruturado - Fundo Imobiliário	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.447.205,25	15,98%	17,00%	19,00%	20,00%	1.371.698,64
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.580.679,87	7,57%	3,75%	7,00%	10,00%	828.772,08
Total Renda Variável / Estruturado / Fundo Imobiliário	30,00%	8.027.885,12	23,55%	20,75%	26,00%	30,00%	



Artigos Exterior	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação - Limite -			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.547.561,68	4,54%	0,00%	5,00%	10,00%	1.861.890,27
Total Exterior	10,00%	1.547.561,68	4,54%	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.

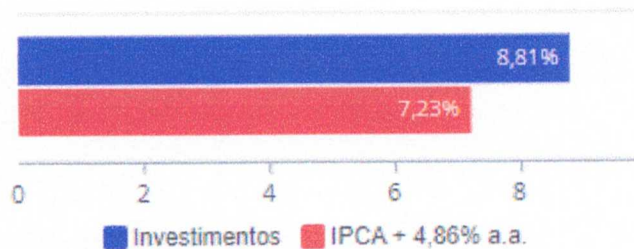
O gráfico a seguir demonstra a distribuição em percentual entre os subsegmentos que compõem a carteira de investimentos.



Retornos obtidos no mês

O retorno obtido no mês de **setembro** de 2023 foi de -0,20% frente à meta do mês de +0,64%. O retorno acumulado em 2023 atualmente é de +8,81% frente à meta acumulada de +7,23%.

Investimentos x Meta de Rentabilidade



(Assinaturas manuscritas)

Evolução do Patrimônio



Ilma Rodrigues

Ilma Rodrigues

Presidente do Comitê de Investimentos

Jaqueline Cabral de Azevedo

Jaqueline Cabral de Azevedo

Membro do Comitê de Investimentos

José Luiz Vieira Assumpção

José Luiz Vieira Assumpção

Membro do Comitê de Investimentos