

Ata de reunião extraordinária do mês de maio – 27/05/2024
Comitê de Investimentos do Comendador Levy Gasparian Prev

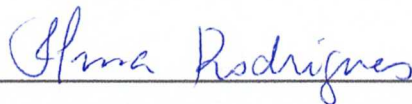
Aos vinte e sete dias do mês de maio do ano de dois mil e vinte e quatro, em cumprimento ao que determina a Lei 811/2013 e suas alterações, reuniram-se presencialmente os servidores membros do Comitê, Sra. Ilma Rodrigues, Sra. Jaqueline Cabral de Azevedo e Sr. José Luiz Vieira Assumpção.

Pauta: elaboração do relatório dos investimentos referente ao mês de abril de 2024; recomendação para a carteira de investimentos do Levy Prev.

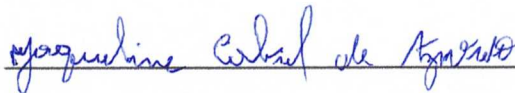
A reunião iniciou às 10:00. O Comitê de Investimentos ouviu o áudio do "Momento RPPS", *podcast* que apresentou breve resumo sobre a análise semanal de mercado e os impactos no mundo RPPS, com destaques no exterior, ata do FOMC, PMI da Zona do Euro e mercado imobiliário chinês, e no Brasil, com destaques nos auxílios ao Rio Grande do Sul, isenções tributárias e reforma tributária. Em seguida, o Comitê discutiu sobre a recomendação de realocação de recursos do subsegmento IRF-M para o subsegmento Gestão *Duration*, ambos de Renda Fixa. Foi realizada a comparação entre os fundos que o Levy Prev possui em carteira visando encontrar a melhor opção entre estes. Foram comparados os fundos: BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO, CNPJ: 35.292.588/0001-89; CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA, CNPJ: 23.215.097/0001-55; e ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA, CNPJ: 21.838.150/0001-49 na plataforma Mais Retorno (o relatório está anexo à ata). Constatou-se que o fundo BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO apresentou melhores retornos com menores riscos associados. O Comitê elaborou o Memorando nº 012/2024/CI, que trata da recomendação à Diretoria Executiva de realocação de R\$ 1.000.000,00 (um milhão de reais) do fundo BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 07.111.384/0001-69) e alocação dessa quantia no fundo BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 35.292.588/0001-89). O Comitê analisou os resultados do mês de abril, que foram de -0,83% frente à meta do mês de 0,82%. A carteira está devidamente enquadrada nos limites legais. Em seguida, o Comitê elaborou

o relatório de investimentos referente ao mês de abril de 2024 elencando pontos como o cenário econômico disponibilizado pela Consultoria Crédito & Mercado, síntese das aplicações orientadas no mês de abril pelo Comitê de Investimentos e seus motivadores, total da carteira de investimentos e enquadramentos por segmentos, distribuição da carteira em subsegmentos e em Instituições Financeiras, e, por fim, os retornos obtidos no mês.

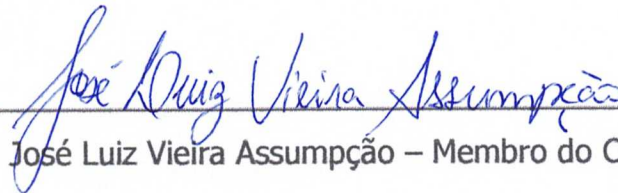
A reunião foi encerrada às 11:28 e eu, José Luiz Vieira Assumpção, lavrei a presente ata, que após lida e aprovada, será assinada pelos integrantes do Comitê de Investimentos.



Ilma Rodrigues – Membro do Comitê

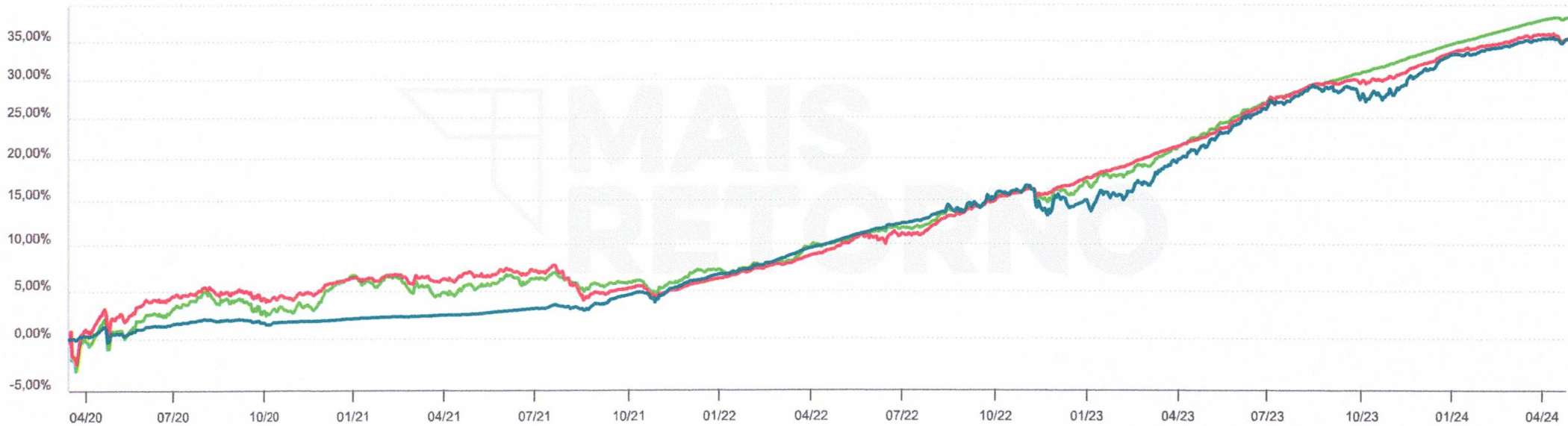


Jaqueline Cabral de Azevedo – Presidente do Comitê



José Luiz Vieira Assumpção – Membro do Comitê

BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI



Última atualização 23/05/2024.

Rentabilidade histórica ⓘ

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOC...	0,56%	3,27% 🏆	1,75% 🏆	4,48% 🏆	11,64% 🏆	25,35% 🏆	31,59%
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃ...	0,54%	2,02%	1,05%	3,48%	9,84%	23,02%	27,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇ...	0,67% 🏆	2,04%	1,24%	4,21%	10,17%	22,28%	32,35% 🏆

Consistência ⓘ

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOC...	41 (80,39%)	10 (19,61%)	2,70% 🏆	-1,05%
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃ...	42 (82,35%)	9 (17,65%)	2,10%	-1,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇ...	43 🏆 (84,31%)	8 🏆 (15,69%)	2,60%	-1,03% 🏆

Índice de Sharpe ⓘ

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOC...	-0,54 🏆	-0,09 🏆
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃ...	-1,54	-0,29
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇ...	-0,73	-0,36

Volatilidade ⓘ

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOC...	0,82% 🏆	3,22%
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃ...	1,46%	2,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇ...	2,64%	2,48% 🏆

Gráfico de Correlação ⓘ

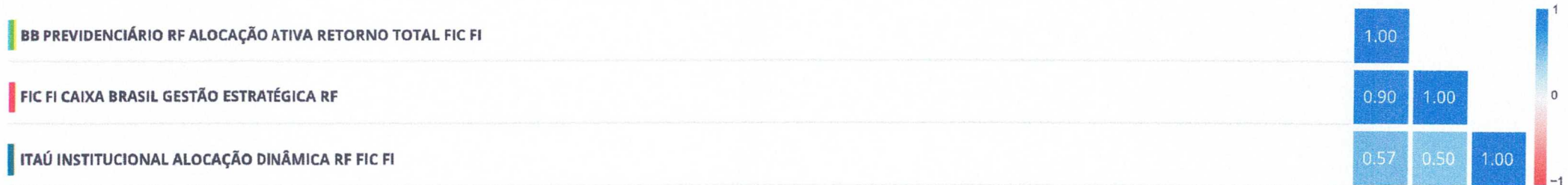
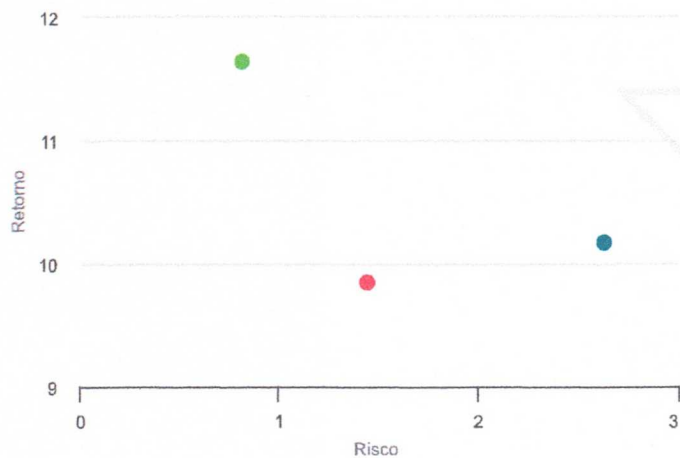
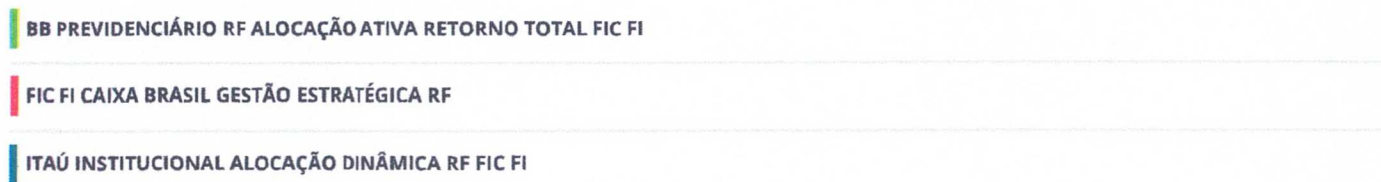


Gráfico de Risco X Retorno ⓘ



MAIS
RETORNO