

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL
DO MUNICÍPIO DE MACAÉ
MACAEPREV**



ABRIL - 2024



SUMÁRIO

1. INTRODUÇÃO	4
2. CENÁRIO ECONÔMICO.....	4
3. RESULTADO DA CARTEIRA.....	8
4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA.....	14
4.1. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024.....	14
4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA	15
4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	16
5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES.....	17
6. MONITORAMENTO DE RISCOS	17
6.1. ART. 7º, INCISO I, “A” – TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOUREO NACIONAL	17
6.2. ART. 7º, INCISO I, “B” – FUNDOS DE RENDA FIXA 100% EM TP.....	18
6.3. ART. 7º, INCISO III, “A” – FUNDOS DE RENDA FIXA CVM.....	18
6.4. ART. 8º, INCISO I – FUNDOS DE AÇÕES	19
6.5. ART. 9º, INCISO II – FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19
6.6. ART. 9º, INCISO III – FUNDOS DE AÇÕES – BDR NÍVEL I.....	20
6.7. ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO.....	20
7. ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS E VALUE AT RISK (VaR)	21
8. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	22
8.1. RENTABILIDADE	22
8.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024.....	22
8.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA	22
8.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	23
9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021	24
9.1. RENTABILIDADE	24
9.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024.....	24
9.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA	25
9.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	26
10. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022	26
10.1. RENTABILIDADE	26
10.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024.....	26
10.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA	27
10.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	27
11. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023	28
11.1. RENTABILIDADE.....	28
11.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024.....	28
11.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA	28
11.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	29
12. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2024	29
12.1. RENTABILIDADE.....	29
12.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024.....	29
12.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA	30



**Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social**



12.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	30
13. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES	31
13.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS.....	31
13.2. CUSTO SELIC PARA OS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS.....	32
14. CONCLUSÃO.....	33



1. INTRODUÇÃO

Mantendo elevados níveis de transparência e para manter boa comunicação junto aos servidores e munícipes, o Instituto de Previdência Social do Município de Macaé – Macaeprev apresenta o relatório de investimentos, referente ao mês de abril de 2024.

Neste relatório é possível observar a consolidação de todas as informações relativas ao período de referência, incluindo o cenário econômico, os resultados alcançados em relação às metas estabelecidas, o comportamento dos ativos financeiros que compõe a carteira de investimentos do Macaeprev, inclusive quanto aos indicadores de desempenho e gerenciamento de riscos.

2. CENÁRIO ECONÔMICO

No mês de abril, tivemos resultados negativos nas carteiras de investimentos. A economia global enfrenta incertezas decorrentes de conflitos geopolíticos e condições de financiamento restritas.

No front geopolítico, a tensão no oriente médio continua com o conflito entre Israel e Hamas e a incursão de rebeldes “houthis” do Iêmen no Mar Vermelho, com reflexos no frete marítimo no canal de Suez, a principal via entre o principal porto do Mundo (Roterdã) e a Ásia. Além da guerra da Ucrânia completar 26 meses sem perspectiva de avanço nas negociações diplomáticas.

Nos EUA, em abril, continuamos a ver postergação das expectativas do ciclo de corte dos juros. Esse contexto ocorre devido aos dados expressivos de atividade econômica e mercado de trabalho. Há uma busca do Federal Reserve (Fed, sigla em inglês) para convergir a inflação para meta, pois já erraram uma vez em dizer ser passageira e agora não querem mais cometer esse erro.

A atividade econômica dos Estados Unidos esfriou em abril, atingindo o menor nível em quatro meses devido à demanda mais fraca, enquanto as taxas de inflação diminuíram ligeiramente, mesmo com o aumento acentuado dos preços dos insumos, sugerindo um possível alívio à medida que o Fed procura sinais de que a economia está enfraquecendo o suficiente para reduzir ainda mais a inflação.



**Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social**



Seguindo essa ideia, a S&P Global informou que seu Índice de Gerentes de Compras (PMI) Composto de produção dos EUA, que acompanha os setores de manufatura e de serviços, caiu de 52,1 em março para 50,9 em abril. Ou seja, um componente mostrando quase uma contração, mas ainda acima dos 50, o que indica expansão no setor privado.

Apesar da desaceleração, não significa que a economia norte americana está fraca. A primeira leitura do Produto Interno Bruto (PIB) no primeiro trimestre mostrou um crescimento de 1,6%, com expectativa de 2,9%. A peculiaridade que reduziu o apetite por risco foi a permanência da pressão sobre os preços, dado que o núcleo de inflação medida trimestralmente pelo índice de preços (PCE, sigla em inglês) subiu de 2,0% para 3,7%.

Diante do contexto, o Fed decidiu pela manutenção dos juros entre 5,25% e 5,50%. No entanto, o Comitê Federal de Mercado Aberto (FOMC) decidiu por reduzir o ritmo de participação em títulos públicos, sendo tratada como uma política mais branda, pois permite maior circulação de dólar. Ademais, o Índice de Custo do Emprego (ECI) aumentou 1,2% no primeiro trimestre deste ano e os salários aumentaram 1,1%. Os dados ficaram acima do projetado, o que indica mais obstáculos para o arrefecimento da inflação e, conseqüentemente, reforçam a permanência de juros terminais elevados.

No âmbito da inflação, a avaliação é que ela diminuiu ao longo do ano passado, mas permanece elevada. Conforme o balanço de riscos, o Comitê considera que os riscos para alcançar os seus objetivos de emprego e inflação evoluíram para um melhor equilíbrio ao longo do ano passado, mas que as perspectivas econômicas são incertas, necessitando de contínua atenção aos riscos de inflação, reforçando ao final uma postura dependente dos dados.

Sobre os dados de mercado de trabalho, a economia norte americana criou +175 mil vagas líquidas de emprego não-agrícola em abril, número abaixo da expectativa de mercado (+238 mil). Em relação ao mês anterior, houve uma desaceleração na criação de empregos e observou-se um aumento de 63 mil nos indivíduos fora da força de trabalho.

Na China, por sua vez, o People's Bank of China (PBoC) informou que manteve estáveis as suas taxas de empréstimo (Loan Prime Rate - LPR), com a taxa de um ano em 3,45% e a de 5 anos em 3,95%, conforme amplamente esperado pelo mercado.

A produção industrial na China reduziu de 7,0% (A/A) em fevereiro para 4,5% (A/A) em março, vindo abaixo do consenso de mercado, que previa um crescimento de 6,0% (A/A).



**Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social**



Destaque para a fabricação de equipamentos e maquinários elétricos (8,6% ante 5,6% A/A) e na produção de energia elétrica (10,6% ante 9,6% A/A), enquanto as vendas no varejo na China reduziram de 5,5% para 3,1% (A/A) em março, número abaixo das estimativas do mercado (5,1%).

Na Zona do Euro, a economia expandiu mais do que o esperado, após o avanço de 0,3% da preliminar do PIB do primeiro trimestre deste ano. O quarto trimestre de 2023 foi revisado para contração de 0,1%, o que significa que a região saiu do processo de recessão técnica. Além disso, a preliminar do CPI cresceu 0,6% em abril e manteve o patamar de 2,4% em 12 meses.

Por outro lado, o núcleo de inflação recuou de 2,9% para 2,7%, após o setor de serviços ter menor variação dos preços. A partir de uma conjuntura em que a inflação se arrefece e a presidente do Banco Central Europeu (BCE), Christine Lagarde, sinaliza que não precisa exatamente que a inflação esteja na meta de 2,0% para começar a reduzir os juros, existem maiores chances da flexibilização da política monetária em junho.

Entretanto, o BCE manteve inalteradas suas três taxas de juros diretoras, em linha com a expectativa do mercado. Em um comunicado curto e objetivo, a autoridade monetária reconheceu que as informações estão confirmando amplamente a sua avaliação anterior, com a inflação continuando a ceder impulsionada principalmente pela desinflação de bens e alimentos.

Da mesma forma, as medidas de inflação subjacente seguem abrandando, com o crescimento salarial registrando moderação gradual e as empresas absorvendo parte do aumento dos custos do trabalho.

As condições de financiamento seguem restritivas, pesando sobre a demanda e ajudando a reduzir a inflação. Entretanto, pressões internas sobre os preços seguem fortes com a inflação de serviços ainda elevada.

No Brasil, o mês de abril foi marcado por uma tensão ainda não vista em 2024 nos mercados. Para entendermos o que ocorreu é preciso revisar os eventos do mês. No ambiente internacional, o Fed deixou claro e explícito que não há mais expectativa de início do processo de redução da taxa de juros, fazendo com que os agentes de mercado tivessem que revisar suas expectativas, e conseqüentemente preços de ativos.

E ainda no mês de abril, o Ministério da Fazenda no Brasil enviou ao Congresso a proposta de diretrizes orçamentárias para 2025 onde ele aceita que não é possível alcançar as



metas de déficit e superávit primário planejadas no orçamento do ano anterior. Os planos de equilíbrio fiscal foram vencidos pela realidade que se apresenta no país, colocando a expectativa de superávit para 2027 em 0,75% do PIB, se tudo der certo até lá.

O Índice de Atividade Econômica do Banco Central (IBC-Br) avançou 0,4% (M/M), com destaque para o avanço do varejo ampliado, queda da incerteza e alguma melhora da confiança. Em doze meses o avanço é de 2,6% A/A.

Em relação ao campo monetário, houve poucos eventos em abril, mas vale destacar a mudança de tom na comunicação do Roberto Campos Neto, que passou a enfatizar a preocupação incremental com os riscos de inflação e o aumento da incerteza, deixando a próxima decisão mais dependente de dados.

Além disso, vale citar alguns riscos específicos que podem pressionar a inflação nos próximos meses, tais como a perspectiva de manutenção da taxa de juro americana, o aumento do Dólar, o incremento dos conflitos geopolíticos pelo mundo, o aumento de preços da gasolina, mercado de trabalho robusto, atividade econômica surpreendendo positivamente e a expectativa inflacionária de 2025, que vem se distanciando um pouco mais da meta.

Por fim, o Comitê de Política Monetária (Copom) reduziu a taxa Selic em 0,25 p.p. para 10,50% a.a. A decisão não foi unânime, com cinco votos para a redução de 0,25 p.p. e quatro votos por uma votação de 0,50 p.p.

Sobre o mercado de trabalho, a taxa de desocupação cresceu para 7,9% no trimestre encerrado em março, justificado pelo maior número de pessoas buscando emprego. O rendimento médio permanece pressionado no patamar de R\$ 3.123 e deve ser considerado como um empecilho na política monetária. O Ministério do Trabalho e Emprego informou que o saldo de empregos formais (Caged) de março de 2024 foi de 244.315, surpreendendo positivamente as expectativas. O resultado refletiu 2,3 milhões de admissões e 2,0 milhões de demissões.

O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) que avançou +0,38% (M/M) em abril, acelerando em relação ao avanço de +0,16% (M/M) observado no mês anterior. A variação foi superior a projeção de mercado de +0,32%. Com isso, o índice acumulou alta de +3,69% em 12 meses (ante +3,93% em março). A maior contribuição para a variação do índice partiu do grupo Saúde e cuidados pessoais influenciado pelo aumento dos itens de Produtos farmacêuticos e óticos.



Os preços administrados avançaram +0,74% em abril ante +0,25% de março, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Produtos farmacêuticos (+2,84% ante -2,21%), influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Ônibus intermunicipal (+0,75%).

Já os preços livres aceleraram para +0,26% ainda se mantendo como os principais vetores do IPCA. Por outro lado, os serviços desaceleraram de +0,1% para +0,05%. O IGP-M de abril foi ao terreno positivo, ao sair de -0,46% para 0,31% (M/M). Nas aberturas, destaque principalmente para a aceleração da soja (-0,47% para 5,66%), além dos preços do café (0,62% para 9,57%). Além disso, vale citar Alimentação (0,68% para 0,83% M/M) e aumento dos custos de mão-de-obra com os trabalhadores da construção civil (0,23% para 0,74%). Entre as influências negativas, destaque para o minério de ferro (-13,27% para -4,78%). No acumulado em 12 meses, o IGP-M saiu de -4,26% para -3,04%.

O Ibovespa, principal índice da bolsa de valores brasileira, em abril, apresentou desvalorização de -1,70% em relação ao mês anterior, fechando aos 125.924 pontos. No ano, a queda acumulada é de -5,10%. O desempenho do mês é explicado, sobretudo, pela postergação das expectativas do início de flexibilização monetária nos EUA.

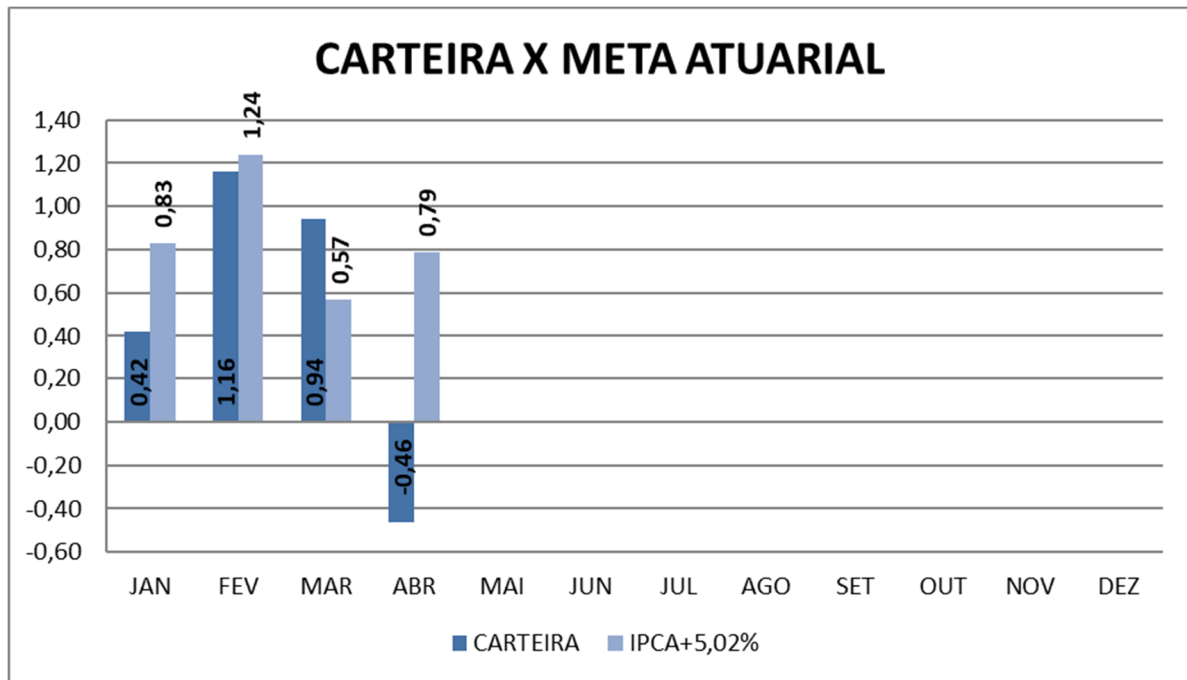
O desempenho da economia norte americana tem surpreendido, apesar da política monetária restritiva, fazendo com que a inflação e o mercado de trabalho apresentem uma resiliência maior do que a esperada. Desde o início do ano, dados de inflação e do mercado de trabalho têm vindo acima das expectativas dos economistas e os investidores passaram a reavaliar a velocidade em que se dará o processo de convergência da inflação à meta do Fed.

3. RESULTADO DA CARTEIRA

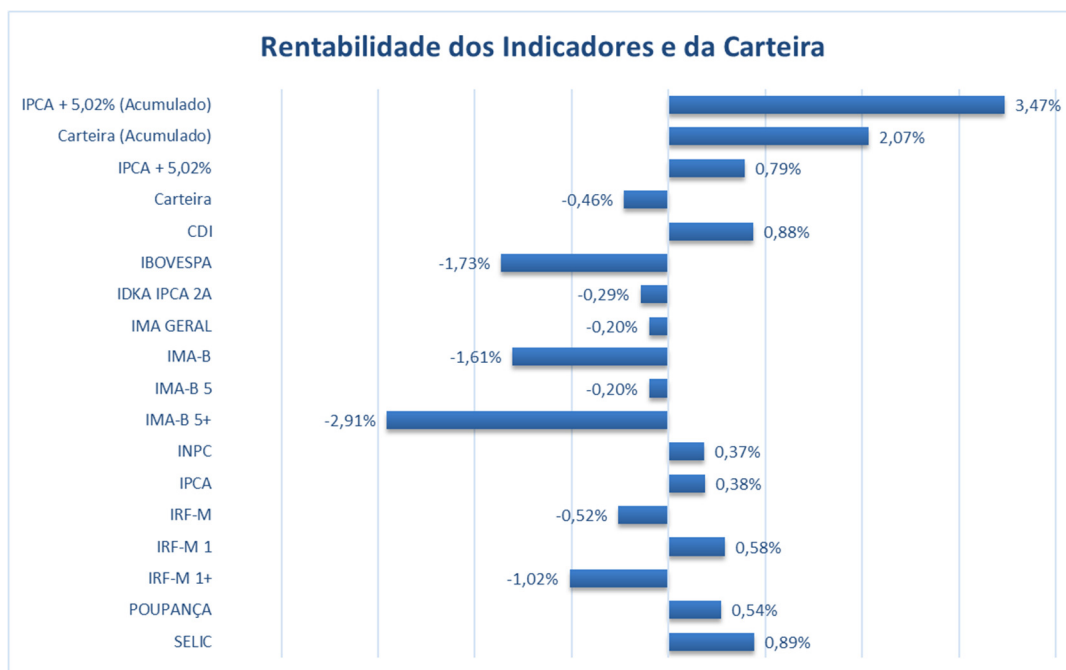
No mês de abril, nosso portfólio teve desempenho inferior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com uma queda de -0,46%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 5,02%, foi de 0,79%.

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
CARTEIRA	0,42	1,16	0,94	-0,46									2,07
IPCA+5,02%	0,83	1,24	0,57	0,79									3,47



A seguir, apresento o quadro com o comportamento da Carteira, Meta Atuarial e diversos índices do mercado.



No mês de abril, observamos um comportamento negativo em nossos fundos de investimento. Com a economia mais forte no exterior e a incerteza na queda das taxas, poucos



fundos da carteira obtiveram retorno melhor que a meta atuarial. De maneira geral, a carteira previdenciária do Macaeprev teve um comportamento negativo. Portanto, as maiores altas na carteira foram do Caixa Brasil Ações Livre com 1,36% e Caixa Institucional BDR Nível I com 0,80%. Também tivemos o BB RF Ativa Plus com 1,68%, que serve como hedge da nossa carteira em momentos mais incertos.

A indústria de fundos ainda continua sem fluxo o que também mantém modesto o fluxo para a bolsa, tendo em vista as taxas de juros locais e as Treasuries Americanas. A redução da Selic continua, mas os juros tiveram momentos de alta. Apesar das quedas no mês, boas empresas continuam muito baratas visto os múltiplos contraídos. Dessa forma, entendemos que a taxa de retorno esperada em um prazo maior é bem interessante. Por isso, a alocação em renda variável é importante, mesmo que pequena.

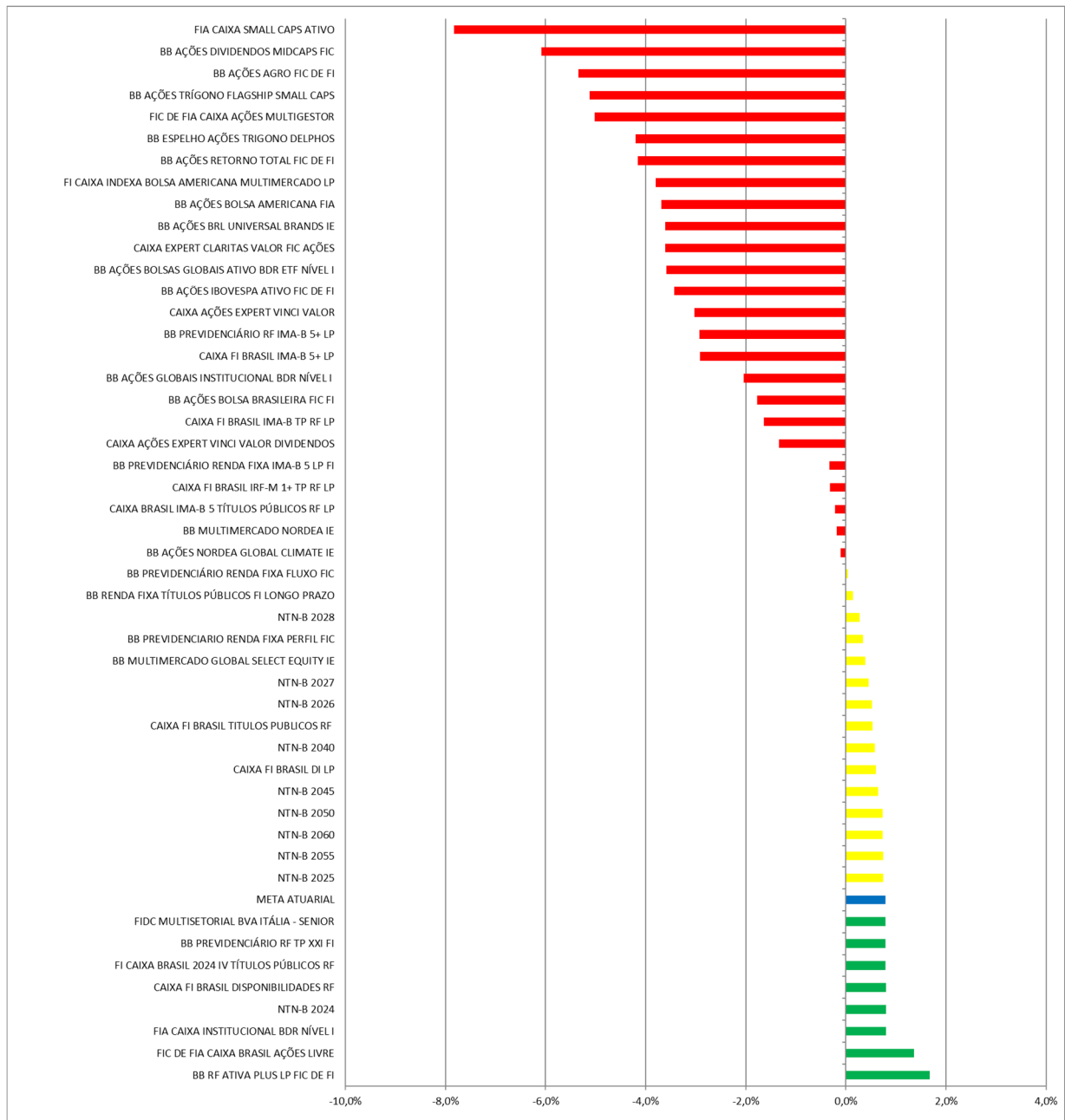
Em média, os fundos de ações brasileiras apresentaram rentabilidade de -3,81%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno médio de -3,75%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno de -1,61%. Os fundos de investimento no exterior tiveram resultado médio de -0,88%.

Os fundos de vértice FI Caixa Brasil 2024 e BB Previdenciário RF TP XXI renderam 0,79%. As NTN-B 2024 renderam 0,80%, as NTN-B 2025 renderam 0,75%, as NTN-B 2026 renderam 0,52%, as NTN-B 2027 renderam 0,46%, as NTN-B 2028 renderam 0,28%, as NTN-B 2040 renderam 0,58%, as NTN-B 2045 renderam 0,64%, as NTN-B 2050 renderam 0,73%, as NTN-B 2055 renderam 0,75% e as NTN-B 2060 renderam 0,74%. Em média, as NTN-B ficaram com 0,63%.

Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,47%. O fundo de renda fixa com gestão ativa rendeu 1,68%. Os fundos IMA-B 5 tiveram um retorno de -0,28%. Os fundos IMA-B 5+ tiveram retorno de -2,92%. O fundo que acompanha o IMA-B teve retorno de -1,64%. O fundo IRF-M 1+ rendeu -0,32%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade positiva de 0,79%. No dia 05/04/2024 foi amortizado R\$ 109.334,21 (cento e nove mil e trezentos e trinta e quatro reais e vinte e um centavos). Até 30/04/2024 foram resgatados o total de R\$ 10.132.155,67 (dez milhões e cento e trinta e dois mil e cento e cinquenta e cinco reais e sessenta e sete centavos), mais de 100% do capital total investido. O saldo em 30 de abril estava em R\$ 2.117.395,25 (dois milhões e cento e dezessete mil e trezentos e noventa e cinco reais e vinte e cinco centavos).

O gráfico a seguir mostra a comparação entre a rentabilidade dos fundos e a Meta Atuarial. Os fundos em verde bateram a Meta Atuarial, os fundos em amarelo apresentaram resultado positivo, porém, abaixo da Meta Atuarial e os fundos em vermelho tiveram resultado negativo.



O rendimento de abril da Carteira do Instituto foi negativo em R\$ -20.125.557,72 (vinte milhões e cento e vinte e cinco mil e quinhentos e cinquenta e sete reais e setenta e dois



**Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social**



centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de abril em R\$ 4.364.402.544,08 (quatro bilhões e trezentos e sessenta e quatro milhões e quatrocentos e dois mil e quinhentos e quarenta e quatro reais e oito centavos).



Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social



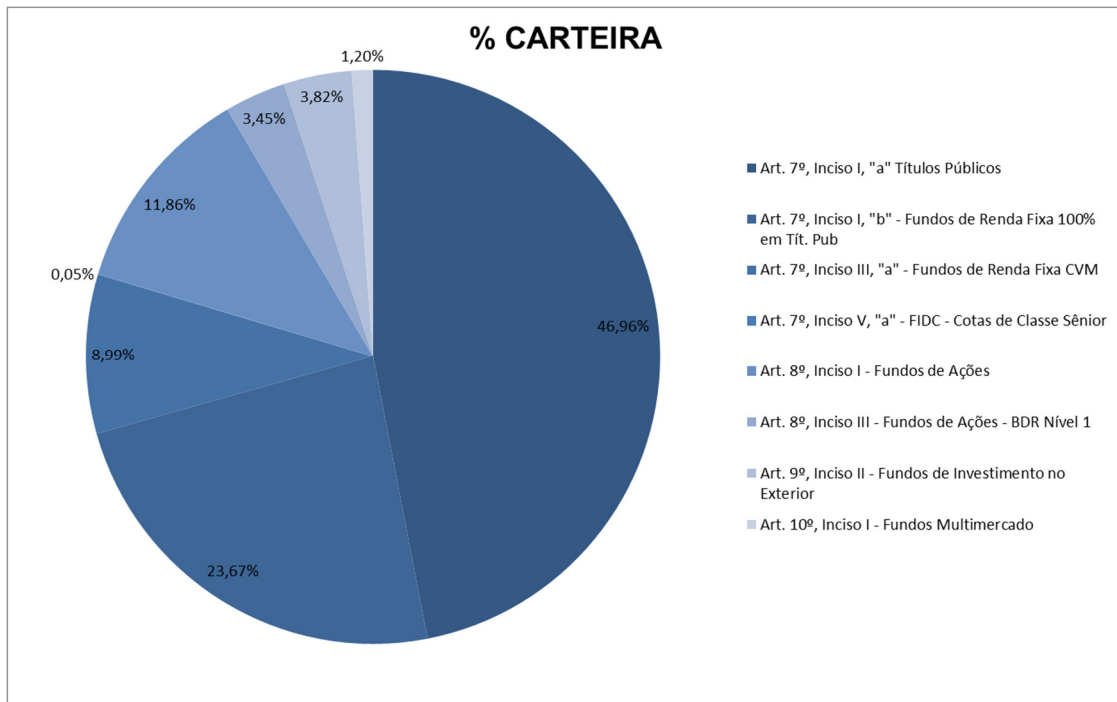
SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS

Fundo de Investimento	Saldo em 28/03/2024	Saldo em 30/04/2024	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	R\$156.349.013,89	R\$0,00	-R\$155.831.077,28	-R\$517.936,61	-0,33%
CAIXA FI BRASIL IRF-M1+ TP RF LP	R\$217.204.348,10	R\$0,00	-R\$216.511.167,77	-R\$693.180,33	-0,32%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$100,22	R\$101,02	R\$0,00	R\$0,80	0,80%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$719.203,58	R\$840.576,86	-R\$191.279,46	R\$312.652,74	0,04%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2024	R\$1.032.971,08	R\$1.041.340,64	R\$0,00	R\$8.369,56	0,80%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	R\$121.900.755,68	R\$2.079.174,85	-R\$119.991.000,00	R\$169.419,17	0,14%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$2.209.336,69	R\$2.117.395,25	R\$0,00	R\$17.392,77	0,79%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$4.767.664,99	R\$4.595.476,89	R\$0,00	-R\$172.188,10	-3,61%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$45.156.373,56	R\$5.428.511,92	-R\$40.000.000,00	R\$272.138,36	0,60%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$36.112.687,38	R\$6.304.392,10	-R\$30.000.000,00	R\$191.704,72	0,53%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	R\$20.073.272,67	R\$19.044.825,39	R\$0,00	-R\$1.028.447,28	-5,12%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	R\$20.127.519,46	R\$19.281.370,47	R\$0,00	-R\$846.148,99	-4,20%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	R\$21.687.247,81	R\$20.905.399,75	R\$0,00	-R\$781.848,06	-3,61%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$21.718.042,88	R\$20.973.753,33	R\$0,00	-R\$744.289,55	-3,43%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	R\$22.875.218,21	R\$22.850.540,34	R\$0,00	-R\$24.677,87	-0,11%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	R\$25.247.618,73	R\$24.482.719,40	R\$0,00	-R\$764.899,33	-3,03%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$31.152.685,80	R\$30.600.603,55	R\$0,00	-R\$552.082,25	-1,77%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$45.692.892,67	R\$43.253.150,89	R\$0,00	-R\$2.439.741,78	-5,34%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	R\$45.369.547,10	R\$44.760.080,86	R\$0,00	-R\$609.466,24	-1,34%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$46.859.356,44	R\$45.175.900,79	R\$0,00	-R\$1.683.455,65	-3,59%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$49.657.725,38	R\$47.593.249,09	R\$0,00	-R\$2.064.476,29	-4,16%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$50.359.192,87	R\$48.502.761,62	R\$0,00	-R\$1.856.431,25	-3,69%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$49.825.683,95	R\$49.733.657,29	R\$0,00	-R\$92.026,66	-0,18%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$55.493.689,67	R\$51.147.851,92	R\$0,00	-R\$4.345.837,75	-7,83%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$54.354.430,13	R\$51.625.616,07	R\$0,00	-R\$2.728.814,06	-5,02%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$54.242.439,04	R\$52.178.977,17	R\$0,00	-R\$2.063.461,87	-3,80%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$56.674.711,05	R\$53.226.110,82	R\$0,00	-R\$3.448.600,23	-6,08%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$57.016.857,39	R\$57.241.095,87	R\$0,00	R\$224.238,48	0,39%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$61.864.846,23	R\$58.556.948,33	R\$0,00	-R\$3.307.897,90	-5,35%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$60.975.321,93	R\$59.728.589,85	R\$0,00	-R\$1.246.732,08	-2,04%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$61.457.302,19	R\$61.950.024,40	R\$0,00	R\$492.722,21	0,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$79.572.411,75	R\$79.396.899,65	R\$0,00	-R\$175.512,10	-0,22%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2060	R\$87.036.211,97	R\$87.684.619,02	R\$0,00	R\$648.407,05	0,74%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2040	R\$0,00	R\$100.584.755,54	R\$99.999.549,45	R\$585.206,09	0,58%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	R\$146.077.418,51	R\$141.825.244,87	R\$0,00	-R\$4.252.173,64	-2,91%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	R\$147.625.981,46	R\$143.302.509,52	R\$0,00	-R\$4.323.471,94	-2,93%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2028	R\$0,00	R\$150.503.534,27	R\$150.079.829,97	R\$423.704,30	0,28%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$397.957.472,07	R\$166.550.564,96	-R\$234.047.832,23	R\$2.640.925,12	0,34%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2055	R\$187.869.503,05	R\$189.284.219,35	R\$0,00	R\$1.414.716,30	0,75%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2026	R\$101.854.356,89	R\$202.898.958,17	R\$99.996.346,85	R\$1.048.254,43	0,52%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	R\$212.149.306,42	R\$208.678.957,10	R\$0,00	-R\$3.470.349,32	-1,64%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$211.108.658,60	R\$212.776.216,41	R\$0,00	R\$1.667.557,81	0,79%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	R\$215.788.147,47	R\$219.420.642,33	R\$0,00	R\$3.632.494,86	1,68%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2045	R\$85.778.693,64	R\$237.366.736,97	R\$149.998.234,38	R\$1.589.808,95	0,64%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$236.904.225,29	R\$238.775.546,19	R\$0,00	R\$1.871.320,90	0,79%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2050	R\$238.833.839,82	R\$290.978.712,54	R\$49.960.490,62	R\$2.149.942,10	0,73%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2027	R\$101.758.649,11	R\$353.239.335,81	R\$249.998.113,75	R\$1.482.572,95	0,46%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2025	R\$432.649.854,91	R\$435.914.894,65	R\$0,00	R\$3.265.039,74	0,75%
TOTAL	R\$4.381.142.787,73	R\$4.364.402.544,08	R\$3.460.208,28	-R\$20.125.557,72	-0,46%

4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

4.1. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

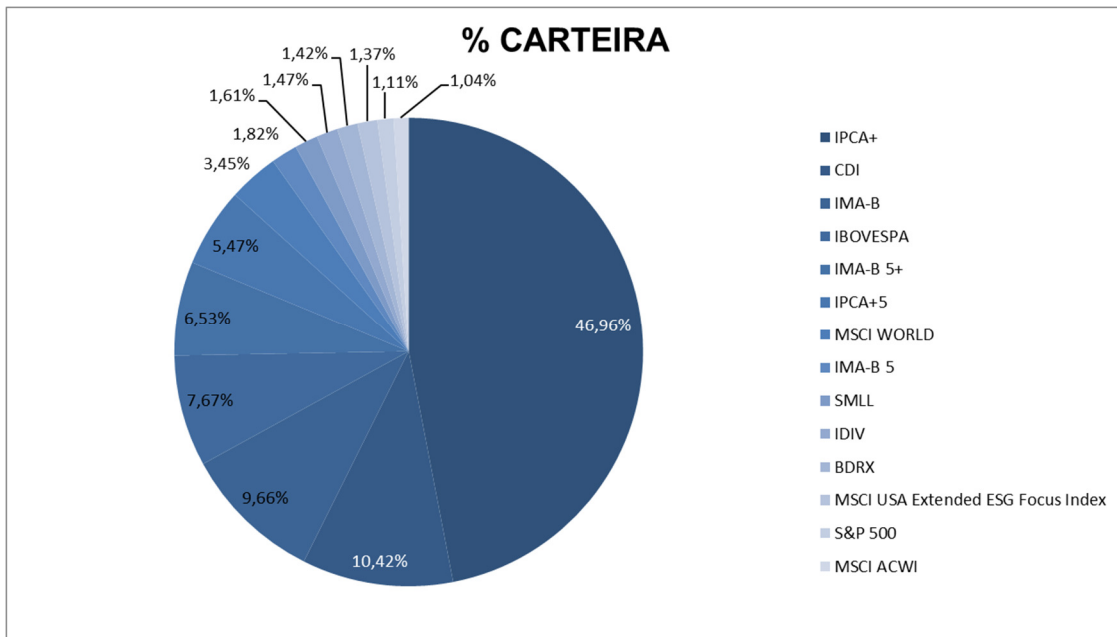
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024										
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução		% Limite PAI 2024		% Limite dos Recursos do RPPS		% Participação no PL do Fundo	Total
Art. 7º, Inciso I, "a" Títulos Públicos		46,96%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	Não se Aplica	R\$2.049.497.106,96
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	IPCA+	46,96%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	N/A	R\$2.049.497.106,96
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		23,67%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	R\$1.033.138.940,69
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	CDI	0,05%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,01%	R\$2.079.174,85
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	0,14%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,05%	R\$6.304.392,10
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	1,82%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	1,03%	R\$79.396.899,65
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	IMA-B	4,78%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	4,40%	R\$208.678.957,10
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	4,88%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	5,43%	R\$212.776.216,41
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	IMA-B 5+	3,28%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	9,70%	R\$143.302.509,52
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	IMA-B 5+	3,25%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	11,15%	R\$141.825.244,87
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	5,47%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	6,59%	R\$238.775.546,19
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		8,99%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	R\$392.240.397,09
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	3,82%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,99%	R\$166.550.564,96
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,02%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,02%	R\$840.576,86
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	CDI	5,03%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	4,47%	R\$219.420.642,33
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	0,12%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,03%	R\$5.428.511,92
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,00%	R\$101,02
Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior		0,05%	5,00%	✓	0,20%	✓	20,00%	✓	5,00%	R\$2.117.395,25
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,05%	5,00%	✓	0,20%	✓	20,00%	✓	3,64%	R\$2.117.395,25
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		11,86%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	R\$517.644.518,63
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,48%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	14,36%	R\$20.973.753,33
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,70%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	14,71%	R\$30.600.603,55
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,99%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	20,45%	R\$43.253.150,89
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	1,11%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	3,60%	R\$48.502.761,62
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,09%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	6,47%	R\$47.593.249,09
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	1,22%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	7,67%	R\$53.226.110,82
BB AÇÕES TRIGONO DELPHOS INCOME FIA	IDIV	0,44%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	9,56%	R\$19.281.370,47
BB AÇÕES TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	SMLL	0,44%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	32,76%	R\$19.044.825,39
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	IBOVESPA	0,56%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	3,31%	R\$24.482.719,40
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	IDIV	1,03%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	4,42%	R\$44.760.080,86
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,11%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	15,85%	R\$4.595.476,89
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,17%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	8,15%	R\$51.147.851,92
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,18%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	8,70%	R\$51.625.616,07
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,34%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	8,64%	R\$58.556.948,33
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		3,82%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	R\$166.854.515,04
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,37%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	4,26%	R\$59.728.589,85
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	1,04%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	12,08%	R\$45.175.900,79
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,42%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	2,68%	R\$61.950.024,40
Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior		3,45%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	R\$150.730.693,25
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	1,31%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	4,21%	R\$57.241.095,87
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	MSCI WORLD	0,52%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	6,09%	R\$22.850.540,34
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	MSCI WORLD	0,48%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	9,81%	R\$20.905.399,75
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	1,14%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	41,60%	R\$49.733.657,29
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		1,20%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	R\$52.178.977,17
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,20%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	2,89%	R\$52.178.977,17
Total:										
R\$4.364.402.544,08										



4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

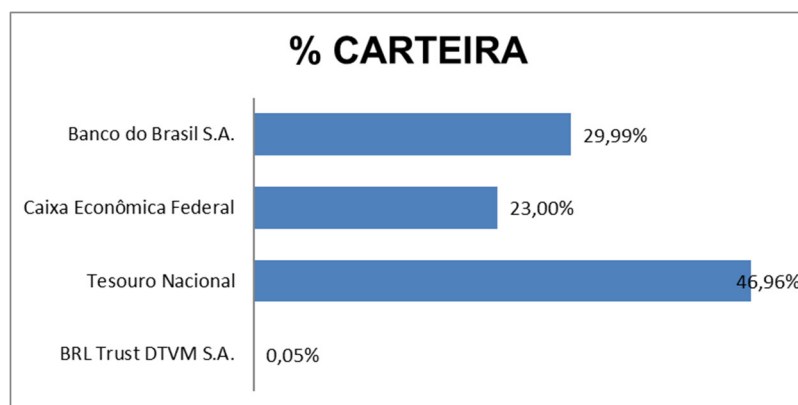
Indicador	Saldo em 30/04/2024	Participação
IPCA+	R\$2.049.497.106,96	46,96%
CDI	R\$454.920.336,46	10,42%
IMA-B	R\$421.455.173,51	9,66%
IBOVESPA	R\$334.907.628,37	7,67%
IMA-B 5+	R\$285.127.754,39	6,53%
IPCA+5	R\$238.775.546,19	5,47%
MSCI WORLD	R\$150.730.693,25	3,45%
IMA-B 5	R\$79.396.899,65	1,82%
SMLL	R\$70.192.677,31	1,61%
IDIV	R\$64.041.451,33	1,47%
BDRX	R\$61.950.024,40	1,42%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$59.728.589,85	1,37%
S&P 500	R\$48.502.761,62	1,11%
MSCI ACWI	R\$45.175.900,79	1,04%
Total	R\$4.364.402.544,08	100,00%



4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$2.117.395,25	0,05%
Tesouro Nacional	R\$2.049.497.106,96	46,96%
Caixa Econômica Federal	R\$1.003.708.018,11	23,00%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.309.080.023,76	29,99%



5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

MOVIMENTAÇÕES

APLICAÇÕES		
Data	Valor	
01/04/2024	R\$99.995.308,27	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
02/04/2024	R\$49.996.072,40	NTN-B 2045
02/04/2024	R\$49.960.490,62	NTN-B 2050
03/04/2024	R\$99.241,09	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
05/04/2024	R\$199.874.605,34	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
08/04/2024	R\$100.002.161,98	NTN-B 2040
08/04/2024	R\$99.999.549,45	NTN-B 2045
08/04/2024	R\$194.722.003,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
09/04/2024	R\$21.796.463,96	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
10/04/2024	R\$21.789.164,77	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
11/04/2024	R\$229,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
12/04/2024	R\$4.997,65	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
15/04/2024	R\$243.430,67	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/04/2024	R\$12.973,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
17/04/2024	R\$23.592,36	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
18/04/2024	R\$510.000.309,18	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
19/04/2024	R\$99.996.346,85	NTN-B 2026
19/04/2024	R\$150.079.829,97	NTN-B 2028
19/04/2024	R\$249.998.113,75	NTN-B 2027
19/04/2024	R\$160.383.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
22/04/2024	R\$150,00	CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS
25/04/2024	R\$10.093.674,49	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
26/04/2024	R\$8.360.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
29/04/2024	R\$652,08	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

RESGATES		
Data	Valor	Ativo
01/04/2024	R\$99.991.000,00	BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP
02/04/2024	R\$99.976.816,51	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
04/04/2024	R\$741.230,47	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
05/04/2024	R\$195.297.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
08/04/2024	R\$216.511.167,77	CAIXA FI BRASIL IRF-M1+ TP RF LP
08/04/2024	R\$200.000.598,09	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
10/04/2024	R\$21.789.164,77	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
18/04/2024	R\$30.000.000,00	CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP
18/04/2024	R\$40.000.000,00	CAIXA FI BRASIL DI LP
18/04/2024	R\$420.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
18/04/2024	R\$20.000.000,00	BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP
19/04/2024	R\$505.658.969,34	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
19/04/2024	R\$155.831.077,28	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI
24/04/2024	R\$4.005.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
24/04/2024	R\$4.890.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
26/04/2024	R\$8.359.133,12	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
30/04/2024	R\$920.994,85	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

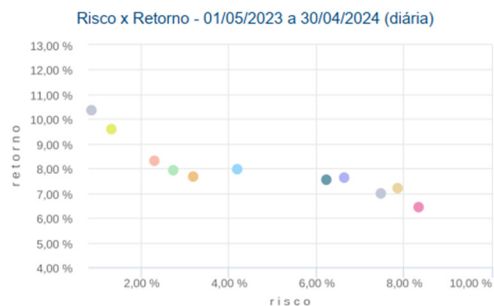
AMORTIZAÇÕES		
05/04/2024	R\$109.334,21	FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$2.027.432.360,48
Resgates	-R\$2.023.972.152,20
Saldo	R\$3.460.208,28

6. MONITORAMENTO DE RISCOS

6.1. ART. 7º, INCISO I, "A" – TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOUREIRO NACIONAL

Gráficos

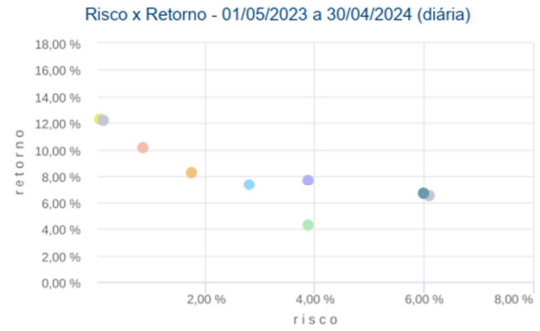


PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
NTN-B 760199 20240815
NTN-B 760199 20250515
NTN-B 760199 20260815
NTN-B 760199 20270515
NTN-B 760199 20280815
NTN-B 760199 20400815
NTN-B 760199 20450515
NTN-B 760199 20500815
NTN-B 760199 20550515



6.2. ART. 7º, INCISO I, “B” – FUNDOS DE RENDA FIXA 100% EM TP

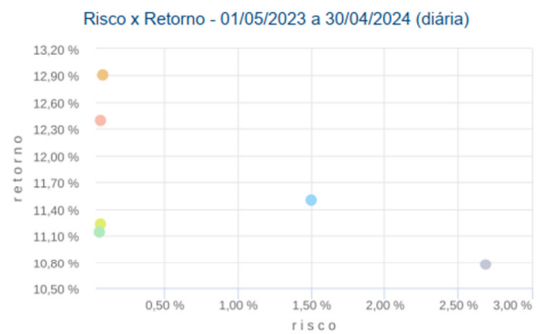
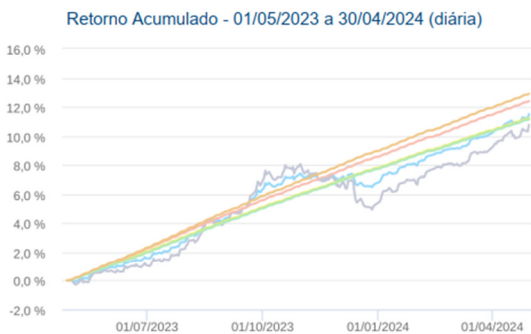
Gráficos



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

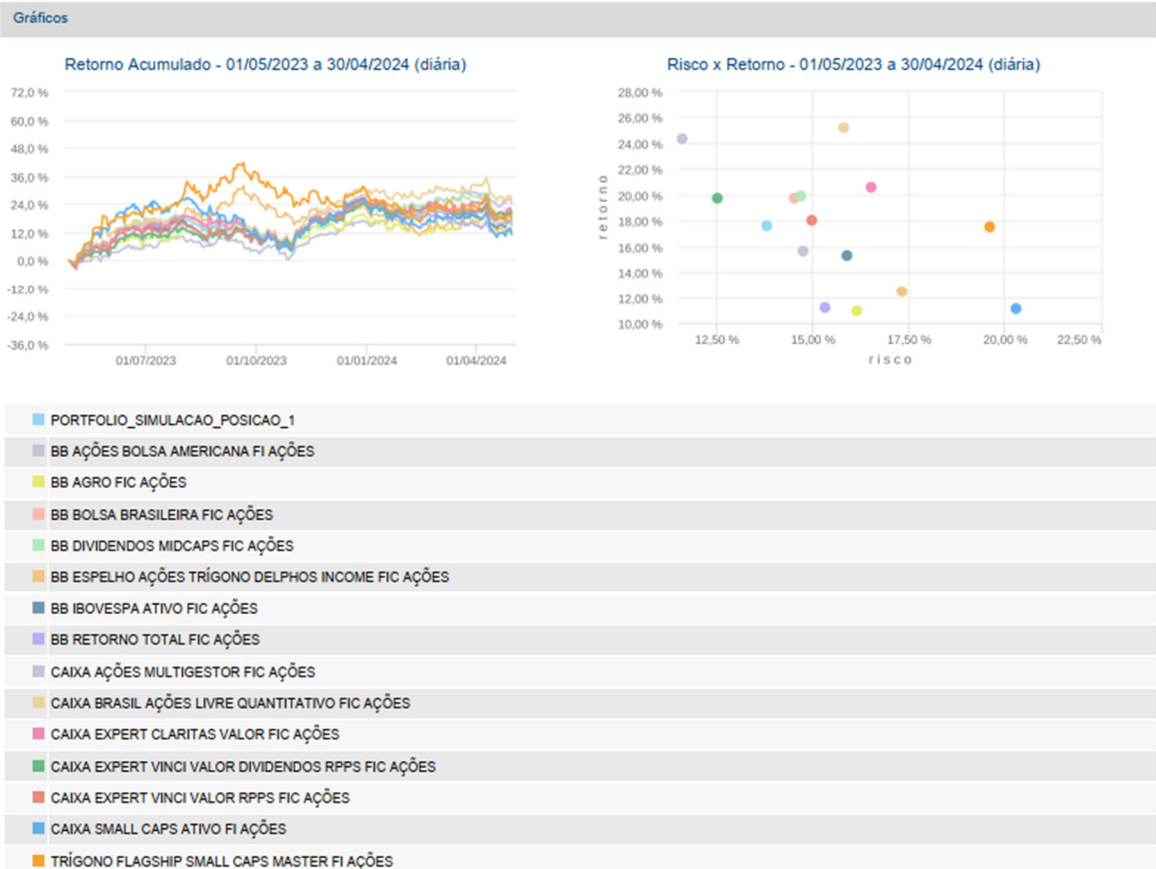
6.3. ART. 7º, INCISO III, “A” – FUNDOS DE RENDA FIXA CVM

Gráficos

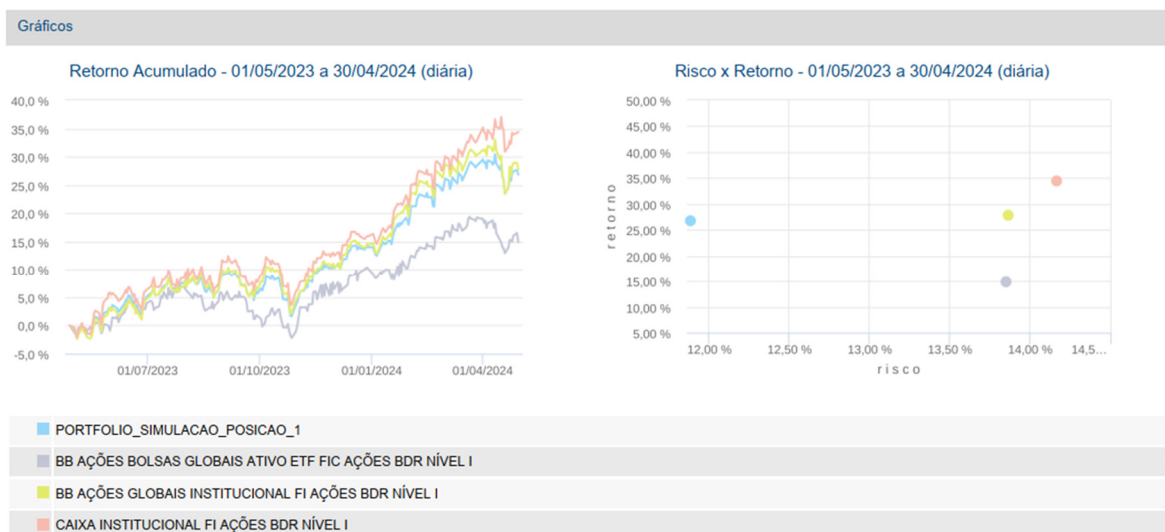


PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP

6.4. ART. 8º, INCISO I – FUNDOS DE FUNDOS DE AÇÕES

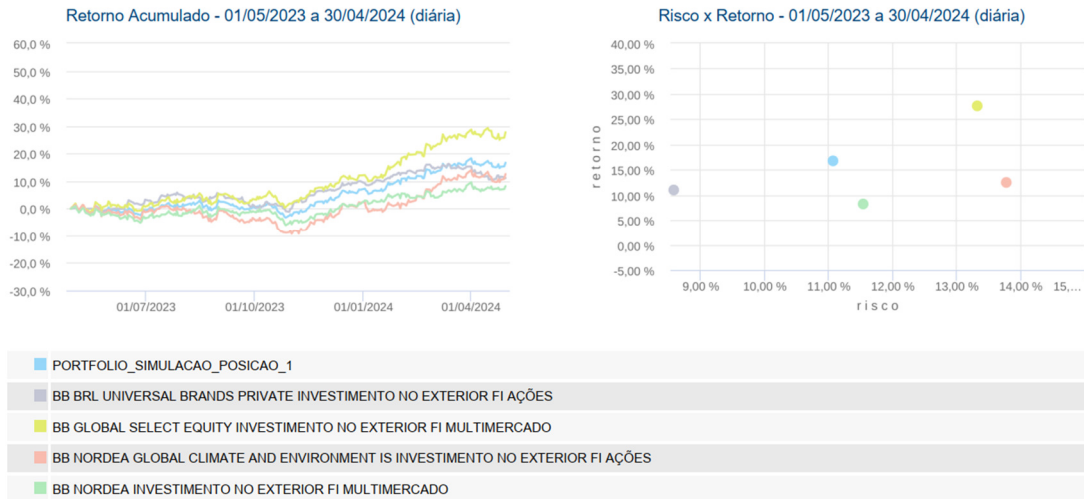


6.5. ART. 8º, INCISO III – FUNDOS DE AÇÕES – BDR NÍVEL I



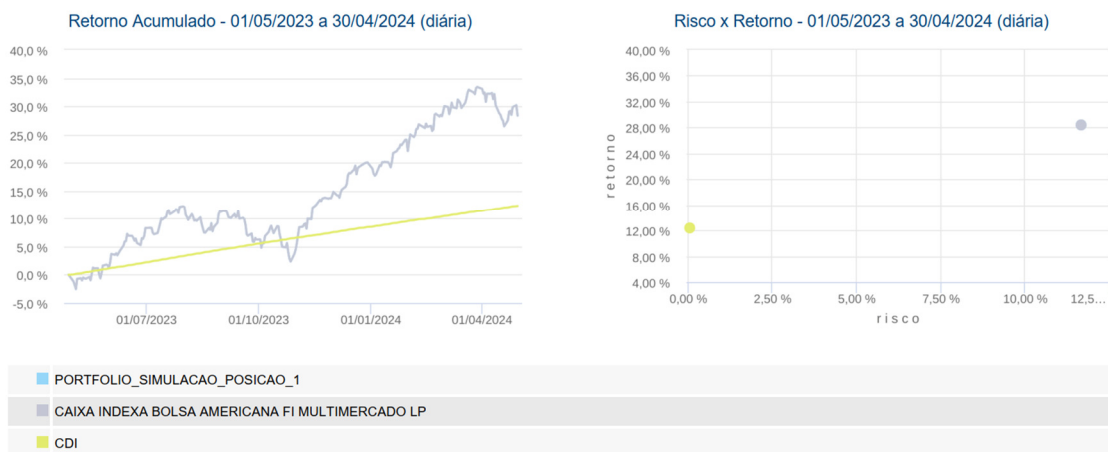
6.6. ART. 9º, INCISO II – FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Gráficos



6.7. ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO

Gráficos



7. ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS E VALUE AT RISK (VAR)

ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS

Fundo de Investimento	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	VaR 21du 95%
CDI	0,88%	3,53%	2,54%	5,42%	12,32%	27,35%	
BB REFERENCIADO DE TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,88%	3,52%	2,53%	5,39%	12,29%	27,30%	0,01%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,79%	3,37%	2,39%	5,24%	12,20%	27,06%	0,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,88%	3,55%	2,56%	5,44%	12,39%	27,42%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	0,79%	3,19%	2,29%	4,91%	11,23%	24,87%	0,03%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	1,68%	5,25%	3,76%	2,50%	10,77%	24,43%	0,18%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,89%	3,63%	2,60%	5,60%	12,90%	28,00%	0,03%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,79%	3,19%	2,29%	4,90%	11,14%	23,88%	0,03%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	-4,16%	-2,49%	-3,19%	10,78%	204,38%	23,47%	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	-3,80%	6,90%	5,12%	22,96%	28,34%	41,61%	1,49%
IMA-B 5	-0,20%	1,84%	1,16%	5,20%	8,40%	18,91%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	-0,22%	1,77%	1,10%	5,08%	8,22%	18,44%	0,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,22%	1,78%	1,11%	5,09%	8,27%	18,62%	0,21%
IMA-B	-1,61%	-1,44%	-0,99%	3,92%	7,87%	17,41%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	-1,63%	-1,51%	-1,05%	3,81%	7,64%	16,91%	0,42%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,79%	0,71%	-0,38%	2,44%	4,28%	6,72%	0,02%
IMA-B 5+	-2,91%	-4,37%	-2,95%	2,76%	6,95%	15,77%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	-2,92%	-4,49%	-3,02%	2,61%	6,49%	14,73%	0,66%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	-2,91%	-4,38%	-2,97%	2,72%	6,66%	14,94%	0,66%
IPCA + 5%	0,81%	3,45%	2,48%	5,23%	8,91%	19,23%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,79%	3,59%	2,46%	5,37%	10,11%	19,57%	0,02%
IRF-M 1+	-1,02%	0,33%	-0,07%	4,42%	12,36%	27,53%	
CAIXA FI BRASIL IRF-M1+ TP RF LP	-1,03%	0,25%	-0,33%	5,17%	12,41%	26,48%	0,47%
IBOVESPA	-1,70%	-6,15%	-1,43%	11,29%	23,54%	18,08%	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	-3,42%	-8,88%	-3,68%	8,97%	15,28%	9,12%	1,57%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	-1,77%	-6,37%	-1,61%	10,90%	19,70%	15,17%	1,32%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	-5,33%	-7,29%	-2,24%	5,97%	10,94%	-2,32%	1,84%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	-4,15%	-10,91%	-6,04%	4,41%	11,19%	-2,21%	1,49%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	-6,08%	-4,19%	-2,50%	13,88%	19,90%	16,57%	1,76%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	-3,03%	-6,49%	-2,46%	11,28%	18,01%	11,00%	1,40%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	-3,61%	-3,85%	-0,66%	12,53%	20,57%	9,33%	1,68%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	-5,02%	-7,75%	-3,76%	7,56%	15,59%	4,95%	1,59%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	-5,34%	-4,54%	-1,86%	15,85%	25,16%	19,71%	1,97%
IDIV	-0,56%	-4,34%	-0,86%	13,19%	24,30%	26,49%	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	-1,34%	-3,63%	-0,58%	11,93%	19,73%	19,73%	1,20%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	-4,20%	-9,34%	-2,85%	-3,81%	12,45%		1,99%
SMLL	-7,75%	-11,52%	-5,32%	6,49%	14,46%	-8,04%	
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	-5,12%	-9,93%	-2,58%	-6,17%			1,93%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-7,83%	-11,76%	-5,54%	5,87%	11,14%	-11,29%	2,37%
BDRX	4,04%	15,88%	15,88%	24,88%	34,65%	30,56%	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,80%	15,90%	10,84%	26,53%	34,38%	38,13%	1,76%
MSCI WORLD	-3,83%	4,29%	4,74%	20,59%	17,39%	17,73%	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	0,39%	13,99%	9,41%	25,48%	27,72%	33,19%	1,40%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	-0,10%	10,26%	11,09%	22,72%	12,56%	10,64%	1,39%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	-3,60%	0,98%	-1,72%	11,11%	11,10%	22,60%	1,18%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	-0,18%	6,37%	3,05%	13,35%	8,15%	10,54%	1,09%
MSCI ACWI	-3,39%	4,07%	4,96%	19,70%	16,31%	15,71%	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	-3,59%	4,34%	3,58%	15,75%	14,90%	20,50%	1,44%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	-4,18%	5,11%	4,59%	21,90%	21,43%	18,49%	
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-2,04%	11,60%	6,96%	22,01%	27,72%	29,96%	2,19%
S&P 500	-4,16%	5,57%	3,92%	20,07%	22,23%	21,18%	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	-3,68%	6,46%	4,71%	21,53%	24,37%	33,46%	1,59%



8. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

8.1. RENTABILIDADE

A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,17% no mês de abril, totalizando um saldo de R\$ 241.183.031,04 (duzentos e quarenta e um milhões e cento e oitenta e três mil e trinta e um reais e quatro centavos).

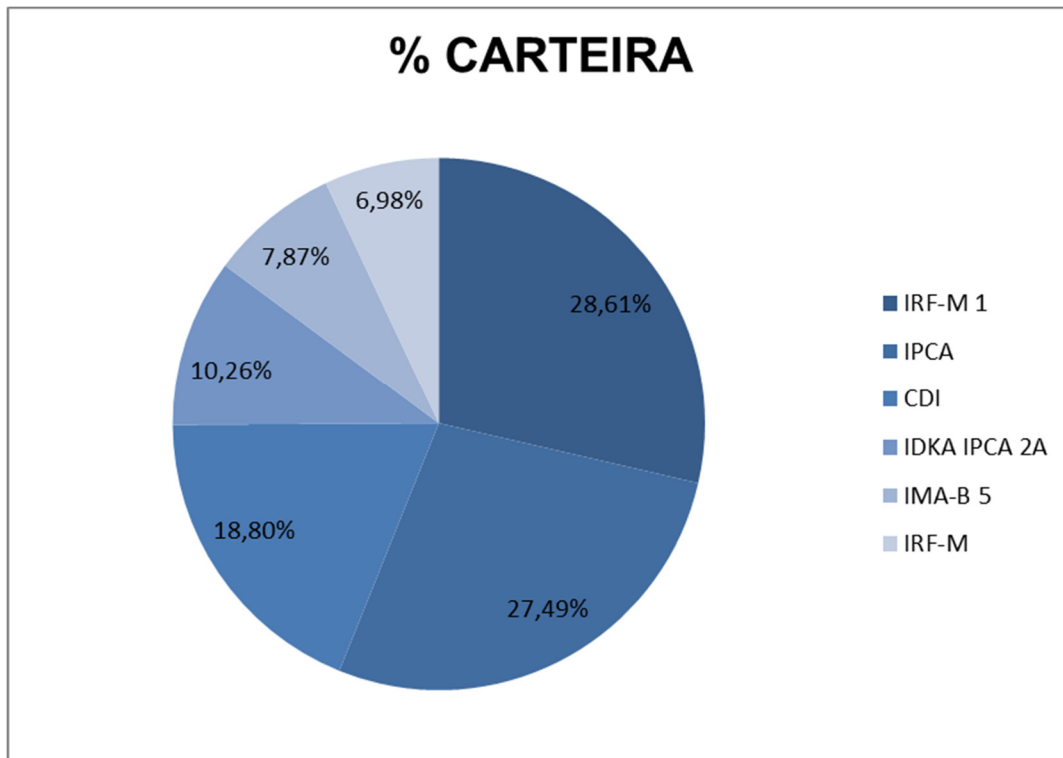
8.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024											
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução		% Limite PAI 2024		% Limite dos Recursos do RPPS		% Participação no PL do Fundo	Total	
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		53,71%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$129.536.432,05
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	IRF-M 1	28,51%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,83%	✓	R\$68.770.788,69
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	0,09%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,00%	✓	R\$222.520,31
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2A	10,26%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,43%	✓	R\$24.742.892,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	7,87%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,37%	✓	R\$18.973.352,18
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	IRF-M	6,98%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,41%	✓	R\$16.826.878,67
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		34,27%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$82.663.643,57
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COT	CDI	6,64%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,10%	✓	R\$16.012.296,49
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	CDI	0,14%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,01%	✓	R\$346.134,37
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,00%	✓	R\$1.443,57
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	27,49%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,98%	✓	R\$66.303.769,14
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		12,02%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$28.982.955,42
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,02%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	2,09%	✓	R\$28.982.955,42
Total:										R\$241.183.031,04	

8.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

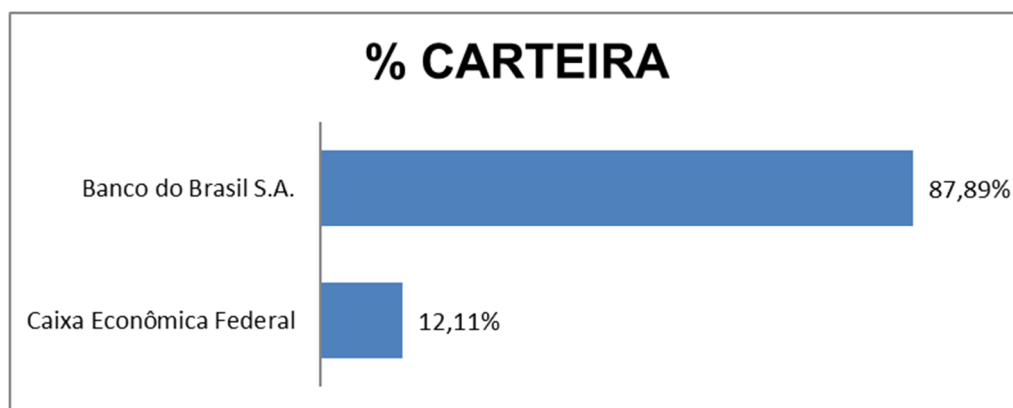
Indicador	Saldo em 30/04/2024	Participação
IRF-M 1	R\$68.993.309,00	28,61%
IPCA	R\$66.303.769,14	27,49%
CDI	R\$45.342.829,85	18,80%
IDKA IPCA 2A	R\$24.742.892,20	10,26%
IMA-B 5	R\$18.973.352,18	7,87%
IRF-M	R\$16.826.878,67	6,98%
	R\$241.183.031,04	100,00%



8.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$29.206.919,30	12,11%
Banco do Brasil S.A.	R\$211.976.111,74	87,89%



9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

9.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado negativo de -0,58% e fechou o mês com o saldo de R\$ 28.222.597,54 (vinte e oito milhões e duzentos e vinte e dois mil e quinhentos e noventa e sete reais e cinquenta e quatro centavos).

9.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

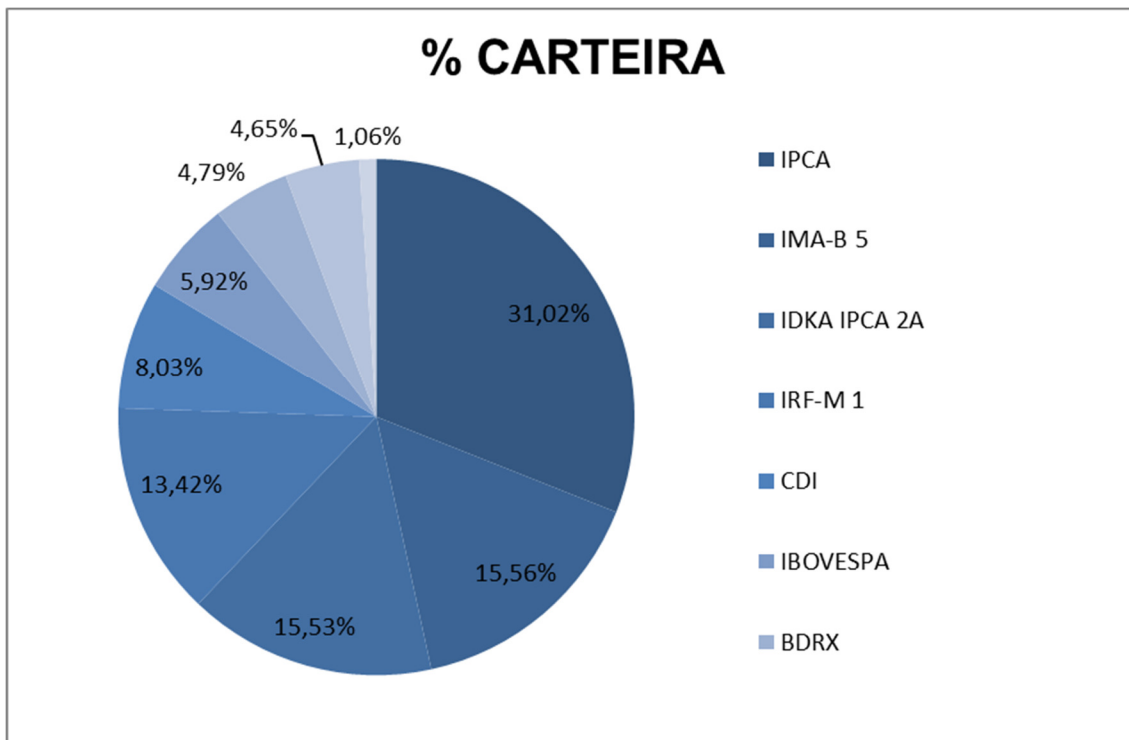
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024											
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução		% Limite PAI 2024		% Limite dos Recursos do RPPS		% Participação no PL do Fundo	Total	
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		59,76%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$16.864.460,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	6,63%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,02%	✓	R\$1.870.838,32
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	6,79%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,02%	✓	R\$1.917.673,46
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	15,53%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.384.240,93
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	15,56%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.392.684,82
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	15,23%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,08%	✓	R\$4.299.022,77
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		15,78%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$4.454.336,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,78%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,07%	✓	R\$4.454.336,61
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		6,99%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$1.972.383,36
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	IBOVESPA	1,57%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$444.396,27
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,17%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,04%	✓	R\$329.797,79
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,82%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,08%	✓	R\$512.838,58
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,36%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$385.111,97
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,06%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$300.238,75
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		9,44%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$2.664.545,44
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	4,65%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,09%	✓	R\$1.312.370,21
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	4,79%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$1.352.175,23
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		8,03%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$2.266.871,83
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	2,59%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,62%	✓	R\$730.343,51
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,56%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,34%	✓	R\$723.580,91
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,88%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$812.947,41
Total:										R\$28.222.597,54	



9.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/04/2024	Participação
IPCA	R\$8.753.359,38	31,02%
IMA-B 5	R\$4.392.684,82	15,56%
IDKA IPCA 2A	R\$4.384.240,93	15,53%
IRF-M 1	R\$3.788.511,78	13,42%
CDI	R\$2.266.871,83	8,03%
IBOVESPA	R\$1.672.144,61	5,92%
BDRX	R\$1.352.175,23	4,79%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.312.370,21	4,65%
SMLL	R\$300.238,75	1,06%
	R\$28.222.597,54	100,00%

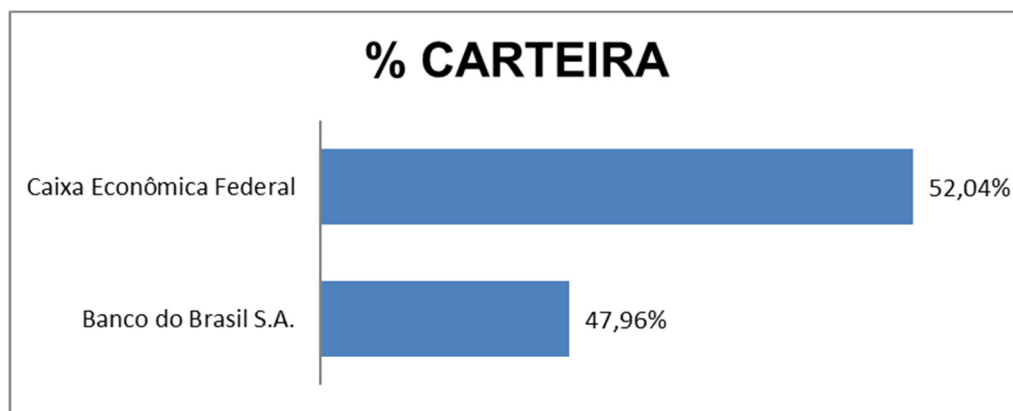




9.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$13.534.767,53	47,96%
Caixa Econômica Federal	R\$14.687.830,01	52,04%



10. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

10.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de 0,80% e fechou o mês com o saldo de R\$ 20.331.877,19 (vinte milhões e trezentos e trinta e um mil e oitocentos e setenta e sete reais e dezenove centavos).

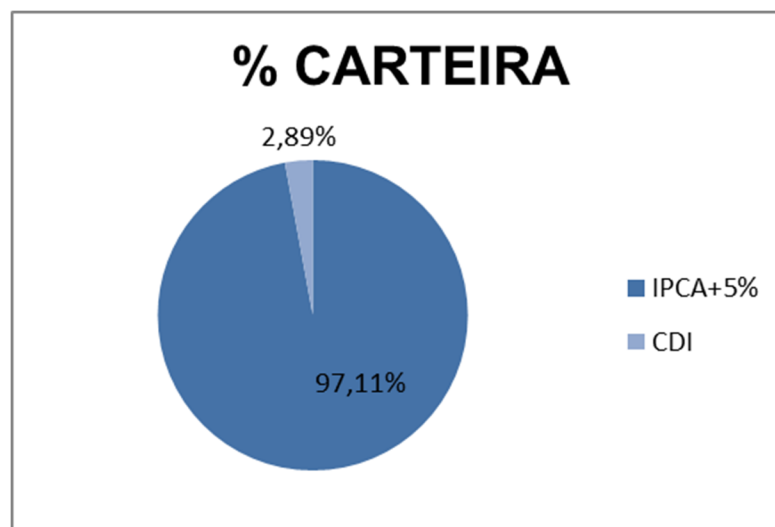
10.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024									
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total		
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		97,11%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$19.743.490,17		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA + 5%	97,11%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,68%	R\$19.743.490,17		
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		2,89%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00%	R\$588.387,02		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	2,89%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00%	R\$588.387,02		
Total:							R\$20.331.877,19		

10.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

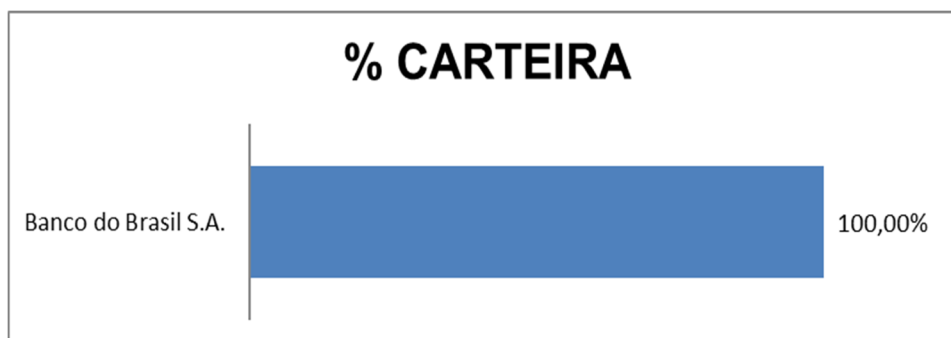
Indicador	Saldo em 30/04/2024	Participação
IPCA+5%	R\$19.743.490,17	97,11%
CDI	R\$588.387,02	2,89%
	R\$20.331.877,19	100,00%



10.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$20.331.877,19	100,00%





11. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023

11.1. RENTABILIDADE

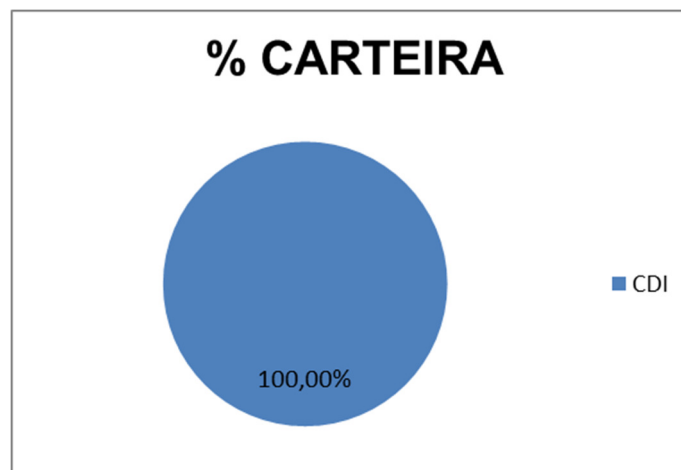
A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um resultado de 0,80% e fechou o mês com o saldo de R\$ 34.617.290,82 (trinta e quatro milhões e seiscentos e dezessete mil e duzentos e noventa reais e oitenta e dois centavos).

11.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024									
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total		
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$34.617.290,82		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA+5%	100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,20% ✓	R\$34.617.290,82		
Total:							R\$34.617.290,82		

11.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

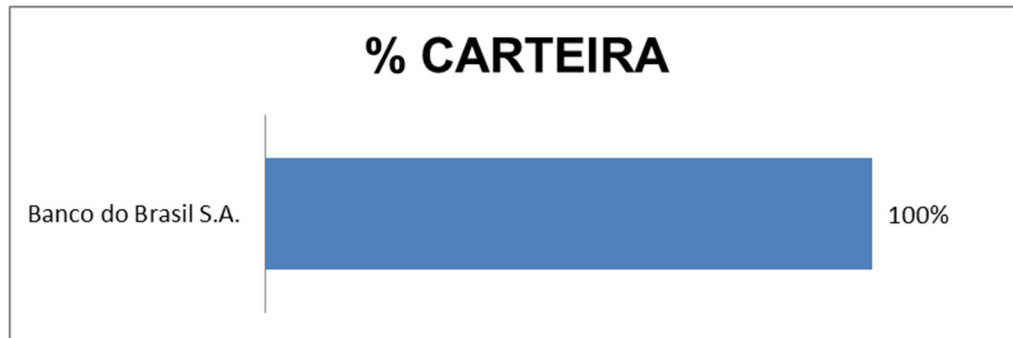
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 30/04/2024	Participação
IPCA+5%	R\$34.617.290,82	100,00%
	R\$34.617.290,82	100,00%





11.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$34.617.290,82	100%



12. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2024

12.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2024) apresentou um resultado de 0,88% e fechou o mês com o saldo de R\$ 40.279.024,85 (quarenta milhões e duzentos e setenta e nove mil e vinte e quatro reais e oitenta e cinco centavos).

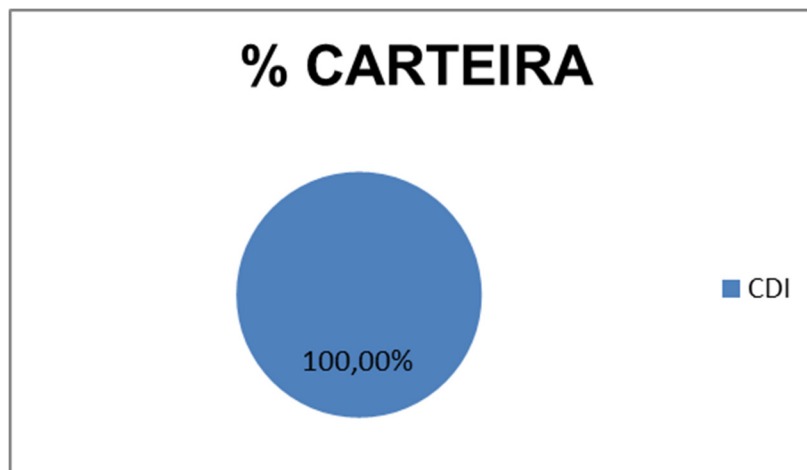
12.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024											
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução		% Limite PAI 2024		% Limite dos Recursos do RPPS		% Participação no PL do Fundo		Total
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		100,00%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$40.279.024,85
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	100,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,24%	✓	R\$40.279.024,85
Total:											R\$40.279.024,85



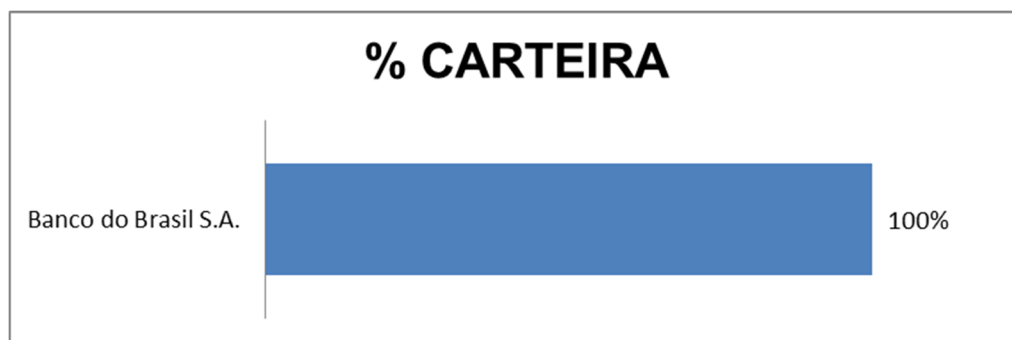
12.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 30/04/2024	Participação
CDI	R\$40.279.024,85	100,00%
	R\$40.279.024,85	100,00%



12.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$40.279.024,85	100%





13. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES

13.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

CUSTOS DOS FUNDOS		
Fundo de Investimento	Taxa de Administração	Taxa de Performance
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	1,00%	20% do que excede 100% do Ibovespa
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1,00%	10% do que excede 100% do S&P 500
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	1,00%	10% do que excede 100% do MSCI ACWI
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	2,00%	0,00%
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	0,50%	0,00%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	1,00%	0,00%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	1,00%	0,00%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	2,00%	0,00%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	0,08%	0,00%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	0,08%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	2,00%	20% do que excede 100% do Ibovespa
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	1,00%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5+ LP	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,20%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,80%	0,00%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	0,20%	0,00%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,20%	0,00%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	0,80%	0,00%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,70%	0,00%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1,50%	0,00%
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	0,40%	0,00%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	1,50%	0,00%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	1,25%	0,00%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	2,00%	0,00%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20%	0,00%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,10%	0,00%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	0,20%	0,00%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	0,00%	0,00%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	0,90%	0,00%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	0,30%	0,00%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	2,00%	20% do que excede 100% do SMLL
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	0,60%	0,00%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	2,00%	20% do que excede 100% do IDIV
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	1,72%	0,00%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	1,72%	0,00%



Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social



13.2. CUSTO SELIC PARA OS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

CUSTOS SELIC		
Ativos	Patrimônio (R\$)	SELIC
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	R\$ 2.049.497.106,96	R\$ 2.803,29



14. CONCLUSÃO

O Macaeprev encerrou o mês de abril de 2024 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 4.729.036.365,52 (quatro bilhões e setecentos e vinte e nove milhões e trinta e seis mil e trezentos e sessenta e cinco reais e cinquenta e dois centavos). O gráfico a seguir apresenta a evolução patrimonial do Macaeprev a cada final de exercício.



Macaé, 27 de abril de 2024.

Erenildo Motta da Silva Júnior
Erenildo Motta da Silva Júnior
Gestor de Recursos
MACAEPREV



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e nove dias do mês de maio de 2024, o Comitê de Investimentos, ordinariamente, reuniu-se via plataforma de reunião *Google Hangouts Meet*, para apresentação e análise dos investimentos, acompanhamento de rentabilidade, dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS, da aderência das alocações, processos decisórios de investimentos e políticas de investimentos referentes ao mês de **abril** de 2024;

Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos o qual segue na íntegra na ata do dia de hoje: **29 de maio de 2024**.

Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de **abril de 2024**, e que foram devidamente fundamentadas e registradas nas atas de reunião do Comitê.

Considerando, por fim, que os investimentos são aderentes a Política Anual de Investimentos (PAI) do Macaeprev para o ano de 2024 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução CMN nº 4.963, **APROVAMOS** o relatório apresentado referente a **ABRIL de 2024**, o qual segue para aprovação do Conselho Fiscal. É o parecer.

COMITÊ DE INVESTIMENTOS:



Alfredo Tanos Filho


Erenildo Motta da Silva Júnior


José Eduardo da Silva Guinâncio


Patric Alves de Vasconcellos


Claudio de Freitas Duarte


Fábio de Carvalho de Moraes Drumond


Miriam Amaral Queiroz


Viviane da Silva Lourenço Campos



REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA - ATA DA 24ª REUNIÃO POR CONVOCAÇÃO DOS MEMBROS DO CONSELHO FISCAL DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE MACAÉ (MACAEPREV).

ATA nº 24/2024 de 28/06/2024- Ata de Reunião extraordinária do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé, sendo aberta às 17:10hs, convocada por todos os membros, conforme Lei Complementar 119/2009 e art. 5º do Decreto 025/2012. Na presente reunião, reuniram-se na sede do Instituto de Previdência Social de Macaé – MACAEPREV, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, 293, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, estando presentes os membros **Helida Márcia da Costa Mendonça Damasceno, Ueliton Machado Pinto, Marcelo Puertas Tavares e Susan Cristina Venturini Ferraz.** A presente reunião visa: **ANALISAR O RELATÓRIO DO INVESTIMENTO – ABRIL DE 2024 - PRÓ-GESTÃO:** Os membros deste conselho fiscal receberam do sr. Erenildo Motta da Silva Júnior, Gestor de Investimentos do Macaeprev, o Relatório de Investimentos referente ao mês de **ABRIL DE 2024**. O presidente deste Conselho esclareceu que o envio deste relatório, visa cumprir uma exigência atual para certificação no Pró-Gestão, item G6, Elaboração de Relatórios Mensais, uma vez que a Secretaria de Previdência - SPREV do Ministério da Fazenda – MF por força da Lei nº 13.341/2016, editou a Portaria MPS nº 185/2015, que instituiu o Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios - Pró-Gestão RPPS. Inicialmente, destacamos trechos do **RELATÓRIO DO INVESTIMENTO – ABRIL DE 2024:** *“No mês de abril, tivemos resultados negativos nas carteiras de investimentos. A economia global enfrenta incertezas decorrentes de conflitos geopolíticos e condições de financiamento restritas. No front geopolítico, a tensão no oriente médio continua com o conflito entre Israel e Hamas e a incursão de rebeldes “houthis” do Iêmen no Mar Vermelho, com reflexos no frete marítimo no canal de Suez, a principal via entre o principal porto do Mundo (Roterdã) e a Ásia. Além da guerra da Ucrânia completar 26 meses sem perspectiva de avanço nas negociações diplomáticas. Nos EUA, em abril, continuamos a ver postergação das expectativas do ciclo de corte dos juros. Esse contexto ocorre devido aos dados*

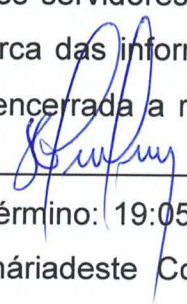


Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Conselho Fiscal


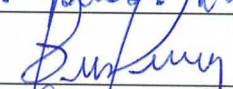
DO RENDIMENTO DA CARTEIRA: Quanto ao rendimento da Carteira do Instituto em março foi negativo em R\$ -20.125.557,72 (vinte milhões e cento e vinte e cinco mil e quinhentos e cinquenta e sete reais e setenta e dois centavos). **FUNDO PREVIDENCIÁRIO:** Em relação ao Fundo Previdenciário, o patrimônio encerrou o mês em R\$ 4.364.402.544,08 (quatro bilhões e trezentos e sessenta e quatro milhões e quatrocentos e dois mil e quinhentos e quarenta e quatro reais e oito centavos), enquanto o mês anterior foi de 4.381.142.787,73 (quatro bilhões e trezentos e oitenta e um milhões e cento e quarenta e dois mil e setecentos e oitenta e sete reais e setenta e três centavos). **DO PATRIMÔNIO CONSOLIDADO:** Analisando o presente relatório, verifica-se que o Macaeprev encerrou o mês de ABRIL em R\$ 4.729.036.365,52 (quatro bilhões e setecentos e vinte e nove milhões e trinta e seis mil e trezentos e sessenta e cinco reais e cinquenta e dois centavos), enquanto **MARÇO** foi de R\$ 4.746.160.240,32 (quatro bilhões e setecentos e quarenta e seis milhões e cento e sessenta mil e duzentos e quarenta reais e trinta e dois centavos). Suzan, membro deste conselho, com base no montante expressivo de R\$ 4.729.036.365,52 em gestão pelo Macaéprev em 2024, reconhecemos o mérito dos gestores de investimento e demais membros pela realização de um trabalho exemplar. No entanto, a magnitude dos recursos sob gestão também demanda cautela e vigilância por parte do Conselho Fiscal. **DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO:** A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado em Abril teve um resultado de 0,17% no mês de abril, totalizando um saldo de R\$ 241.183.031,04 (duzentos e quarenta e um milhões e cento e oitenta e três mil e trinta e um reais e quatro centavos), enquanto **MARÇO** de 0,76%, totalizando um saldo de R\$ 242.190.452,30 (duzentos e quarenta e dois milhões e cento e noventa mil e quatrocentos e cinquenta e dois reais e trinta centavos). **DOS RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2024:** Esta carteira teve um resultado de 0,88% e fechou o mês com o saldo de R\$ 40.279.024,85 (quarenta milhões e duzentos e setenta e nove mil e vinte e quatro reais e oitenta e cinco centavos). Sendo assim, após análise detalhadamente das informações prestadas no presente relatório de investimento, deliberam por unanimidade os membros deste conselho pela **APROVAÇÃO** do relatório de investimento do mês de **ABRIL de 2024**. Deliberam ainda os membros deste



Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Conselho Fiscal

conselho fiscal, pela emissão de **TERMO DE APROVAÇÃO**, com o encaminhamento ao Gestor de Investimentos. Assim concluímos os trabalhos deste conselho sobre o realtório de investimento, ficando a presente ata à disposição dos servidores ativos, inativos e pensionistas, a fim de que tenham conhecimento acerca das informações contidas no presente. Nada mais havendo para o momento, foi encerrada a reunião. Esta ATA foi lavrada por mim, Susan Cristina Venturini Ferraz,  sendo lida, aprovada e assinada por todos os presentes. Horário de Término: 19:05h. Fica marcado para o dia 02/07/2024, a próxima reunião extraordinária deste Conselho Fiscal, às 17:10hs, na sede deste Instituto.

CONSELHO FISCAL

HELIDA MÁRCIA DA COSTA MENDONÇA DAMASCENO	PRESIDENTE	
UELITON MACHADO PINTO	MEMBRO	
SUSAN C. V. FERRAZ	MEMBRO	
MARCELO P. TAVARES	MEMBRO	