

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



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



JUNHO - 2024



SUMÁRIO

1. INTRODUÇÃO	4
2. CENÁRIO ECONÔMICO.....	4
3. RESULTADO DA CARTEIRA.....	9
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 junho 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

O mês de junho foi de grandes desafios para os gestores de recursos. Além do cenário fiscal desafiador no Brasil, a acirrada disputa entre o governo e o Banco Central elevou a volatilidade do mercado. Os investimentos no exterior continuaram apresentando bons resultados, impulsionados pela valorização do dólar em relação ao real e pelo desempenho positivo dos índices globais.

No front geopolítico, a repercussão do conflito no oriente médio se mantém, desta vez com a apreensão sobre um possível conflito entre Israel e Hezbollah. Além disso, a guerra da Ucrânia completa 29 meses, sem perspectivas de avanço nas negociações diplomáticas.

Nos EUA, os dados do varejo ficaram abaixo do esperado e os PMIs do setor manufatureiro, que são índices de confiança do setor, desaceleraram em maio. Da mesma forma, o Índice de Sentimento do Consumidor, coletado pela Universidade de Michigan, caiu em junho pelo terceiro mês consecutivo, refletindo pessimismo em relação à inflação e à deterioração da renda.

O consumo agregado recuou -0,05% m/m em abril, abaixo das expectativas (0,1% m/m), sugerindo um início de trimestre com uma demanda mais tímida. Com os resultados, o consumo americano apresenta um carregamento de 1,3% t/t anualizado para o 2T24, levemente abaixo dos 1,99% verificados no 1T24. 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%.



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



A inflação medida pelo índice CPI em maio variou 0,0% (M/M), ante o crescimento de 0,3% (M/M) em abril. Com o dado de maio, o índice acumulado em 12 meses reduziu de 3,4% para 3,3% (A/A). Enquanto isso o núcleo do CPI, apresentou crescimento de 0,2% (M/M), após avançar 0,3% em abril, e o índice acumulado em 12 meses permanece elevado com inflação de 3,4% (A/A), ante 3,6% (A/A). Já a inflação medida pelo PCE de maio apresentou estabilidade, ante o crescimento de 0,3% (M/M) em abril, com desaceleração da inflação anualizada de 2,7% para 2,6%. O núcleo do PCE apresentou crescimento de 0,1% (M/M), com redução do índice acumulado em 12 meses de 2,8% para 2,6%, em linha com a projeção mediana de mercado.

O mercado de trabalho continua a mostrar dados robustos. No mês de maio, foram geradas 272 mil vagas, superando as expectativas do mercado, que giravam em torno de 180 mil novas vagas. No entanto, mesmo com esse resultado positivo, a taxa de desemprego teve um leve aumento, subindo de 3,9% para 4,0%. Os salários também apresentaram crescimento de 4,00% na comparação interanual. Esse cenário continua a pressionar a política monetária, o que pode levar à manutenção das taxas de juros por um período mais longo.

Em sua reunião de junho, o Federal Open Market Committee (FOMC) decidiu novamente por manter os juros básicos estáveis no intervalo de 5,25% a 5,50% a.a. em linha com o consenso de mercado. O comunicado trouxe apenas revisões marginais em relação ao anterior, com o comitê atualizando a avaliação do cenário apenas por meio da indicação de que foi observado um modesto progresso em direção ao objetivo de uma inflação de 2% a.a.

O presidente do Fed, Jerome Powell, assumiu uma postura bastante moderada, transparecendo a necessidade de manter a cautela diante de um quadro de atividade ainda forte, mercado de trabalho robusto, um pouco mais equilibrado e de uma inflação que acomoda, mas que segue em patamar elevado.

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. Ambas as taxas vêm sendo mantidas desde fevereiro. A manutenção das LPRs era amplamente esperada depois que o PBoC decidiu manter inalterada a taxa da linha de crédito de médio prazo (MLF).

A produção industrial na China desacelerou de 6,7% (A/A) em março para 5,6% (A/A) em maio, vindo abaixo do consenso de mercado, que previa uma desaceleração aos



6,2% (A/A). Houve crescimento em 33 das 41 principais indústrias. Enquanto as vendas no varejo na China aumentaram, de 2,3% em março para 3,7% (A/A) em maio, número acima das estimativas do mercado (3,0%). As exportações avançaram 7,6% em comparação com o mesmo período do ano anterior, enquanto as importações tiveram um avanço de apenas 1,8%, abaixo das expectativas do mercado. Esse resultado tem sustentado o bom desempenho da indústria. No entanto, o segmento imobiliário ainda apresenta dados frustrantes e desempenho abaixo das expectativas.

Na Zona do Euro, a inflação medida pelo CPI de maio acelerou para 2,6% (A/A), acima das expectativas de mercado (2,5%). Olhando para os principais grupos, destaque para alta da inflação de serviços 4,1% (A/A), voltando a acelerar e atingindo o maior valor dos últimos 6 meses. Por outro lado, registrando redução, a inflação de alimentos marcou 2,6% ante 2,8% A/A. Olhando para as principais economias do bloco, observou-se aceleração na Alemanha (2,8% A/A), na Espanha (3,8% A/A) e na França (2,7% A/A); em sentido oposto, houve desaceleração na Itália (0,8% A/A).

O Comitê de Política Monetária (MPC) do BoE (*Bank of England*, sigla em inglês) manteve sua taxa básica de juros em 5,25% a.a. pela sétima reunião consecutiva, sendo esse o maior nível de juros desde 2008.

O Banco Central Europeu (BCE) reduziu suas três taxas de juros diretoras em 25 bps, em linha com a expectativa do mercado. Assim, as taxas de juros das operações principais de refinanciamento, de cedência de liquidez e de depósito foram reduzidas para, respectivamente, 4,25%, 4,50% e 3,75% a partir de 12 de junho de 2024.

No comunicado, a autoridade monetária justificou que a decisão pelo corte foi tomada com base em uma “avaliação atualizada das perspectivas para a inflação, da dinâmica da inflação subjacente e da força da transmissão da política monetária”, considerando ser apropriado “moderar o nível de restrição após nove meses de taxas constantes”. A preocupação continua sendo o forte crescimento dos salários e, conseqüentemente, o aumento dos custos de mão de obra. Além disso, os choques sobre os preços causados pela guerra entre Rússia e Ucrânia ainda não se dissiparam totalmente, e a elevação dos fretes marítimos devido às mudanças de rotas diante da insegurança no Mar Negro.

No Brasil, a confiança teve predomínio positivo. Destaque para a confiança do consumidor (-4,3% para 2,1%, M/M). Nos dados da economia real, houve números favoráveis



em maio, com destaque para taxa de desemprego, recuando de 7,5% para 7,1%. Dentre os meses de maio, essa é a menor taxa desde maio de 2014.

Em relação aos dados da atividade econômica. Com ajuste sazonal, a taxa de desemprego recuou de 7,3% para 7,0%. Nesse sentido, vale destacar a geração líquida de vagas formais (CAGED) de maio (131.800).

Em abril, a indústria recuou 0,5% (M/M), prejudicado por bens intermediários (-1,2%), que tem o maior peso do setor. Entre os ramos, destaque para indústria extrativa (-3,4%), produtos têxteis (-2,8%) e informática (-2,6%).

O Índice de Atividade Econômica do Banco Central (IBC-Br) ficou estável na margem mensal. Entre os vetores, destaque positivo para serviços e destaque negativo para varejo ampliado e indústria.

Por outro lado, o resultado primário do governo central de maio foi de R\$ -61 bilhões, com destaque para a despesa primária (14%, A/A).

Em relação ao campo monetário, o Banco Central do Brasil (BCB) deliberou, por unanimidade, manter a taxa básica de juro (Selic) em 10,50% a.a. A manutenção foi em linha com o mercado. No ambiente externo, o Comitê avaliou que o cenário se manteve adverso, em função da incerteza elevada sobre a flexibilização monetária nos EUA. No ambiente doméstico, o Copom avaliou que o mercado de trabalho segue com dinamismo maior do que o esperado. As projeções de inflação do Copom no cenário de referência foram revisadas para cima (3,8% para 4,0% em 2024; 3,3% para 3,4% em 2025). Os itens do balanço de riscos para a inflação não se alteraram e o parágrafo sobre a condução da política fiscal teve poucas alterações, trazendo a preocupação com o impacto nos ativos financeiros. No que concerne aos próximos passos, não foi fornecido um guidance.

O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) que avançou +0,21% (M/M) em junho, desacelerando em relação ao avanço de +0,46% (M/M) observado no mês anterior. Sendo que a variação foi inferior à projeção de mercado de +0,32%. Com isso, o índice acumulou alta de +4,23% em 12 meses (ante +3,93% em maio), acelerando assim nessa base de comparação. Os itens que mais contribuíram vieram dos grupos de Alimentação e Bebidas (variação de +0,44% ante projeção de +0,71%) e Saúde e cuidados pessoais (+0,54% ante projeção de +0,7%). A maior contribuição para a variação do índice contudo, partiu do grupo Alimentação



e bebidas influenciado pelo aumento dos itens de Alimentação no domicílio com destaque para Leites e derivados.

Os preços administrados avançaram +0,33% em junho ante +0,55% de maio, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Pedágio (+3,35% ante -4,99% na leitura anterior).

Já os preços livres desaceleraram (+0,16%) ainda se mantendo como os principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres, produtos industriais, alimentos e serviços desaceleraram de +0,29% para +0,13%, de +0,66% para +0,47% e +0,4% para +0,04%, respectivamente. A média dos núcleos desacelerou na comparação mensal (de +0,39% para +0,23%), enquanto quando observada a variação acumulada em 12 meses acelerou para +3,58%.

O Ibovespa, principal índice da bolsa de valores brasileira, em junho, apresentou valorização de 1,48% em relação ao mês anterior, fechando aos 123.906 pontos. No ano, o índice acumula queda de -7,6%, se descolando das principais bolsas do mundo.

Neste contexto, a performance desfavorável no ano continua sendo explicada, sobretudo, pela possível necessidade de os Estados Unidos permanecerem com uma política monetária contracionista, o que acaba pressionando os juros dos países emergentes, como o Brasil, e dificultando a performance dos ativos de risco.

Além disso, no âmbito doméstico, os agentes do mercado permanecem com dúvidas sobre a sustentabilidade do arcabouço fiscal, bem como de que forma se dará a condução da política monetária do próximo presidente do Banco Central, fazendo com que haja estresse nos juros domésticos, no câmbio e no prêmio de risco do país, impactando negativamente a bolsa.

Ainda no curto prazo o cenário deve seguir volátil e desfavorável à alocação em equities até que se tenha uma maior certeza acerca do início de cortes de juros pelo Fed. A política monetária norte-americana segue tendo grande influência no desempenho da bolsa brasileira e tem se mostrado o principal fator que dita o apetite a risco de emergentes.

Espera-se que o fluxo estrangeiro para o Brasil aumente a partir de uma maior definição do início de cortes pelo FOMC. Internamente, é esperado que o fluxo doméstico aumente a partir de uma Selic mais próxima a um dígito, expectativa que foi prorrogada para o segundo semestre de 2025.

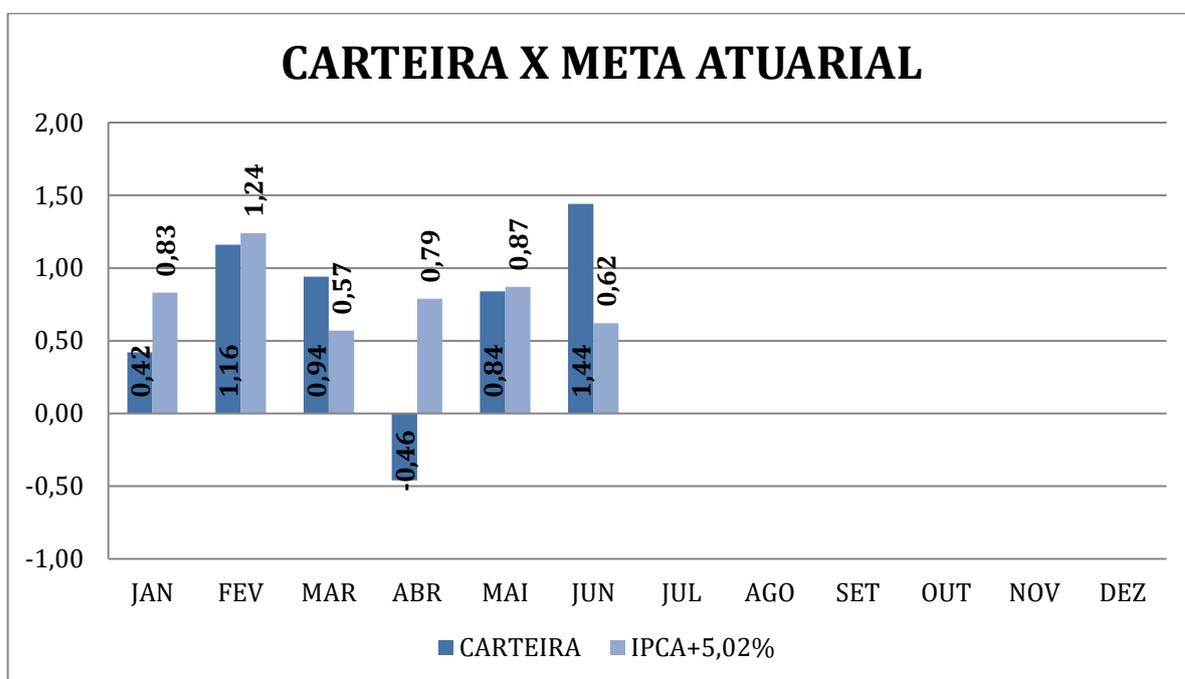


3. RESULTADO DA CARTEIRA

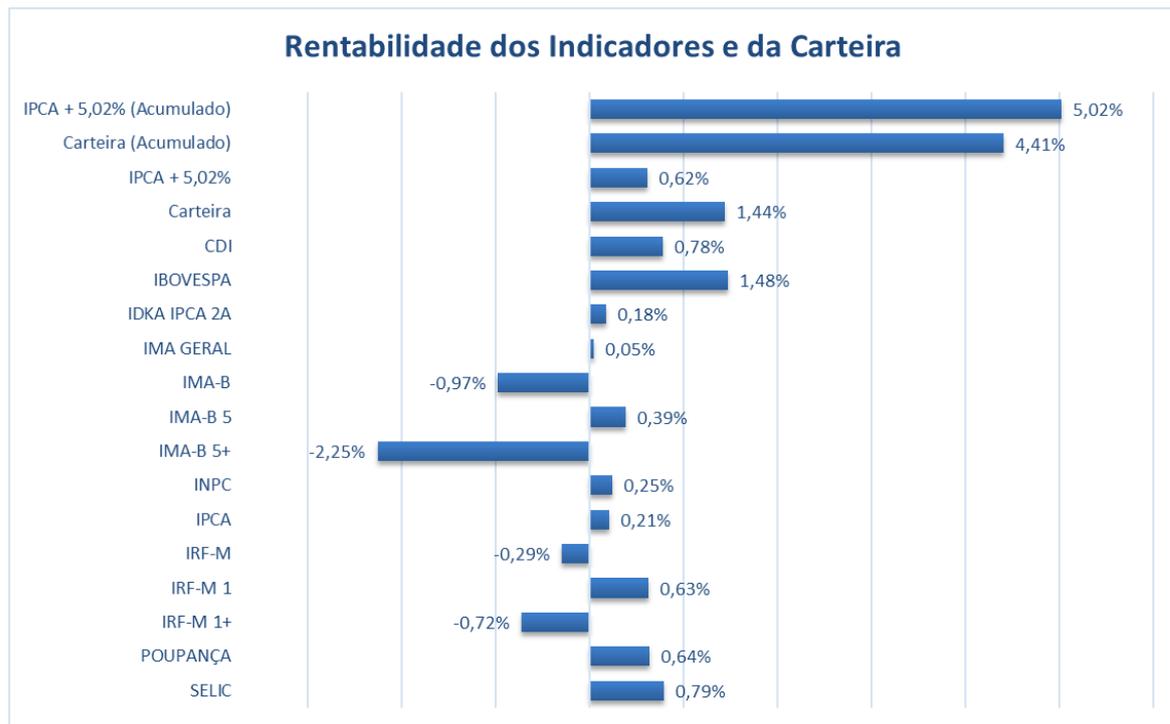
No mês de junho, nosso portfólio teve desempenho superior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com uma rentabilidade de 1,44%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 5,02%, foi de 0,62%.

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	0,84	1,44							4,41
IPCA+5,02%	0,83	1,24	0,57	0,79	0,87	0,62							5,02



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



No mês de junho, observamos um comportamento positivo em nossos fundos de investimento. Os investimentos no exterior foram os que mais contribuíram para nossa carteira. Dessa forma, as maiores altas na carteira foram do Caixa Institucional BDR Nível I com 12,73%, BB Multimercado Global Select Equity IE com 10,57% e BB Ações Globais Institucional BDR Nível I com 9,77%. Esse desempenho positivo deve-se, principalmente, à ótima temporada de resultados corporativos nos EUA e ao boom das empresas de tecnologia, especialmente ligadas a projetos de inteligência artificial. Isso foi extremamente benéfico para a classe de ativos e, conseqüentemente, para a nossa carteira.

Nesse mês, a bolsa brasileira acompanhou o cenário global. Falas mais comedidas do Presidente Lula, acenando que o governo começará a cortar gastos geraram um certo alívio. Dessa forma, quase toda a carteira do Macaeprev fechou no campo positivo, com apenas três fundos com rendimentos negativos: Caixa Brasil Ações Livre com -0,11%, Caixa Small Caps Ativo com -0,44% e Caixa FI Brasil IMA-B 5+ com -2,25%. Com isso, as forças vendedoras, devido ao contexto macroeconômico, reduziram a pressão nas cotações das nossas empresas.

Dessa forma, como expressado no relatório de maio, entendemos que a taxa de retorno esperada em um prazo maior é bem interessante e que na renda variável, por vezes, os retornos podem se materializar rapidamente, como no presente mês.



Daí a importância de mantermos nossa posição, justamente pela dificuldade de prever quando e com que intensidade essa recuperação pode ocorrer. Por isso, reforçamos a importância de permanecermos fiéis à alocação estratégica elaborada na Política Anual de Investimentos (PAI). Isso nos manterá resilientes durante a jornada e nos ajudará a alcançar melhores retornos a longo prazo. Os ativos e classes de ativos vão subir e cair ao longo da jornada, mas, ao olhar para a carteira completa, veremos resultados significativos no longo prazo.

Em média, os fundos de ações brasileiras apresentaram rentabilidade de 1,22%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno médio de 3,93%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno de 8,23%. Os fundos de investimento no exterior tiveram resultado médio de 6,19%.

Os fundos de vértice FI Caixa Brasil 2024 e BB Previdenciário RF TP XXI renderam 1,16%. As NTN-B 2024 renderam 0,90%, as NTN-B 2025 renderam 0,85%, as NTN-B 2026 renderam 0,86%, as NTN-B 2027 renderam 0,86%, as NTN-B 2028 renderam 0,86%, as NTN-B 2040 renderam 0,83%, as NTN-B 2045 renderam 0,83%, as NTN-B 2050 renderam 0,84%, as NTN-B 2055 renderam 0,84% e as NTN-B 2060 renderam 0,84%. Em média, as NTN-B ficaram com 0,85%.

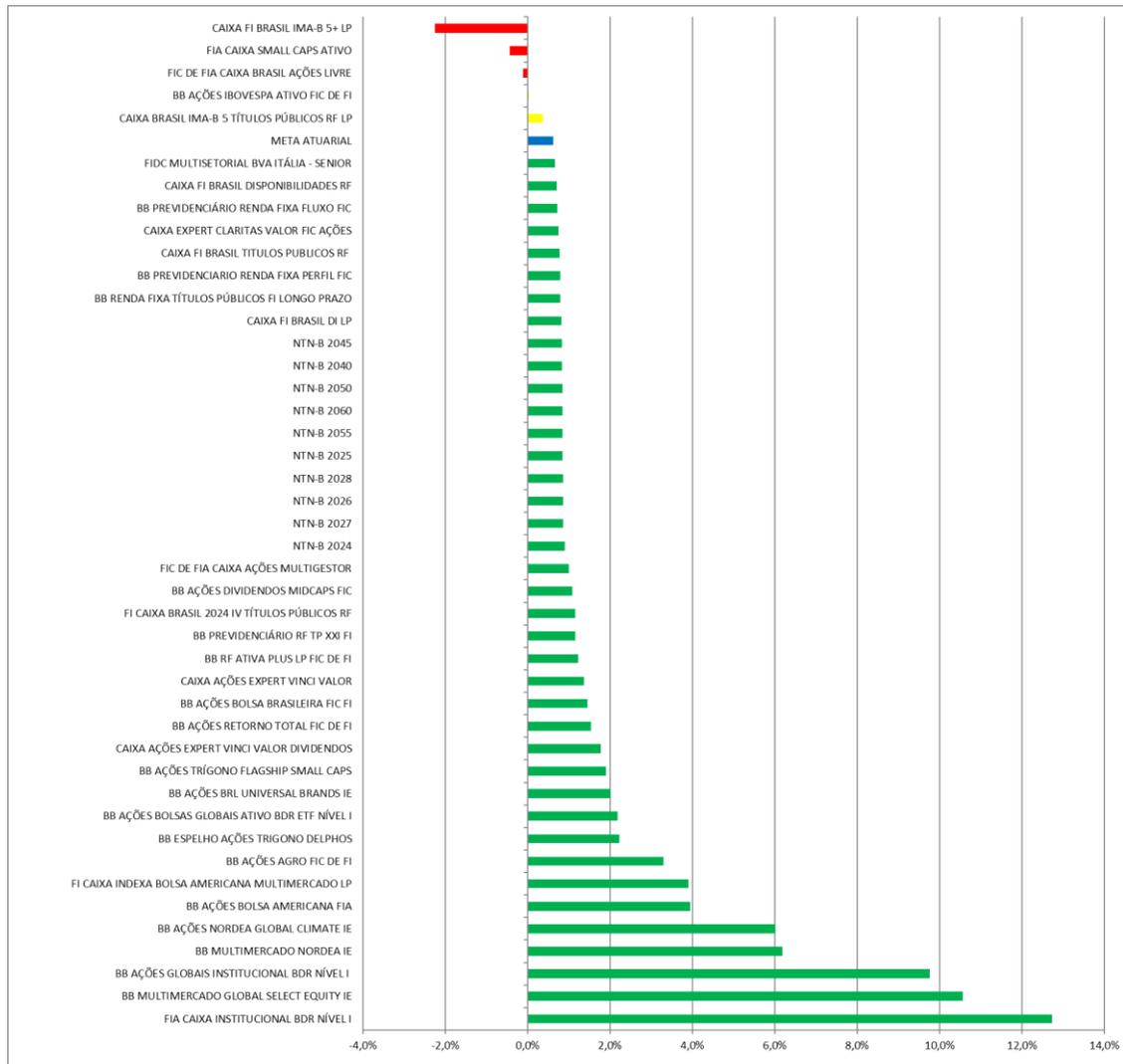
Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,80%. O fundo de renda fixa com gestão ativa rendeu 1,22%. O fundo IMA-B 5 teve um retorno de 0,37%. O fundo IMA-B 5+ teve retorno de -2,25%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade positiva de 0,66%. Até 30/06/2024 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 junho estava em R\$ 2.141.614,47 (dois milhões e cento e quarenta e um mil e seiscentos e quatorze reais e quarenta e sete 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.



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



O rendimento de junho da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 63.446.958,56 (sessenta e três milhões e quatrocentos e quarenta e seis mil e novecentos e cinquenta e oito reais e cinquenta e seis centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de junho em R\$ 4.469.121.176,15 (quatro bilhões e quatrocentos e sessenta e nove milhões e cento e vinte e um mil e cento e setenta e seis reais e quinze centavos).



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



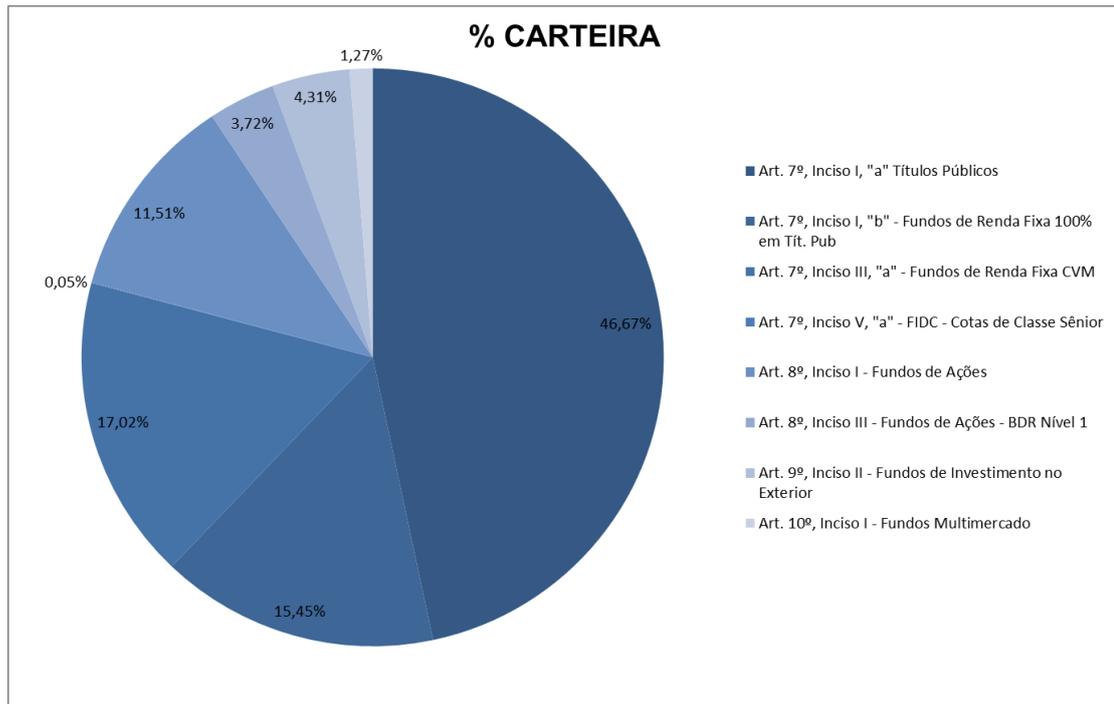
SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS

Fundo de Investimento	Saldo em 31/05/2024	Saldo em 30/06/2024	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$101,78	R\$102,50	R\$0,00	R\$0,72	0,71%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$11.686,24	R\$42.061,84	R\$16.856,69	R\$13.518,91	0,72%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2024	R\$1.051.309,24	R\$1.060.870,73	R\$0,00	R\$9.561,49	0,90%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	R\$2.096.303,37	R\$2.112.798,41	R\$0,00	R\$16.495,04	0,79%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$2.127.494,56	R\$2.141.614,47	R\$0,00	R\$14.119,91	0,66%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$4.477.462,77	R\$4.510.382,70	R\$0,00	R\$32.919,93	0,74%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$6.354.406,83	R\$6.403.669,35	R\$0,00	R\$49.262,52	0,78%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	R\$18.439.175,01	R\$18.788.876,02	R\$0,00	R\$349.701,01	1,90%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	R\$18.633.274,03	R\$19.049.301,95	R\$0,00	R\$416.027,92	2,23%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$20.252.552,66	R\$20.258.189,72	R\$0,00	R\$5.637,06	0,03%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	R\$21.054.163,59	R\$21.477.409,36	R\$0,00	R\$423.245,77	2,01%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	R\$23.550.439,28	R\$23.873.969,53	R\$0,00	R\$323.530,25	1,37%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	R\$23.887.334,95	R\$25.323.574,41	R\$0,00	R\$1.436.239,46	6,01%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$29.643.933,33	R\$30.074.637,39	R\$0,00	R\$430.704,06	1,45%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$42.615.088,09	R\$44.020.481,93	R\$0,00	R\$1.405.393,84	3,30%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	R\$44.092.203,99	R\$44.875.464,09	R\$0,00	R\$783.260,10	1,78%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$45.960.556,79	R\$46.665.967,16	R\$0,00	R\$705.410,37	1,53%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$47.199.570,63	R\$48.230.991,74	R\$0,00	R\$1.031.421,11	2,19%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$49.425.514,98	R\$49.206.187,76	R\$0,00	-R\$219.327,22	-0,44%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$50.212.765,42	R\$50.714.323,73	R\$0,00	R\$501.558,31	1,00%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$51.744.676,04	R\$52.310.587,90	R\$0,00	R\$565.911,86	1,09%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$50.944.107,29	R\$52.953.859,67	R\$0,00	R\$2.009.752,38	3,95%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$50.412.475,42	R\$53.529.463,64	R\$0,00	R\$3.116.988,22	6,18%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$54.823.037,62	R\$56.961.370,67	R\$0,00	R\$2.138.333,05	3,90%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$57.199.055,65	R\$57.136.344,41	R\$0,00	-R\$62.711,24	-0,11%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$59.706.665,78	R\$66.015.372,28	R\$0,00	R\$6.308.706,50	10,57%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$63.468.175,60	R\$69.669.670,03	R\$0,00	R\$6.201.494,43	9,77%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$66.149.094,79	R\$74.571.492,51	R\$0,00	R\$8.422.397,72	12,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$80.212.856,42	R\$80.511.538,21	R\$0,00	R\$298.681,79	0,37%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2060	R\$88.469.311,45	R\$89.221.389,60	R\$0,00	R\$752.078,15	0,84%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2040	R\$101.479.976,04	R\$102.337.936,48	R\$0,00	R\$857.960,44	0,83%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$116.607.365,69	R\$117.561.893,32	R\$0,00	R\$954.527,63	0,82%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	R\$144.035.958,52	R\$140.798.982,65	R\$0,00	-R\$3.236.975,87	-2,25%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2028	R\$151.871.781,57	R\$153.194.372,51	R\$0,00	R\$1.322.590,94	0,86%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2055	R\$185.527.709,76	R\$187.104.221,28	R\$0,00	R\$1.576.511,52	0,84%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2026	R\$204.740.638,02	R\$206.513.329,04	R\$0,00	R\$1.772.691,02	0,86%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$214.660.220,37	R\$217.148.956,06	R\$0,00	R\$2.488.735,69	1,16%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	R\$221.353.037,86	R\$224.052.911,32	R\$0,00	R\$2.699.873,46	1,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$240.890.709,58	R\$243.685.097,73	R\$0,00	R\$2.794.388,15	1,16%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2045	R\$267.828.953,47	R\$270.098.364,07	R\$0,00	R\$2.269.410,60	0,83%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2050	R\$293.580.272,89	R\$296.073.678,86	R\$0,00	R\$2.493.405,97	0,84%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2027	R\$346.158.955,32	R\$349.174.118,74	R\$0,00	R\$3.015.163,42	0,86%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$417.600.781,43	R\$418.779.757,80	-R\$2.110.000,00	R\$3.288.976,37	0,79%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2025	R\$427.216.206,78	R\$430.885.592,58	R\$0,00	R\$3.669.385,80	0,85%
TOTAL	R\$4.407.767.360,90	R\$4.469.121.176,15	-R\$2.093.143,31	R\$63.446.958,56	1,44%

4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

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

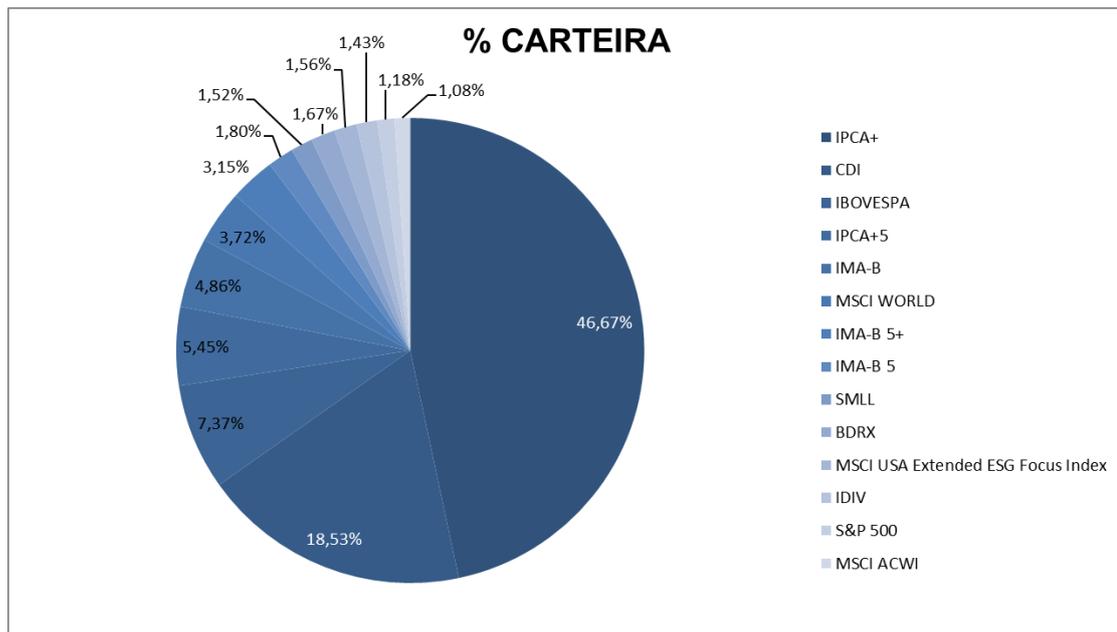
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024									
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo			Total
Art. 7º, Inciso I, "a" - Títulos Públicos		46,67%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	Não se Aplica			R\$2.085.663.873,89
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	IPCA+	46,67%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	N/A			R\$2.085.663.873,89
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		15,45%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓			R\$690.661.042,41
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	CDI	0,05%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,01%	✓		R\$2.112.798,41
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	0,14%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,06%	✓		R\$6.403.669,35
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	1,80%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,10%	✓		R\$80.511.538,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	4,86%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	5,38%	✓		R\$217.148.956,06
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	IMA-B 5+	3,15%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	12,30%	✓		R\$140.798.982,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	5,45%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	6,59%	✓		R\$243.685.097,73
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		17,02%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓			R\$760.436.726,78
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	9,37%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	2,35%	✓		R\$418.779.757,80
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00%	✓		R\$42.061,84
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	CDI	5,01%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	4,68%	✓		R\$224.052.911,32
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	2,63%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,71%	✓		R\$117.561.893,32
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00%	✓		R\$102,50
Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior		0,05%	5,00% ✓	0,20% ✓	20,00% ✓	5,00% ✓			R\$2.141.614,47
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,05%	5,00% ✓	0,20% ✓	20,00% ✓	3,64%	✓		R\$2.141.614,47
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		11,51%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓			R\$514.438.573,96
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,45%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	14,49%	✓		R\$20.258.189,72
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,67%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	14,87%	✓		R\$30.074.637,39
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,98%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	22,66%	✗		R\$44.020.481,93
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	1,18%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	3,60%	✓		R\$52.953.859,67
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,04%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	6,69%	✓		R\$46.665.967,16
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	1,17%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	7,23%	✓		R\$52.310.587,90
BB AÇÕES TRIGONO DELPHOS INCOME FIA	IDIV	0,43%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	9,92%	✓		R\$19.049.301,95
BB AÇÕES TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	SMLL	0,42%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	33,61%	✓		R\$18.788.876,02
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	IBOVESPA	0,53%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	3,19%	✓		R\$23.873.969,53
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	IDIV	1,00%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	4,43%	✓		R\$44.875.464,09
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,10%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	16,35%	✓		R\$4.510.382,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,10%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	8,15%	✓		R\$49.206.187,76
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,13%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	9,26%	✓		R\$50.714.323,73
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,28%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	8,65%	✓		R\$57.136.344,41
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		4,31%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓			R\$192.472.154,28
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,56%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	4,22%	✓		R\$69.669.670,03
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	1,08%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	12,04%	✓		R\$48.230.991,74
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,67%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	2,72%	✓		R\$74.571.492,51
Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior		3,72%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓			R\$166.345.819,69
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	1,48%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	4,22%	✓		R\$66.015.372,28
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	MSCI WORLD	0,57%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	6,26%	✓		R\$25.323.574,41
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	MSCI WORLD	0,48%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	9,92%	✓		R\$21.477.409,36
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	1,20%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	41,60%	✓		R\$53.529.463,64
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		1,27%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓			R\$56.961.370,67
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,27%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	2,89%	✓		R\$56.961.370,67
Total:									R\$4.469.121.176,15



4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

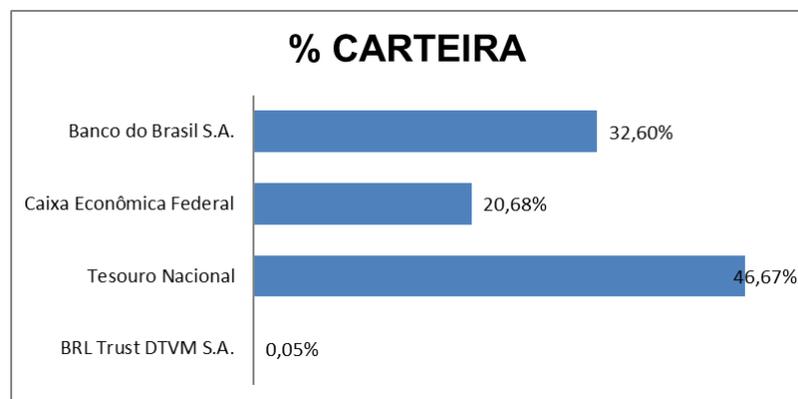
Indicador	Saldo em 31/05/2024	Participação
IPCA+	R\$2.085.663.873,89	46,67%
CDI	R\$828.056.179,68	18,53%
IBOVESPA	R\$329.564.884,47	7,37%
IPCA+5	R\$243.685.097,73	5,45%
IMA-B	R\$217.148.956,06	4,86%
MSCI WORLD	R\$166.345.819,69	3,72%
IMA-B 5+	R\$140.798.982,65	3,15%
IMA-B 5	R\$80.511.538,21	1,80%
SMLL	R\$67.995.063,78	1,52%
BDRX	R\$74.571.492,51	1,67%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$69.669.670,03	1,56%
IDIV	R\$63.924.766,04	1,43%
S&P 500	R\$52.953.859,67	1,18%
MSCI ACWI	R\$48.230.991,74	1,08%
Total	R\$4.469.121.176,15	100,00%



4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$2.141.614,47	0,05%
Tesouro Nacional	R\$2.085.663.873,89	46,67%
Caixa Econômica Federal	R\$924.274.677,49	20,68%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.457.041.010,30	32,60%





5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

MOVIMENTAÇÕES

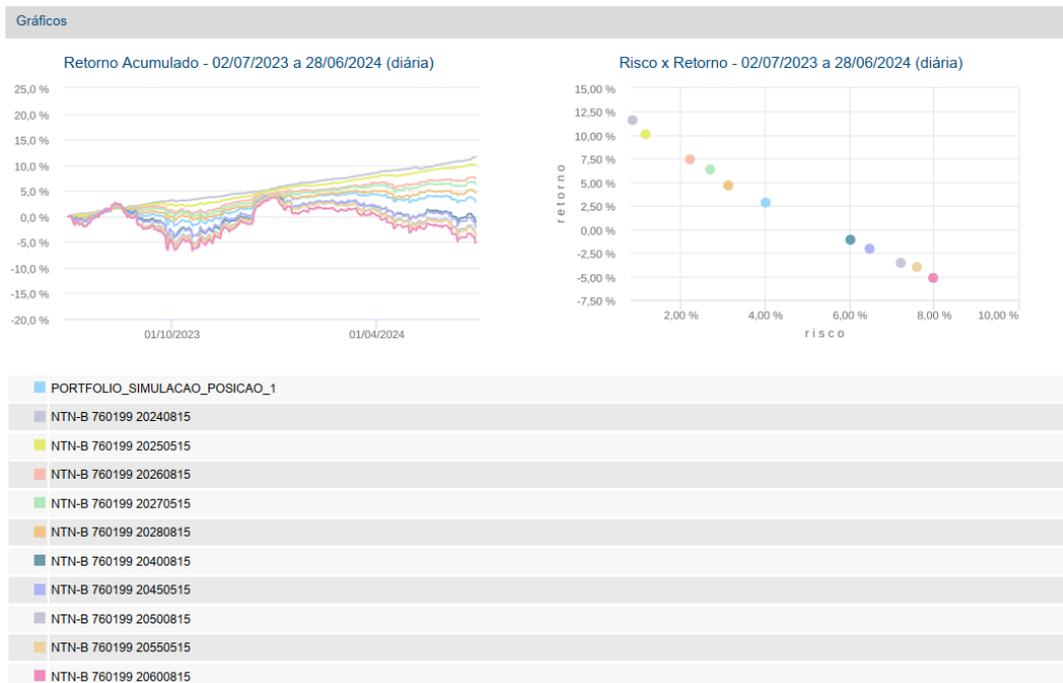
APLICAÇÕES		
Data	Valor	
03/06/2024	R\$5.410,96	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
04/06/2024	R\$4.342,05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
05/06/2024	R\$138.641,85	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
06/06/2024	R\$41.374,25	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
07/06/2024	R\$45.652,61	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
10/06/2024	R\$229,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
11/06/2024	R\$288.991,16	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
12/06/2024	R\$46.386,08	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
13/06/2024	R\$1.451,94	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
17/06/2024	R\$5.830,37	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
20/06/2024	R\$4.604.316,28	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
24/06/2024	R\$652,08	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
25/06/2024	R\$9.949.132,45	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
27/06/2024	R\$2.832,24	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

RESGATES		
Data	Valor	Ativo
05/06/2024	R\$810.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
14/06/2024	R\$5.188,06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
26/06/2024	R\$1.300.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
26/06/2024	R\$14.122.342,03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
28/06/2024	R\$990.856,84	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$15.135.243,62
Resgates	-R\$17.228.386,93
Saldo	-R\$2.093.143,31

6. MONITORAMENTO DE RISCOS

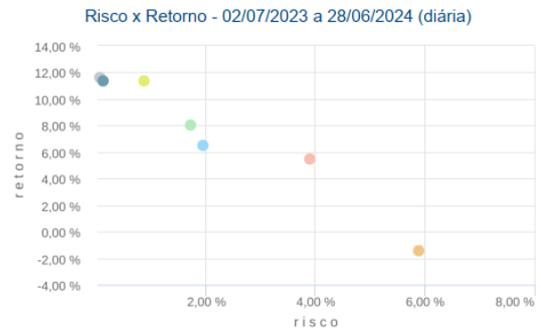
6.1. ART. 7º, INCISO I, “A” – TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOIRO NACIONAL





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

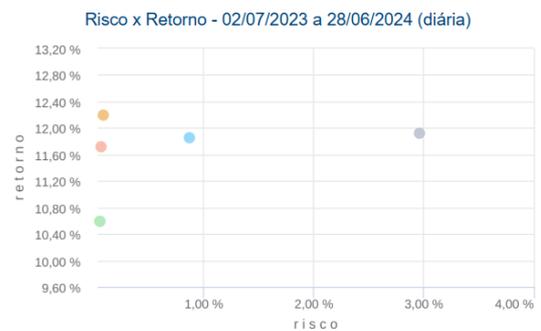
Gráficos



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

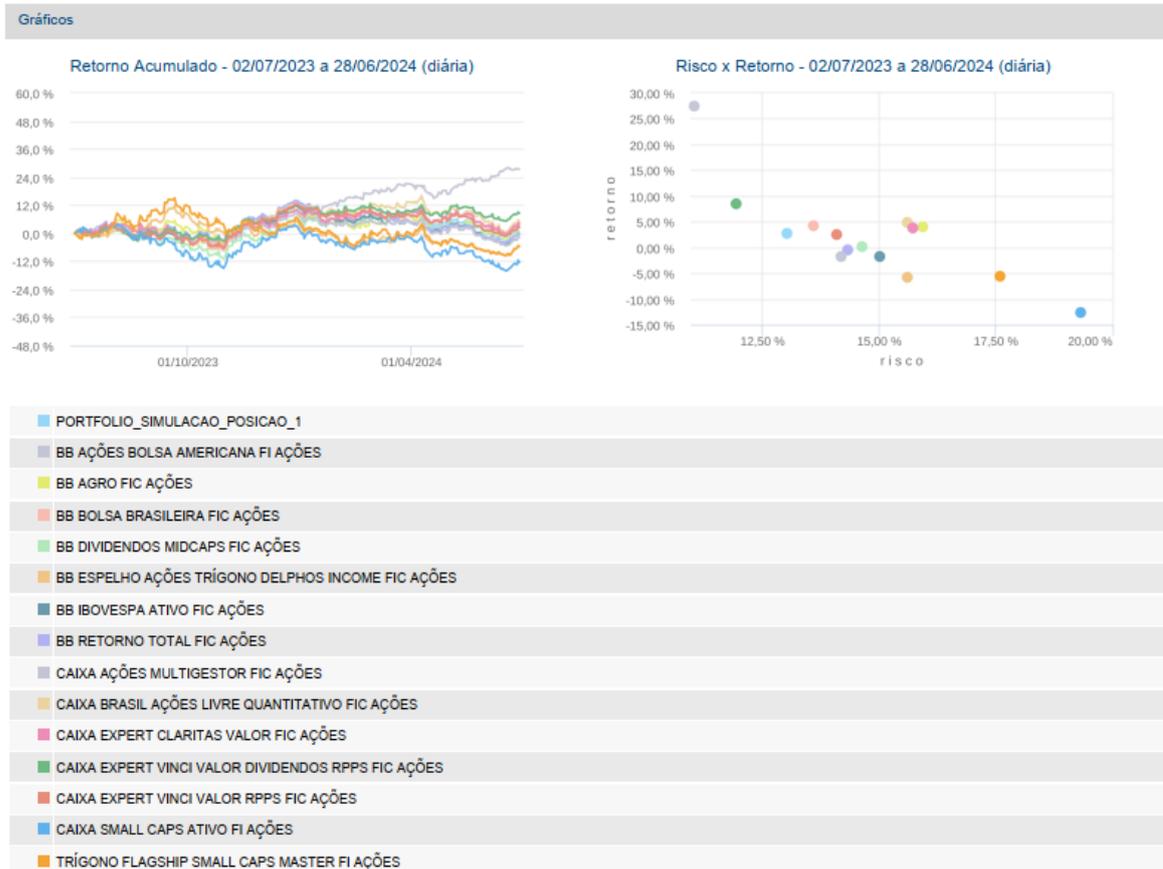
6.3. ART. 7º, INCISO III, “A” – FUNDOS DE RENDA FIXA CVM

Gráficos

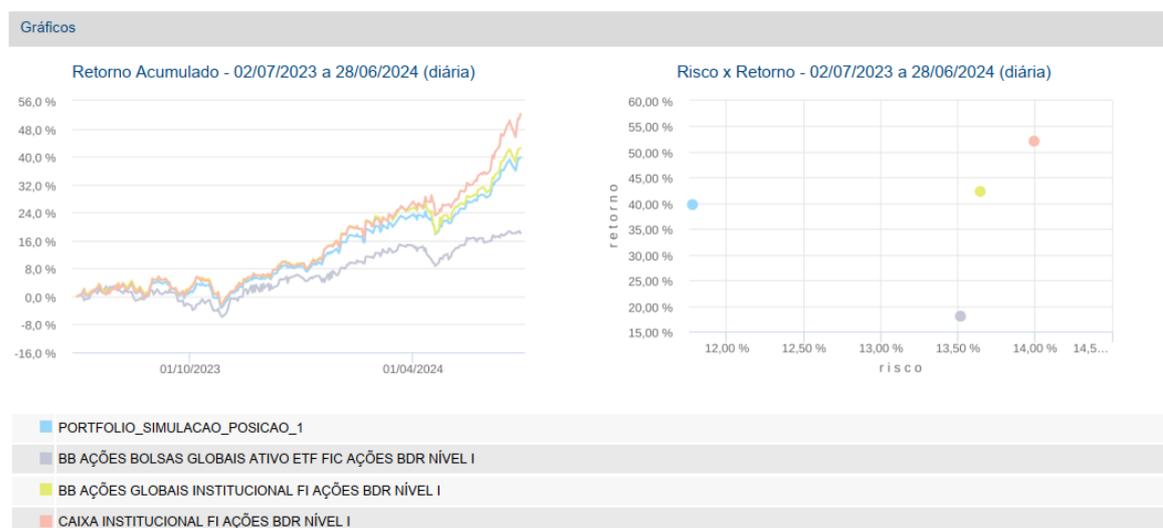


PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP

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	0,78%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,81%	
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,78%	5,19%	2,51%	5,19%	11,33%	26,39%	0,03%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,77%	4,99%	2,38%	4,99%	11,33%	26,39%	0,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,78%	5,24%	2,52%	5,24%	11,70%	26,83%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	0,71%	4,70%	2,27%	4,70%	10,58%	24,34%	0,03%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	1,22%	7,47%	3,83%	7,47%	11,92%	24,18%	0,34%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,81%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,39%	0,03%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,70%	4,69%	2,27%	4,69%	10,59%	23,51%	0,03%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	0,66%	-1,38%	-3,06%	-1,38%	206,83%	25,11%	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	3,90%	16,69%	5,01%	16,69%	29,36%	66,02%	0,42%
IMA-B 5	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,22%	19,29%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	0,37%	3,20%	1,17%	3,20%	7,97%	18,81%	0,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,37%	3,21%	1,18%	3,21%	7,99%	18,98%	0,14%
IMA-B	-0,96%	-1,09%	-1,27%	-1,09%	3,06%	17,00%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	-0,99%	-1,22%	-1,34%	-1,22%	2,87%	16,57%	0,44%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,15%	2,78%	2,86%	2,78%	5,45%	7,72%	0,04%
IMA-B 5+	-2,25%	-5,04%	-3,58%	-5,04%	-1,43%	14,67%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	-2,28%	-5,20%	-3,65%	-5,20%	-1,73%	13,88%	0,74%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	-2,24%	-5,07%	-3,61%	-5,07%	-1,41%	14,08%	0,73%
IPCA + 5%	0,60%	4,97%	2,29%	4,97%	9,43%	18,69%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	1,16%	5,72%	2,86%	5,72%	11,34%	20,69%	0,04%
IBOVESPA	1,48%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	0,03%	-11,99%	-6,72%	-11,99%	-1,82%	15,53%	1,29%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	1,45%	-7,98%	-3,46%	-7,98%	4,14%	24,07%	1,17%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	3,29%	-5,65%	-3,66%	-5,65%	3,90%	11,32%	1,55%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	1,53%	-12,64%	-6,03%	-12,64%	-0,45%	5,66%	1,18%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	1,09%	-5,84%	-7,70%	-5,84%	0,15%	28,14%	1,52%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	1,37%	-8,82%	-5,44%	-8,81%	2,40%	17,86%	1,23%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	0,74%	-5,63%	-5,40%	-5,63%	3,76%	18,93%	1,50%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	0,99%	-9,38%	-6,70%	-9,38%	-1,76%	13,42%	1,39%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	-0,11%	-6,86%	-7,64%	-6,86%	4,76%	26,67%	1,87%
IDIV	1,99%	-3,40%	0,59%	-3,40%	11,68%	31,09%	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	1,77%	-3,39%	-1,09%	-3,39%	8,55%	27,99%	1,06%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	2,23%	-10,43%	-5,35%	-10,43%	-5,79%	0,00%	1,26%
SMLL	-0,39%	-14,83%	-10,38%	-14,83%	-10,97%	3,99%	
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	1,89%	-11,14%	-6,39%	-11,15%			1,24%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-0,44%	-15,11%	-11,33%	-15,11%	-12,55%	3,93%	1,94%
BDRX	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	58,78%	77,13%	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,73%	39,51%	21,34%	39,51%	52,17%	72,57%	1,19%
MSCI WORLD	1,93%	10,81%	2,18%	10,81%	20,22%	34,06%	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	10,56%	31,46%	15,78%	31,46%	46,24%	65,37%	0,77%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	6,01%	22,20%	10,70%	22,20%	26,36%	31,90%	1,06%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	2,01%	3,74%	-0,96%	3,74%	10,52%	32,49%	0,70%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	6,18%	14,49%	7,43%	14,49%	20,68%	22,23%	0,82%
MSCI ACWI	2,10%	10,32%	2,41%	10,32%	19,02%	30,90%	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	2,18%	11,40%	2,92%	11,40%	18,06%	37,04%	0,58%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	3,37%	13,67%	3,62%	13,67%	24,20%	37,41%	
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9,77%	30,17%	14,25%	30,17%	42,37%	57,22%	1,03%
S&P 500	5,34%	11,21%	4,63%	16,57%	27,78%	33,32%	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	3,94%	16,23%	5,15%	16,23%	27,38%	56,33%	0,48%



8. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

8.1. RENTABILIDADE

A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,36% no mês de junho, totalizando um saldo de R\$ 242.228.375,12 (duzentos e quarenta e dois milhões e duzentos e vinte e oito mil e trezentos e setenta e cinco reais e doze centavos).

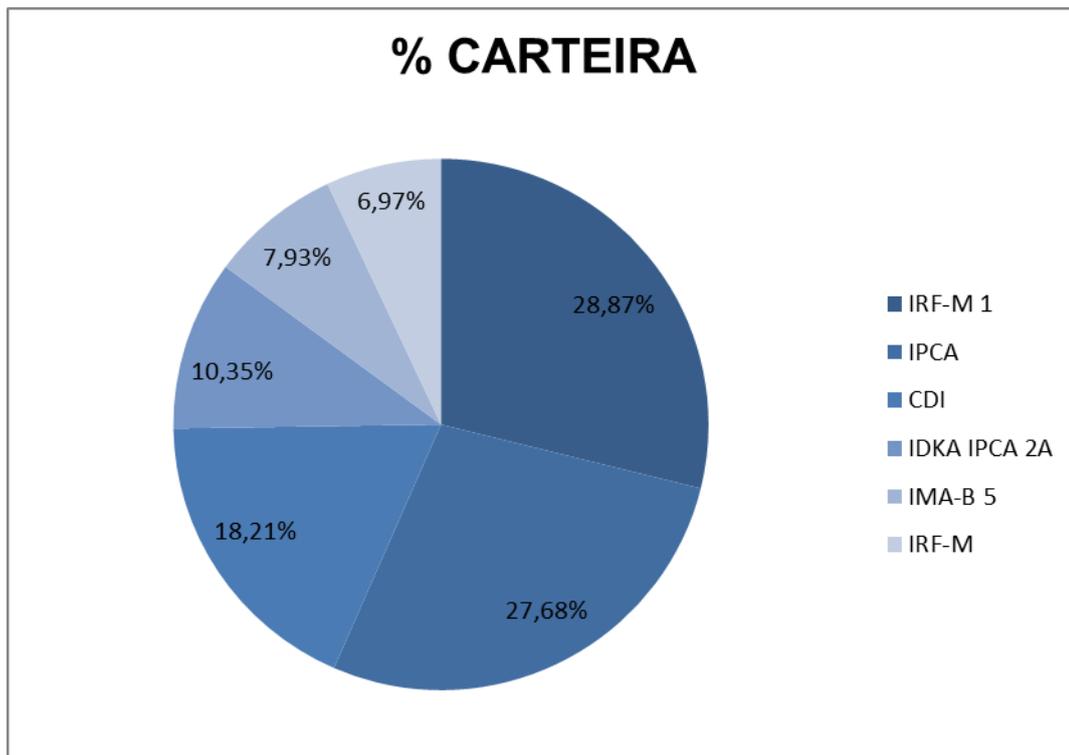
8.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

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		53,89%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$130.568.903,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	IRF-M 1	28,60%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,82%	✓	R\$69.282.788,91
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	0,09%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,00%	✓	R\$224.211,83
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2A	10,32%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,44%	✓	R\$25.002.592,32
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	7,89%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,37%	✓	R\$19.125.205,54
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	IRF-M	6,99%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,41%	✓	R\$16.934.104,64
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		34,09%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$82.584.332,76
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COT	CDI	6,37%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,09%	✓	R\$15.444.734,72
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	CDI	0,15%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,01%	✓	R\$366.033,60
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,00%	✓	R\$1.454,38
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	27,56%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	1,01%	✓	R\$66.782.110,06
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		12,02%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$29.127.799,32
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,02%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	2,15%	✓	R\$29.127.799,32
Total:											R\$242.281.035,32

8.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

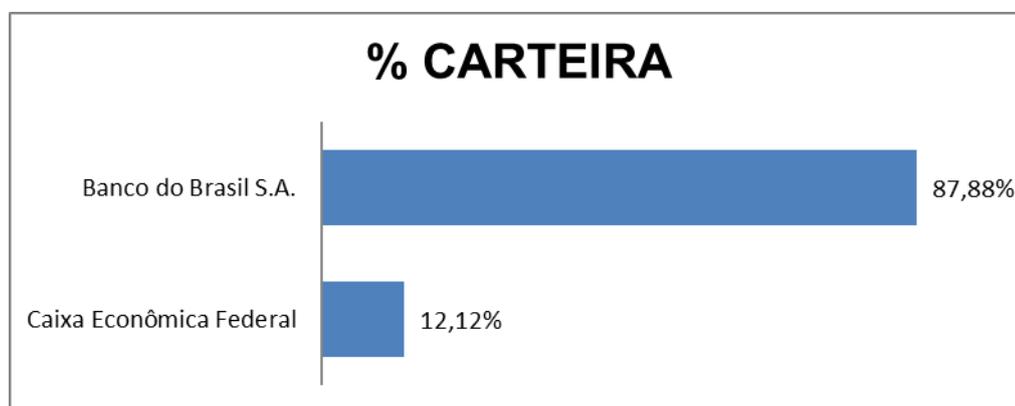
Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
IRF-M 1	R\$69.927.835,89	28,87%
IPCA	R\$67.037.846,58	27,68%
CDI	R\$44.118.793,09	18,21%
IDKA IPCA 2A	R\$25.066.564,91	10,35%
IMA-B 5	R\$19.196.706,21	7,93%
IRF-M	R\$16.880.628,44	6,97%
	R\$242.228.375,12	100,00%



8.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$29.355.751,52	12,12%
Banco do Brasil S.A.	R\$212.872.623,60	87,88%





9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

9.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado positivo de 1,52% e fechou o mês com o saldo de R\$ 29.001.319,43 (vinte e nove milhões e um mil e trezentos e dezenove reais e quarenta e três centavos).

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

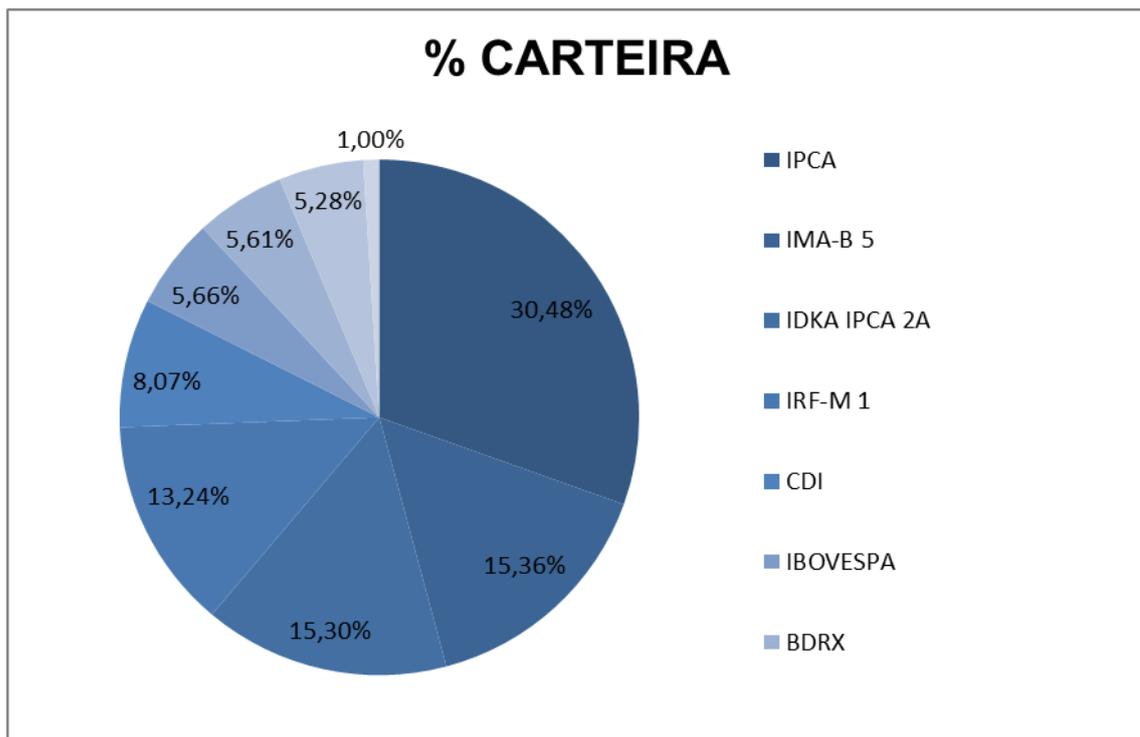
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024											
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução		% Limite PAI 2024		% Limite dos Recursos do RPPS		% Participação no PL do Fundo		Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		59,56%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$17.013.285,51
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	6,60%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,02%	✓	R\$1.884.766,76
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	6,76%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,02%	✓	R\$1.932.250,93
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	15,50%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.429.249,67
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	15,53%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.437.780,90
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	15,15%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.329.237,25
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		15,71%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$4.486.471,91
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,71%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,07%	✓	R\$4.486.471,91
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		6,72%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$1.918.313,72
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	IBOVESPA	1,52%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$434.182,32
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,11%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$318.484,04
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,75%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,08%	✓	R\$500.946,24
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,31%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,07%	✓	R\$374.572,51
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,02%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$290.128,61
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		9,94%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$2.838.365,04
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	4,88%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,09%	✓	R\$1.394.537,24
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	5,05%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$1.443.827,80
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		8,09%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$2.310.637,07
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	2,56%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,64%	✓	R\$732.226,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,54%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,35%	✓	R\$724.268,36
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,99%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$854.141,85
Total: R\$28.567.073,25											



9.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
IPCA	R\$8.840.269,06	30,48%
IMA-B 5	R\$4.454.371,80	15,36%
IDKA IPCA 2A	R\$4.437.893,77	15,30%
IRF-M 1	R\$3.840.185,15	13,24%
CDI	R\$2.340.116,29	8,07%
IBOVESPA	R\$1.641.181,91	5,66%
BDRX	R\$1.627.662,40	5,61%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.530.797,89	5,28%
SMLL	R\$288.841,16	1,00%
	R\$29.001.319,43	100,00%

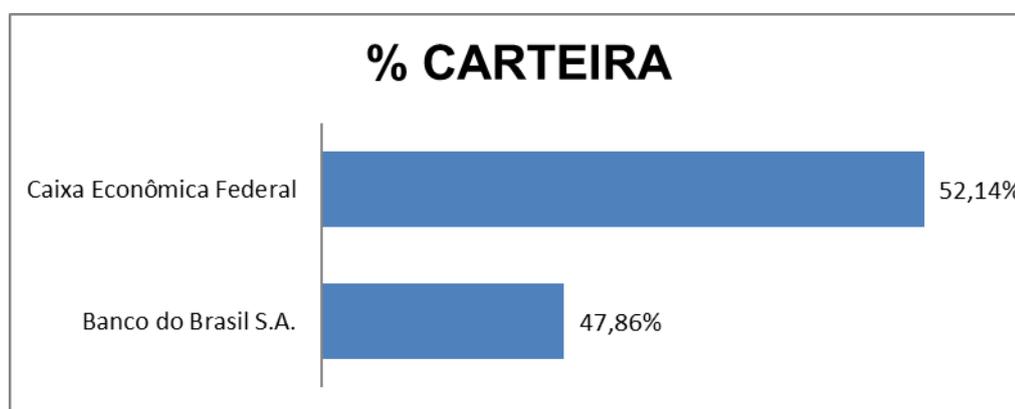




9.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$13.881.220,68	47,86%
Caixa Econômica Federal	R\$15.120.098,75	52,14%



10. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

10.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de 1,16% e fechou o mês com o saldo de R\$ 20.750.140,59 (vinte milhões e setecentos e cinquenta mil e cento e quarenta reais e cinquenta e nove centavos).

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

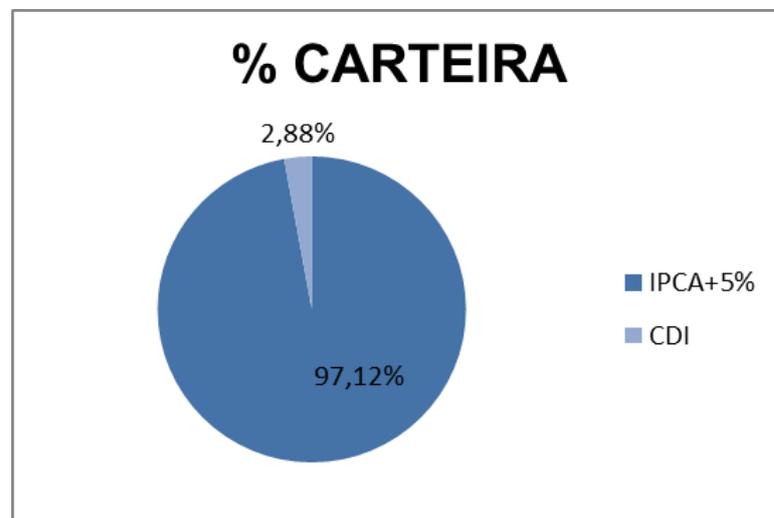
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024									
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total		
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		97,12%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$20.152.165,65		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA + 5%	97,12%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,58%	R\$20.152.165,65		
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00%	R\$597.974,94		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00%	R\$597.974,94		
Total:							R\$20.750.140,59		



10.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

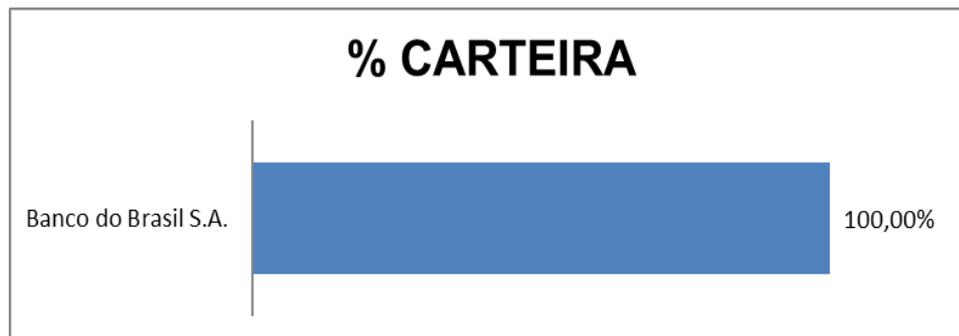
Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
IPCA+5%	R\$20.152.165,65	97,12%
CDI	R\$597.974,94	2,88%
	R\$20.750.140,59	100,00%



10.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$20.750.140,59	100,00%





11. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023

11.1. RENTABILIDADE

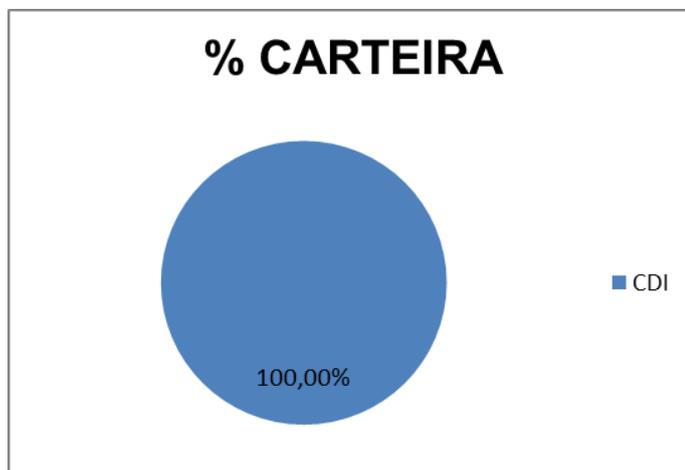
A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um resultado de 1,17% e fechou o mês com o saldo de R\$ 35.333.842,83 (trinta e cinco milhões e trezentos e trinta e três mil e oitocentos e quarenta e dois reais e oitenta e três centavos).

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 Tít. Pub		100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$35.333.842,83		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA+5%	100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,02% ✓	R\$35.333.842,83		
Total:							R\$35.333.842,83		

11.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

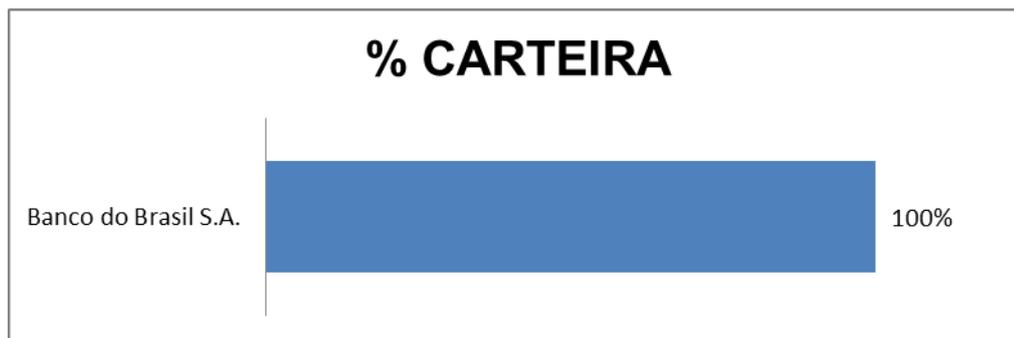
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
IPCA+5%	R\$35.333.842,83	100,00%
	R\$35.333.842,83	100,00%





11.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$35.333.842,83	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 0,79% e fechou o mês com o saldo de R\$ 40.935.382,38 (quarenta milhões e novecentos e trinta e cinco mil e trezentos e oitenta e dois reais e trinta e oito centavos).

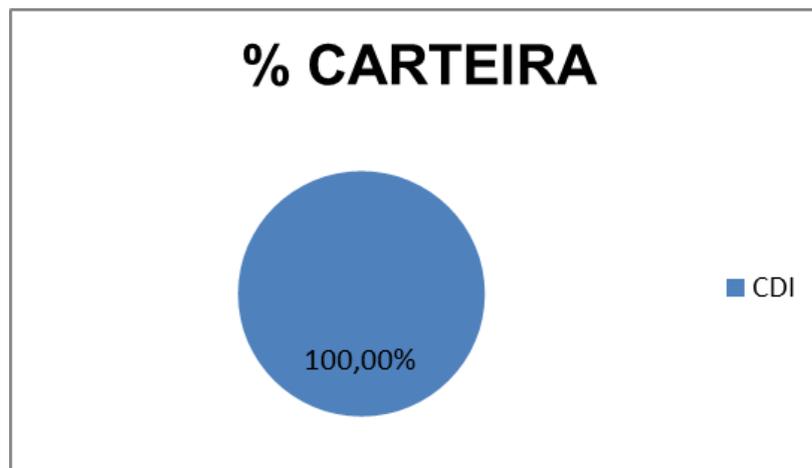
12.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

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\$40.935.382,38
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	100,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,23%	✓	R\$40.935.382,38
Total:										R\$40.935.382,38	



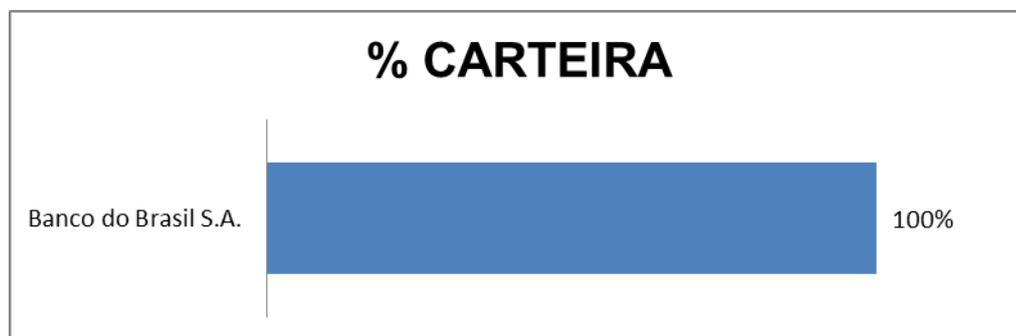
12.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
CDI	R\$40.935.382,38	100,00%
	R\$40.935.382,38	100,00%



12.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$40.935.382,38	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%
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



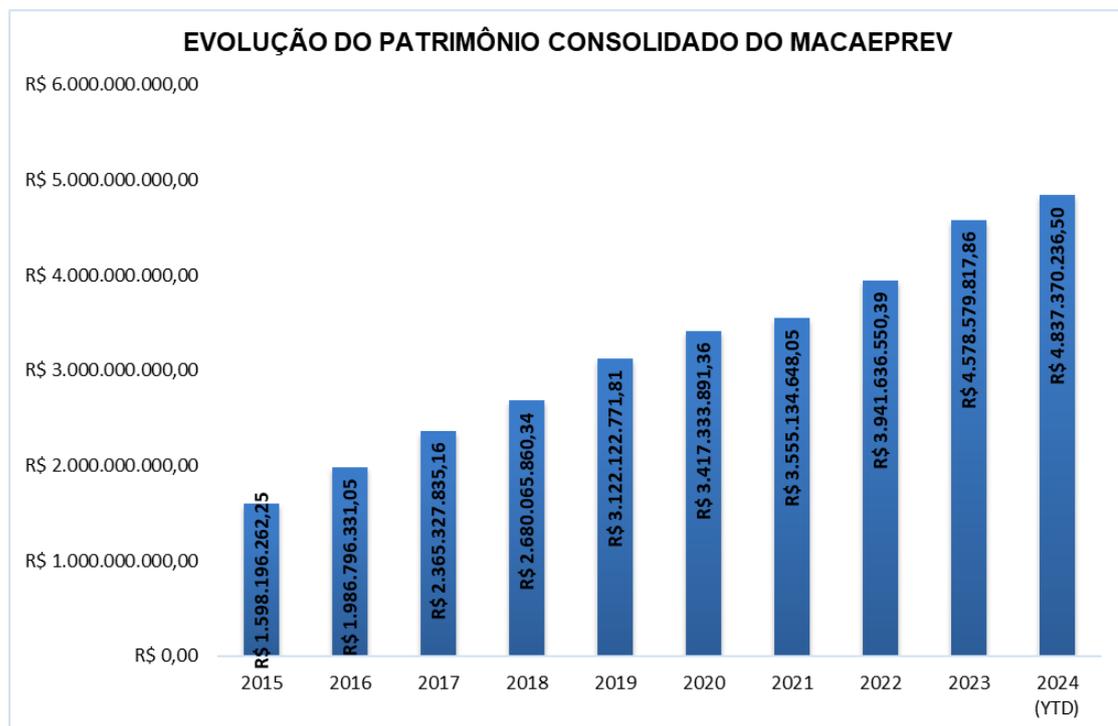
13.2. CUSTO SELIC PARA OS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

CUSTOS SELIC		
Ativos	Patrimônio (R\$)	SELIC
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	R\$ 2.085.663.873,89	R\$ 5.745,16



14. CONCLUSÃO

O Macaeprev encerrou o mês de junho de 2024 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 4.837.370.236,50 (quatro bilhões e oitocentos e trinta e sete milhões e trezentos e setenta mil e duzentos e trinta e seis reais e cinquenta centavos). O gráfico a seguir apresenta a evolução patrimonial do Macaeprev a cada final de exercício.



Macaé, 24 de julho de 2024.

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



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e quatro dias do mês de julho 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 **junho** de 2024;

Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos o qual segue na íntegra na ata do dia de hoje: **24 de julho de 2024**.

Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de **junho 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 **JUNHO de 2024**, o qual segue para aprovação do Conselho Fiscal. É o parecer.

COMITÊ DE INVESTIMENTOS:

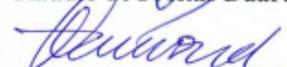

Alfredo Tanos Filho


Erenildo Motta da Silva Júnior


José Eduardo da Silva Guinâncio


Patric Alves de Vasconcelos


Claudio de Freitas Duarte


Fábio de Carvalho de Moraes Drumond


Miriam Amaral Queiroz


Viviane da Silva Lourenço Campos