

# RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



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



**JULHO - 2024**



## SUMÁRIO

<b>1. INTRODUÇÃO .....</b>	<b>4</b>
<b>2. CENÁRIO ECONÔMICO.....</b>	<b>4</b>
<b>3. RESULTADO DA CARTEIRA.....</b>	<b>8</b>
<b>4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA .....</b>	<b>14</b>
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
<b>5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES .....</b>	<b>17</b>
<b>6. MONITORAMENTO DE RISCOS .....</b>	<b>17</b>
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
<b>7. ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS E VALUE AT RISK (VaR) .....</b>	<b>21</b>
<b>8. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO .....</b>	<b>22</b>
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
<b>9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021 .....</b>	<b>24</b>
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
<b>10. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022 .....</b>	<b>26</b>
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
<b>11. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023 .....</b>	<b>28</b>
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
<b>12. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2024 .....</b>	<b>29</b>
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
<b>13. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES .....</b>	<b>31</b>
13.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS .....	31
13.2. CUSTO SELIC PARA OS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS.....	32
<b>14. CONCLUSÃO.....</b>	<b>33</b>



## 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 julho 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 julho, os mercados foram agitados por eventos políticos e econômicos, como a desistência da candidatura à reeleição do presidente dos Estados Unidos, Joe Biden, e o discurso mais dovish do presidente do Federal Reserve (Fed), Jerome Powell, após a última reunião do Federal Open Market Committee (FOMC). 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 tensão no oriente médio aumentou neste mês com um ataque a lideranças do Hamas em solo iraniano, o que reduziu a probabilidade de um cessar-fogo e aumentou o risco de uma escalada para um conflito regional envolvendo Israel e Irã. Além disso, a guerra da Ucrânia completa 29 meses, sem perspectivas de avanço nas negociações diplomáticas.

Nos EUA, os dados do varejo ficaram estáveis (0,0%), acima das expectativas do mercado, que esperava queda de -0,3%. Além disso, o resultado do mês anterior foi revisado para cima, de +0,1% para +0,3%.

O Índice de Gerente de Compras (PMI, na sigla em inglês) composto dos Estados Unidos, que reúne dados do setor industrial e, também de serviços, subiu marginalmente para 54,8 em junho, ante 54,5 em maio, segundo dados da S&P Global. É o crescimento mais rápido da atividade em 22 meses.

A inflação medida pelo índice CPI em junho caiu 0,1% (M/M). O resultado significa uma desaceleração na comparação anual. Nos últimos 12 meses até junho, o índice ficou



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



em 3%. Os dados vieram abaixo das estimativas do mercado, que esperava alta mensal de 0,1% e anual de 3,1%. Já a inflação medida pelo PCE de maio apresentou estabilidade ante o crescimento de 0,1% (M/M) em junho, com estabilidade do índice acumulado em 12 meses em 2,6%, abaixo da projeção de mercado.

No mês de junho, foram geradas 206 mil vagas, abaixo da estimativa revisada para baixo de 215 mil, mesmo assim o mercado de trabalho continua a mostrar dados robustos. No entanto, a taxa de desemprego subiu de 4% para 4,1%, marcando a primeira vez desde novembro de 2021 que a taxa de desemprego ficou acima de 4%. Esse cenário continua a pressionar a política monetária, o que pode levar à manutenção das taxas de juros por um período mais longo.

O 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. Com relação à conjuntura econômica, o comunicado realizou uma necessária adequação, reconhecendo os avanços recentes obtidos na direção de um melhor equilíbrio entre os dois objetivos do mandato do Fed. Especificamente, o documento novamente indicou que a atividade econômica continuou se expandindo a um ritmo sólido, mas avaliou que os ganhos de empregos “moderaram” e que a “taxa de desemprego subiu” apesar de permanecer baixa.

Em conferência, Jerome Powell inclusive revelou que houve uma discussão sobre um possível corte, mas que foi constituída uma forte maioria pela manutenção. Ele também teve que esclarecer que um corte inicial de 50 bps não era algo com o que o comitê estaria considerando e, em linhas gerais, deixou claro que o momento para ajustar juros está próximo.

Na China, por sua vez, o People's Bank of China (PBoC) informou que reduziu as suas taxas referenciais de empréstimos (Loan Prime Rate - LPR) em 10 bps, com a taxa de um ano passando de 3,45% a.a. para 3,35% a.a. e a de cinco anos passando de 3,95% a.a. para 3,85% a.a. A decisão surpreendeu o mercado, cuja mediana das expectativas apontava para a manutenção dos respectivos patamares. Esse efeito tem sustentado o bom desempenho da indústria. No entanto, o segmento imobiliário ainda apresenta dados frustrantes e desempenho abaixo das expectativas.

Falando um pouco de Japão, o Policy Board do Bank of Japan (BoJ) decidiu, com 7 votos favoráveis e 2 contrários, elevar sua taxa de juros de curto prazo do intervalo (0,0% a 0,1% a.a.) para em torno de 0,25% a.a., mantendo sua política monetária em terreno acomodatório, mas surpreendendo o mercado que esperava pela manutenção.



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



Na Zona do Euro, a inflação medida pelo CPI de junho desacelerou de 2,6% para 2,5% (A/A), em linha com as expectativas de mercado (2,5%).

O Banco Central Europeu (BCE) manteve estáveis suas três taxas de juros diretoras, em linha com a expectativa do mercado. Assim, as taxas de juros das operações principais de refinanciamento, de cedência de liquidez e de depósito permaneceram, respectivamente, no patamar de 4,25%, 4,50% e 3,75%.

No comunicado, a autoridade monetária justificou a decisão pelo fato de o cenário seguir corroborando a avaliação da instituição de convergência da inflação para a meta no médio prazo. De acordo com o documento, o Conselho do BCE segue determinado a assegurar o retorno da inflação para o seu objetivo no horizonte de análise e avalia que as taxas diretoras permanecerão suficientemente restritivas durante o tempo que for necessário, sem se comprometer previamente com uma trajetória específica para as taxas. Mais uma vez, a autoridade monetária apontou que seguirá com uma postura dependente dos dados.

Christine Lagarde, presidente do BCE, foi questionada de forma reiterada sobre um eventual corte na reunião de setembro/24. Em suas respostas, indicou que há dados para serem divulgados até lá e que o conselho decide reunião a reunião (meeting by meeting), ressaltando mais de uma vez que não há compromisso prévio com uma trajetória específica para os juros.

No Brasil, em julho, houve melhora generalizada nos dados de confiança e o índice de incerteza recuou 0,3% (M/M). Destaque positivo para a confiança da indústria (3,4%, M/M) e do consumidor (2,0%, M/M).

Em relação aos dados da atividade econômica, vale destacar a geração líquida de vagas formais (CAGED) de junho (201.705). No acumulado de janeiro a junho, os cinco grandes grupamentos de atividades econômicas registraram saldos positivos no ano, com destaque para o crescimento do emprego no setor de Serviços (716.909), que acumulou 55,14% do saldo total. A Indústria também apresentou saldo positivo de 242.314 no ano, com destaque para a Fabricação de Alcool (11.747) e a Fabricação de Embalagens de Material Plástico (7.786), seguida da Construção Civil (180.779), do Comércio (86.254) e da Agropecuária (73.809), setores que tiveram acréscimo de postos de trabalho no ano. O resultado marcou o sexto mês consecutivo com mais contratações do que demissões e fez o mercado de trabalho fechar o primeiro semestre com 1,3 milhão de novas vagas formais. No



mesmo período do ano passado, o saldo de contratações com carteira assinada ficou positivo em 1,0 milhão de postos.

Em maio, o Índice de Atividade Econômica do Banco Central (IBC-Br) avançou 0,2% (M/M), mesmo com as enchentes no estado do Rio Grande do Sul. Entre os setores da atividade econômica, destaque para o varejo restrito (1,2%, M/M) em maio, segmento que vem sendo beneficiado pelo aumento da massa salarial real (9,0% para 9,2%, A/A) e a melhora da confiança. Entre os vetores, destaque para itens mais ligados à renda, tais como (i) Vestuário (2,0%), se beneficiando de melhores preços, (ii) Outros artigos de uso pessoal e doméstico (1,6%) e (iii) Hiper mercados (0,7%).

Em relação ao campo monetário, houve a reunião do Comitê de Política Monetária (Copom), o principal evento do mês. Apesar das pressões inflacionárias e da desvalorização cambial, o comitê decidiu manter, por unanimidade, a taxa básica de juro (Selic) em 10,5% a.a. O comitê avaliou que a decisão de manter os juros é compatível com a estratégia de convergência da inflação para o redor da meta.

Entretanto, o comitê destacou que o cenário global está incerto e o cenário doméstico está sendo marcado por resiliência na atividade, elevação das projeções de inflação e expectativas “desancoradas” que “demandam acompanhamento diligente e ainda maior cautela”. Em relação aos próximos passos, não foi fornecido um guidance, com o Comitê apenas afirmando que “se manterá vigilante” e que “eventuais ajustes futuros na taxa de juros serão ditados pelo firme compromisso de convergência da inflação à meta”.

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 julho, acelerando em relação ao avanço de +0,21% (M/M) observado no mês anterior. Sendo que a variação foi superior à projeção de mercado de +0,31%. Com isso, o índice acumulou alta de +4,50% em 12 meses (ante +4,23% em junho).

Os itens que mais contribuíram para a variação vieram dos grupos Transportes (variação de +1,82% ante projeção de +1,54%) e Saúde e cuidados pessoais (+0,22% ante projeção de -0,14%). A maior contribuição para a variação do índice partiu do grupo Transportes influenciado pelo expressivo aumento dos itens de Transporte público.

Os preços administrados avançaram +1,08% em julho, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Gasolina (+3,15% ante +0,64% na leitura anterior).



Já os preços livres desaceleraram (de +0,16% para +0,14%) deixando de ser os principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres houve avanço de produtos industriais e de serviços +0,13% para +0,33% e +0,04% para +0,75% respectivamente, enquanto alimentos apresentaram recuo de +0,47% para -1,51%. Na margem, tivemos desaceleração da medida subjacente de industriais (de +0,13% para +0,11%), entretanto, o núcleo de serviços ganhou ritmo (de +0,36% para +0,63%). O índice de difusão passou de 52,25% em junho para 46,95% em julho.

O Ibovespa, principal índice da bolsa de valores brasileira, em julho, apresentou valorização de 3,02% em relação ao mês anterior, fechando aos 127.652 pontos. No ano, o índice acumula queda de 4,87%, se descolando das principais bolsas do mundo.

Neste contexto, a performance positiva no mês pode ser explicada, majoritariamente, pela expressiva entrada de recursos de investidores estrangeiros em função da expectativa de que o Fed deverá iniciar o ciclo de corte de juros nos Estados Unidos em setembro.

Além disso, o início da flexibilização monetária diminui a atratividade dos títulos públicos norte-americanos e, em contrapartida, aumenta o apetite dos investidores estrangeiros por ativos de maior risco, como ações, fazendo com que países emergentes, como o Brasil, sejam beneficiados por um maior ingresso de recursos vindo desses investidores.

Espera-se então 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.

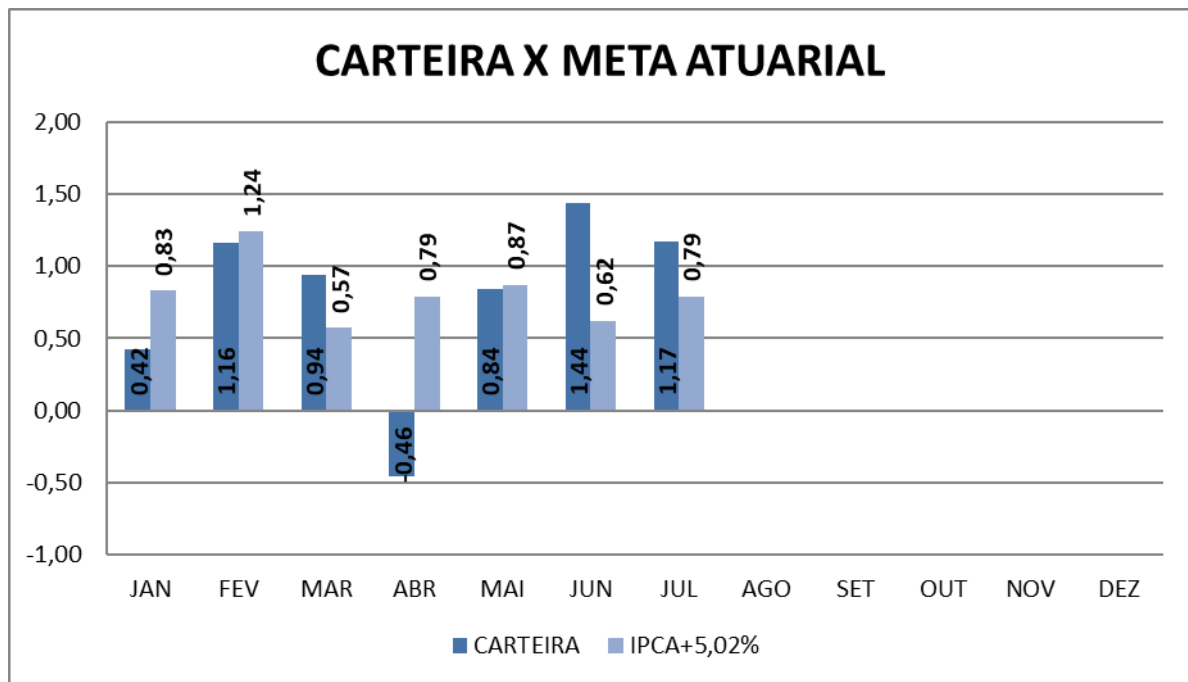
### 3. RESULTADO DA CARTEIRA

No mês de julho, nosso portfólio teve desempenho superior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com uma rentabilidade de 1,17%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 5,02%, foi de 0,79%.

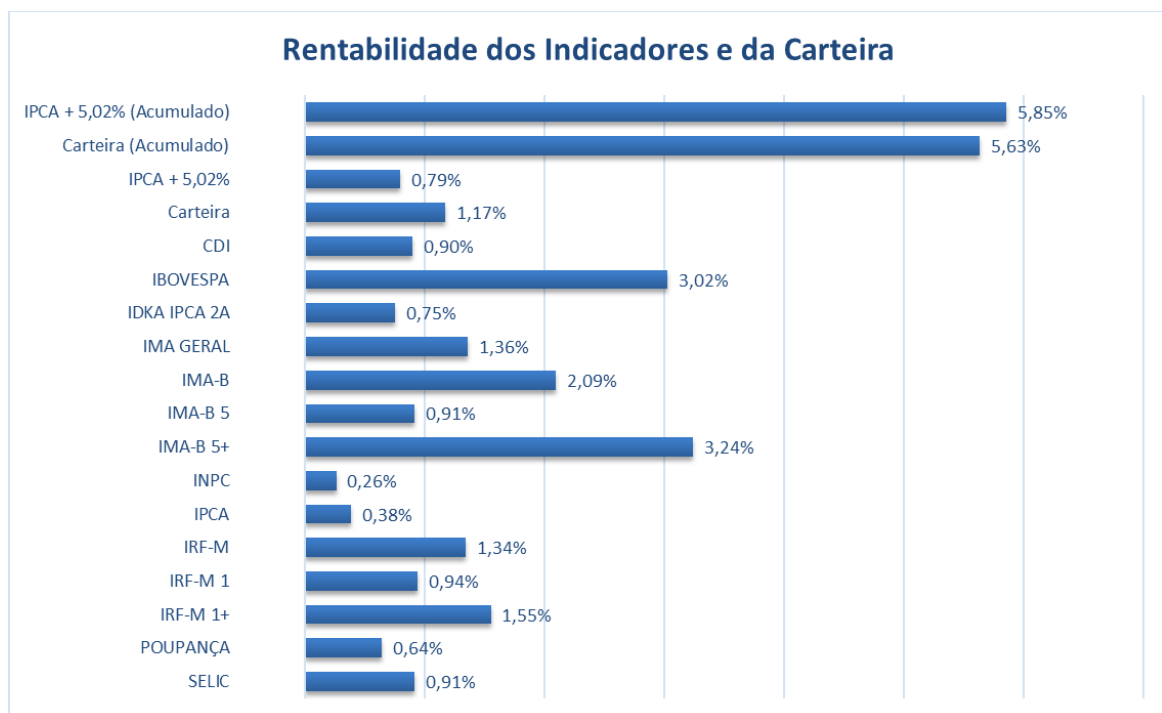
#### HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
<b>CARTEIRA</b>	<b>0,42</b>	<b>1,16</b>	<b>0,94</b>	<b>-0,46</b>	<b>0,84</b>	<b>1,44</b>	<b>1,17</b>						<b>5,63</b>
IPCA+5,02%	0,83	1,24	0,57	0,79	0,87	0,62	0,79						5,85





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





No mês de julho, observamos um comportamento positivo em nossos fundos de investimento. Os investimentos no exterior e bolsa doméstica foram os que mais contribuíram para nossa carteira. Dessa forma, as maiores altas na carteira foram do BB Multimercado Nordea IE com 5,12%, BB Ações Ibovespa Ativo com 4,25% e Caixa Expert Claritas Valor com 3,83%. Esse desempenho positivo deve-se, principalmente, à fala considerada dovish do presidente do Fed. 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 Campos Neto e de Galípolo, acenando que buscam formas de atingir o centro da meta de juros, geraram um certo alívio. Dessa forma, quase toda a carteira do Macaeprev fechou no campo positivo, com apenas dois fundos com rendimentos negativos: FIDC Multisetorial Itália com -1,05% e BB Multimercado Global Select Equity IE com -0,02%. Com isso, as forças vendedoras, devido ao contexto macroeconômico, reduziram a pressão nas cotações das nossas empresas.

Dessa forma, como expressado nos relatórios anteriores, 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 2,63%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno médio de 1,64%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno de 1,42%. Os fundos de investimento no exterior tiveram resultado médio de 2,50%.

Os fundos de vértice FI Caixa Brasil 2024 e BB Previdenciário RF TP XXI renderam 0,98%. As NTN-B 2024 renderam 0,85%, as NTN-B 2025 renderam 0,79%, as NTN-B 2026 renderam 0,80%, as NTN-B 2027 renderam 0,80%, as NTN-B 2028 renderam 0,80%, as NTN-B 2029 renderam 0,77%, as NTN-B 2035 renderam 0,76%, as NTN-B 2040 renderam 0,78%, as NTN-B 2045 renderam 0,78%, as NTN-B 2050 renderam 0,78%, as NTN-B 2055



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



renderam 0,78% e as NTN-B 2060 renderam 0,78%. Em média, as NTNs-B ficaram com 0,78%.

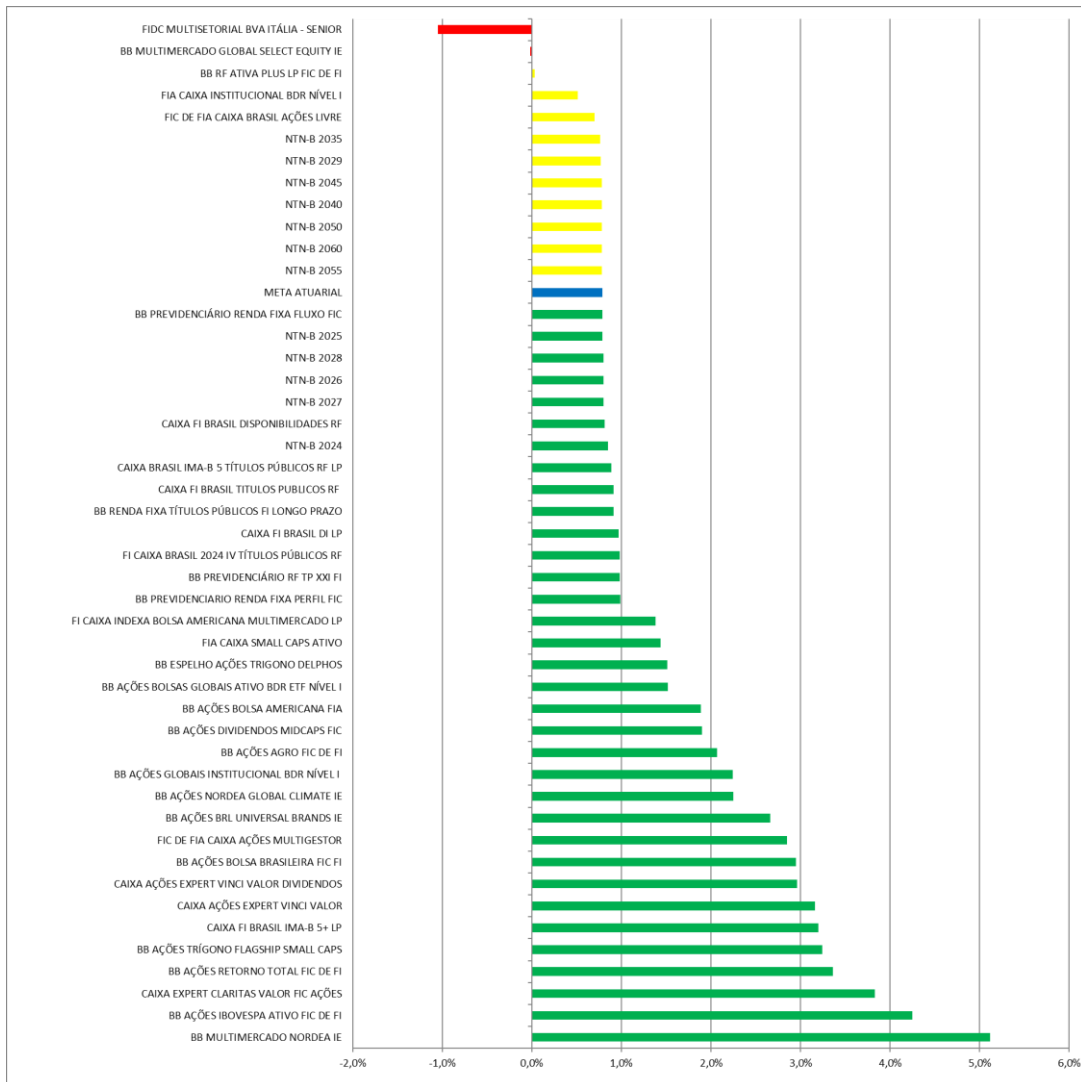
Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,95%. O fundo de renda fixa com gestão ativa rendeu 0,03%. O fundo IMA-B 5 teve um retorno de 0,89%. O fundo IMA-B 5+ teve retorno de 3,20%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade negativa de -1,05%. Até 31/07/2024 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 31 de julho estava em R\$ 2.119.105,84 (dois milhões e cento e dezenove mil e cento e cinco reais e oitenta e quatro 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 julho da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 51.906.106,77 (cinquenta e um milhões e novecentos e seis mil e cento e seis reais e setenta e sete centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de julho em R\$ 4.523.771.274,33 (quatro bilhões e quinhentos e vinte e três milhões e setecentos e setenta e um mil e duzentos e setenta e quatro reais e trinta e três centavos).



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



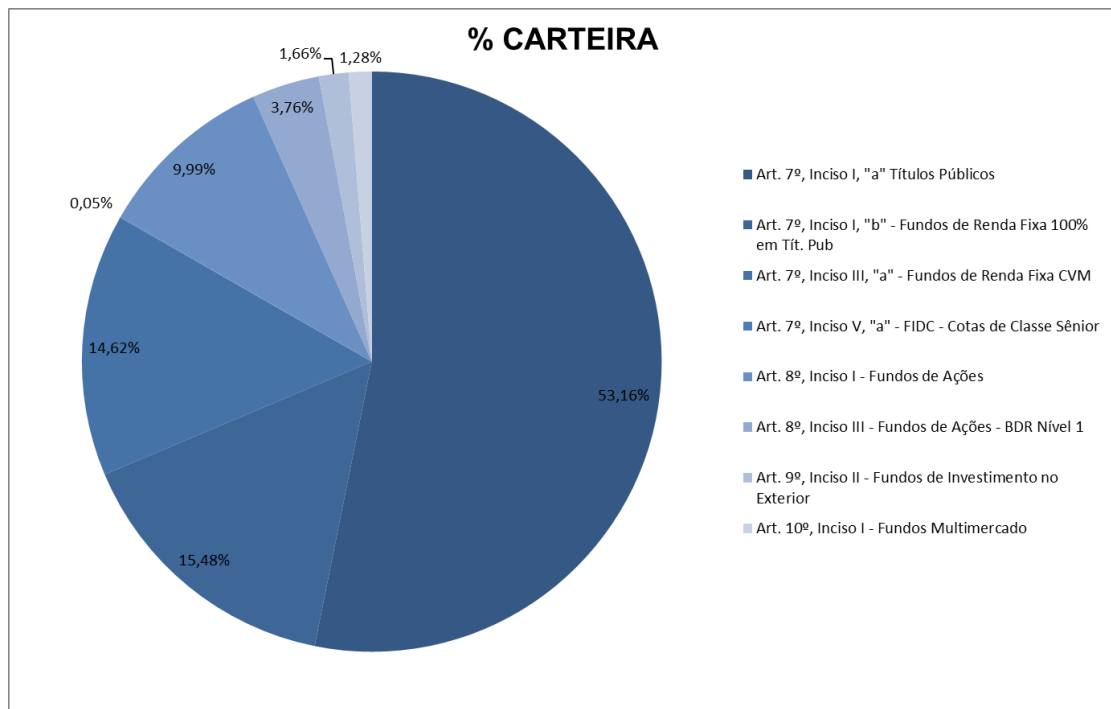
**SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS**

Fundo de Investimento	Saldo em 30/06/2024	Saldo em 31/07/2024	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$48.230.991,74	R\$0,00	-R\$48.962.710,36	R\$731.718,62	1,52%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$52.953.859,67	R\$0,00	-R\$53.955.500,50	R\$1.001.640,83	1,89%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$69.669.670,03	R\$0,00	-R\$71.227.220,75	R\$1.557.550,72	2,24%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$102,50	R\$103,33	R\$0,00	R\$0,83	0,81%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$42.061,84	R\$6.850,65	-R\$145.542,15	R\$110.330,96	0,79%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2024	R\$1.060.870,73	R\$1.069.984,12	R\$0,00	R\$9.113,39	0,85%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$2.141.614,47	R\$2.119.105,84	R\$0,00	-R\$22.508,63	-1,05%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	R\$2.112.798,41	R\$2.131.964,55	R\$0,00	R\$19.166,14	0,91%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$4.510.382,70	R\$4.682.966,49	R\$0,00	R\$172.583,79	3,83%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$6.403.669,35	R\$6.462.249,20	R\$0,00	R\$58.579,85	0,91%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	R\$19.049.301,95	R\$19.337.574,93	R\$0,00	R\$288.272,98	1,51%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	R\$18.788.876,02	R\$19.397.103,92	R\$0,00	R\$608.227,90	3,24%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$20.258.189,72	R\$21.118.631,35	R\$0,00	R\$860.441,63	4,25%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	R\$21.477.409,36	R\$22.048.572,66	R\$0,00	R\$571.163,30	2,66%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$44.020.481,93	R\$24.573.090,13	-R\$20.000.000,00	R\$552.608,20	2,07%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	R\$23.873.969,53	R\$24.628.095,90	R\$0,00	R\$754.126,37	3,16%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	R\$25.323.574,41	R\$25.892.096,65	R\$0,00	R\$568.522,24	2,25%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$30.074.637,39	R\$30.963.266,57	R\$0,00	R\$888.629,18	2,95%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	R\$44.875.464,09	R\$46.204.155,29	R\$0,00	R\$1.328.691,20	2,96%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$46.665.967,16	R\$48.235.450,18	R\$0,00	R\$1.569.483,02	3,36%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$49.206.187,76	R\$49.914.687,99	R\$0,00	R\$708.500,23	1,44%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$50.714.323,73	R\$52.157.276,14	R\$0,00	R\$1.442.952,41	2,85%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$52.310.587,90	R\$53.302.880,71	R\$0,00	R\$992.292,81	1,90%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$53.529.463,64	R\$56.269.336,81	R\$0,00	R\$2.739.873,17	5,12%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$57.136.344,41	R\$57.536.549,44	R\$0,00	R\$400.205,03	0,70%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$56.961.370,67	R\$57.746.894,71	R\$0,00	R\$785.524,04	1,38%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$66.015.372,28	R\$66.005.309,49	R\$0,00	-R\$10.062,79	-0,02%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$74.571.492,51	R\$74.950.310,80	R\$0,00	R\$378.818,29	0,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$80.511.538,21	R\$81.230.373,87	R\$0,00	R\$718.835,66	0,89%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2060	R\$89.221.389,60	R\$89.926.947,00	R\$0,00	R\$705.557,40	0,78%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2040	R\$102.337.936,48	R\$103.141.746,12	R\$0,00	R\$803.809,64	0,78%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$117.561.893,32	R\$118.704.841,89	R\$0,00	R\$1.142.948,57	0,97%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	R\$140.798.982,65	R\$145.301.379,46	R\$0,00	R\$4.502.396,81	3,20%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2035	R\$0,00	R\$151.155.823,73	R\$149.996.238,76	R\$1.159.584,97	0,76%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2029	R\$0,00	R\$151.164.553,20	R\$149.998.497,74	R\$1.166.055,46	0,77%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2028	R\$153.194.372,51	R\$154.442.375,98	R\$0,00	R\$1.248.003,47	0,80%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2055	R\$187.104.221,28	R\$188.583.064,66	R\$0,00	R\$1.478.843,38	0,78%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	R\$224.052.911,32	R\$199.115.001,02	-R\$25.000.000,00	R\$62.089,70	0,03%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2026	R\$206.513.329,04	R\$208.183.744,23	R\$0,00	R\$1.670.415,19	0,80%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$217.148.956,06	R\$219.266.387,48	R\$0,00	R\$2.117.431,42	0,98%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$243.685.097,73	R\$246.061.620,61	R\$0,00	R\$2.376.522,88	0,98%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2045	R\$270.098.364,07	R\$272.226.630,66	R\$0,00	R\$2.128.266,59	0,78%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2050	R\$296.073.678,86	R\$298.412.320,90	R\$0,00	R\$2.338.642,04	0,78%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$418.779.757,80	R\$343.743.959,60	-R\$77.959.771,33	R\$2.923.973,13	0,99%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2027	R\$349.174.118,74	R\$352.019.377,75	R\$0,00	R\$2.845.259,01	0,80%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2025	R\$430.885.592,58	R\$434.336.618,32	R\$0,00	R\$3.451.025,74	0,79%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$4.469.121.176,15</b>	<b>R\$4.523.771.274,33</b>	<b>R\$2.743.991,41</b>	<b>R\$51.906.106,77</b>	<b>1,17%</b>

#### 4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

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

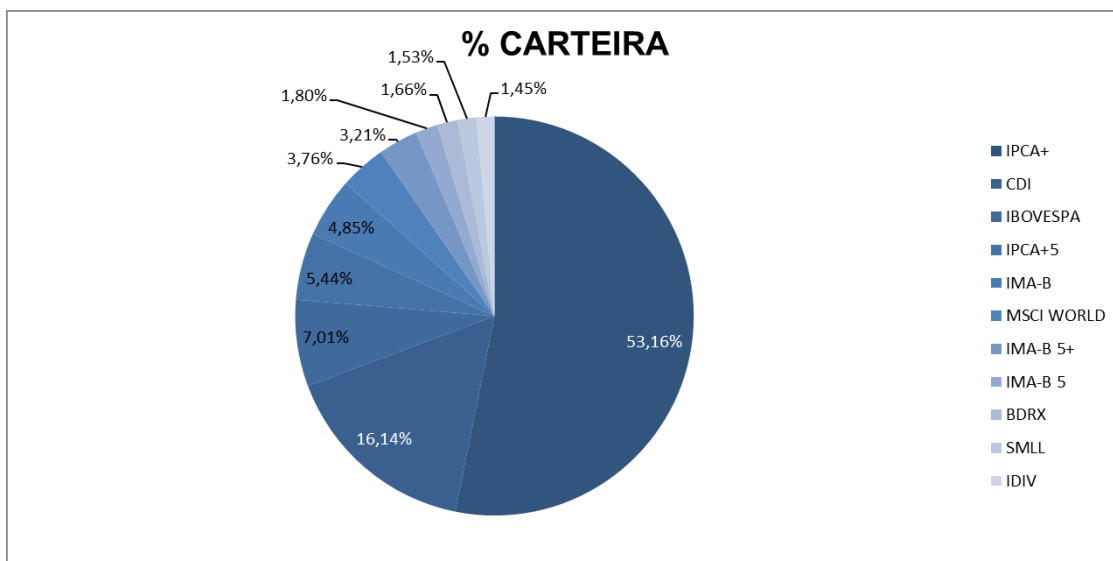
<b>ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024</b>								
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total	
<b>Art. 7º, Inciso I, "a" Títulos Públicos</b>		<b>53,16%</b>	<b>100,00%</b> ✓	<b>50,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>Não se Aplica</b>	<b>R\$2.404.663.186,67</b>	
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	IPCA+	53,16%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	NA	R\$2.404.663.186,67	
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub</b>		<b>15,48%</b>	<b>100,00%</b> ✓	<b>50,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>R\$700.453.975,17</b>	
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	CDI	0,05%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,01% ✓	R\$2.131.964,55	
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	0,14%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,06% ✓	R\$6.462.249,20	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	1,80%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,12% ✓	R\$81.230.373,87	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	4,85%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	5,38% ✓	R\$219.266.387,48	
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	IMA-B 5+	3,21%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	12,45% ✓	R\$145.301.379,46	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	5,44%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	6,59% ✓	R\$246.061.620,61	
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>14,62%</b>	<b>65,00%</b> ✓	<b>65,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$661.570.756,49</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	7,60%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	2,00% ✓	R\$343.743.959,60	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$6.850,65	
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	CDI	4,40%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	4,27% ✓	R\$199.115.001,02	
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	2,62%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,73% ✓	R\$118.704.841,89	
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$103,33	
<b>Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior</b>		<b>0,05%</b>	<b>5,00%</b> ✓	<b>0,20%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>5,00%</b> ✓	<b>R\$2.119.105,84</b>	
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,05%	5,00% ✓	0,20% ✓	20,00% ✓	3,64% ✓	R\$2.119.105,84	
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>9,99%</b>	<b>35,00%</b> ✓	<b>25,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$452.051.729,04</b>	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,47%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	14,67% ✓	R\$21.118.631,35	
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,68%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	15,16% X	R\$30.963.266,57	
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,54%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	11,15% ✓	R\$24.573.090,13	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,07%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	6,78% ✓	R\$48.235.450,18	
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	1,18%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	6,89% ✓	R\$53.302.880,71	
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	IDIV	0,43%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	10,27% ✓	R\$19.337.574,93	
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	SMLL	0,43%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	36,02% ✓	R\$19.397.103,92	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	IBOVESPA	0,54%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	3,19% ✓	R\$24.628.095,90	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	IDIV	1,02%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	4,44% ✓	R\$46.204.155,29	
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,10%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	16,72% ✓	R\$4.682.966,49	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,10%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	8,23% ✓	R\$49.914.687,99	
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,15%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	9,48% ✓	R\$52.157.276,14	
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,27%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	8,67% ✓	R\$57.536.549,44	
<b>Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>1,66%</b>	<b>10,00%</b> ✓	<b>10,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$74.950.310,80</b>	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,66%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	2,76% ✓	R\$74.950.310,80	
<b>Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior</b>		<b>3,76%</b>	<b>10,00%</b> ✓	<b>10,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$170.215.315,61</b>	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	1,46%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	4,14% ✓	R\$66.005.309,49	
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	MSCI WORLD	0,57%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	7,53% ✓	R\$25.892.096,65	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	MSCI WORLD	0,49%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	11,13% ✓	R\$22.048.572,66	
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	1,24%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	41,48% ✓	R\$56.269.336,81	
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>1,28%</b>	<b>10,00%</b> ✓	<b>10,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$57.746.894,71</b>	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,28%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	3,00% ✓	R\$57.746.894,71	
<b>Total:</b>							<b>R\$4.523.771.274,33</b>	



#### 4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

##### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

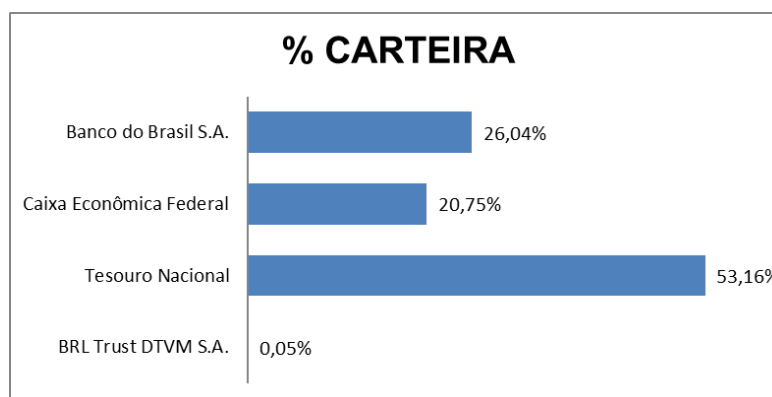
Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IPCA+	R\$2.404.663.186,67	53,16%
CDI	R\$730.030.970,79	16,14%
IBOVESPA	R\$317.198.206,91	7,01%
IPCA+5	R\$246.061.620,61	5,44%
IMA-B	R\$219.266.387,48	4,85%
MSCI WORLD	R\$170.215.315,61	3,76%
IMA-B 5+	R\$145.301.379,46	3,21%
IMA-B 5	R\$81.230.373,87	1,80%
BDRX	R\$74.950.310,80	1,66%
SMLL	R\$69.311.791,91	1,53%
IDIV	R\$65.541.730,22	1,45%
<b>Total</b>	<b>R\$4.523.771.274,33</b>	<b>100,00%</b>



#### 4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

#### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$2.119.105,84	0,05%
Tesouro Nacional	R\$2.404.663.186,67	53,16%
Caixa Econômica Federal	R\$938.786.271,99	20,75%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.178.202.709,83	26,04%





## 5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

### MOVIMENTAÇÕES

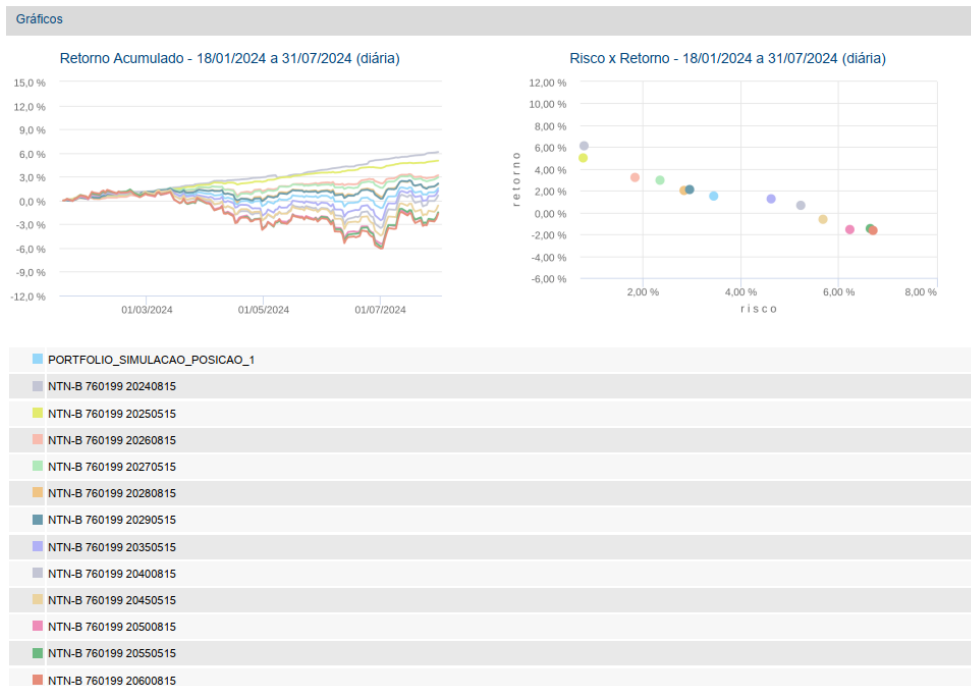
APLICAÇÕES			RESGATES		
Data	Valor		Data	Valor	Ativo
01/07/2024	R\$2.805,18	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	02/07/2024	R\$300.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
02/07/2024	R\$300.005.009,99	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	03/07/2024	R\$299.985.918,25	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
03/07/2024	R\$149.996.238,76	NTN-B 2035	04/07/2024	R\$20.000.000,00	BB AÇÕES AGRO FIC DE FI
03/07/2024	R\$149.998.497,74	NTN-B 2029	04/07/2024	R\$48.962.710,36	BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FI BDR
05/07/2024	R\$25.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	04/07/2024	R\$670.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
05/07/2024	R\$150.086,22	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	04/07/2024	R\$8.540,08	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
08/07/2024	R\$69.270.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	05/07/2024	R\$25.000.000,00	BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI
09/07/2024	R\$54.217.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	05/07/2024	R\$53.955.500,50	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES
10/07/2024	R\$71.227.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	05/07/2024	R\$71.227.220,75	BB AÇÕES ESG IS FI EM AÇÕES BDR
10/07/2024	R\$832,63	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	08/07/2024	R\$50.094,81	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
11/07/2024	R\$3.419,91	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	09/07/2024	R\$258.132,03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/07/2024	R\$4.595.711,60	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	12/07/2024	R\$20.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
17/07/2024	R\$4.440.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	12/07/2024	R\$2.780,38	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
18/07/2024	R\$29.462,20	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	17/07/2024	R\$4.432.340,72	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
22/07/2024	R\$11.279,96	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	19/07/2024	R\$135.464,58	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
23/07/2024	R\$1.392,80	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	24/07/2024	R\$9.780.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
24/07/2024	R\$781,55	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	30/07/2024	R\$4.417.771,33	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
25/07/2024	R\$8.294.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	31/07/2024	R\$1.157.546,82	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
25/07/2024	R\$1.033.089,58	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
26/07/2024	R\$50.422,81	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
29/07/2024	R\$702,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
30/07/2024	R\$278,79	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
31/07/2024	R\$4.480.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL			

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$842.808.012,02
Resgates	-R\$840.064.020,61
Saldo	R\$2.743.991,41

## 6. MONITORAMENTO DE RISCOS

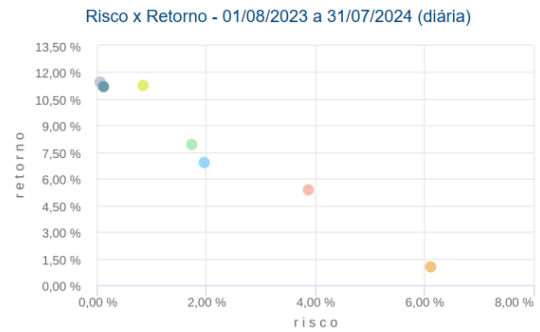
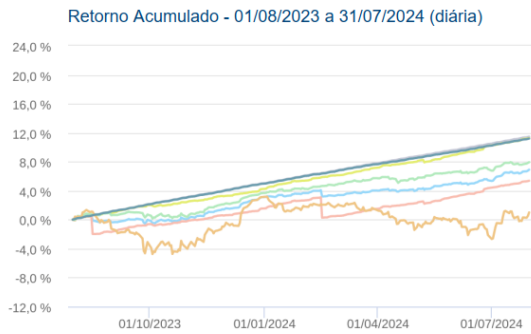
### 6.1. ART. 7º, INCISO I, "A" – TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOUREIRO NACIONAL





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

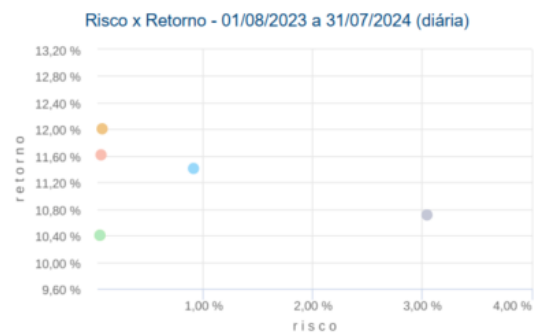
### Gráficos



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

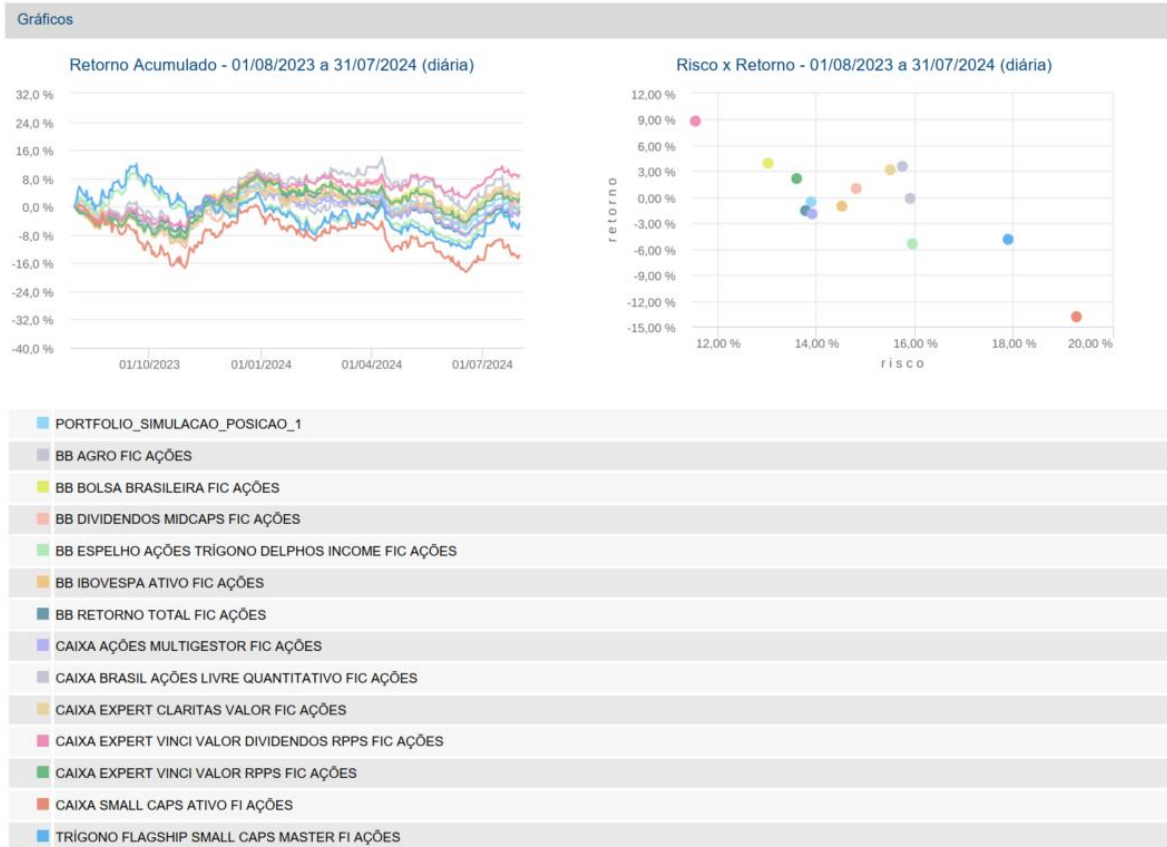
### Gráficos



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

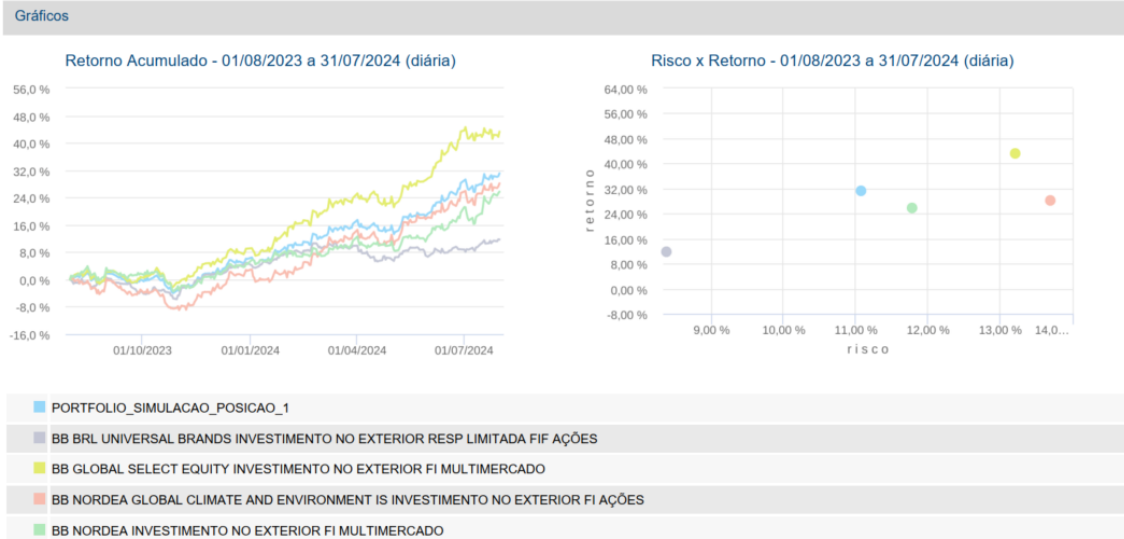


#### 6.5. ART. 8º, INCISO III – FUNDOS DE AÇÕES – BDR NÍVEL I





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



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





## 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	0,90%	6,17%	2,55%	5,15%	11,50%	26,65%	
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,90%	6,15%	2,53%	5,13%	11,45%	26,55%	0,03%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,91%	5,96%	2,50%	4,96%	11,19%	26,25%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,97%	6,26%	2,61%	5,24%	11,60%	26,75%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	0,81%	5,56%	2,29%	4,64%	10,40%	24,17%	0,03%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	0,06%	7,54%	2,17%	6,02%	10,70%	23,22%	0,32%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,97%	6,38%	2,65%	5,33%	12,00%	27,35%	0,03%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,81%	5,55%	2,28%	4,63%	10,40%	23,40%	0,03%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	-1,05%	-2,41%	0,08%	-3,11%	200,72%	165,32%	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	1,37%	18,30%	10,67%	16,34%	26,54%	52,86%	1,39%
IMA-B 5	0,91%	4,26%	2,37%	3,56%	8,16%	20,37%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	0,89%	4,12%	2,31%	3,44%	7,90%	19,88%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,89%	4,13%	2,31%	3,44%	7,93%	20,02%	0,11%
IMA-B	2,09%	0,97%	2,45%	1,42%	4,38%	20,51%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	2,07%	0,82%	2,37%	1,29%	4,17%	20,10%	0,32%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,97%	3,78%	3,05%	2,65%	5,36%	9,12%	0,01%
IMA-B 5+	3,23%	-1,96%	-2,52%	-0,50%	1,02%	20,59%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	3,19%	-2,17%	2,45%	-0,67%	0,71%	19,74%	0,54%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	3,19%	-2,04%	2,45%	-0,59%	0,99%	20,02%	0,53%
IPCA + 5%	0,83%	5,84%	2,27%	4,99%	9,73%	19,73%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,97%	6,75%	3,05%	5,58%	11,25%	22,27%	0,01%
IBOVESPA	3,02%	-4,86%	0,41%	0,64%	5,28%	24,87%	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	4,24%	-8,25%	0,69%	-3,01%	-1,07%	15,41%	0,98%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	2,95%	-5,26%	1,18%	-0,44%	3,96%	22,11%	0,93%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	0,02%	-5,63%	1,79%	-0,49%	-0,10%	7,80%	1,53%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	3,36%	-9,70%	1,34%	-4,77%	-1,56%	4,68%	0,91%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	1,89%	-4,06%	0,14%	-2,36%	1,05%	25,88%	1,40%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	3,15%	-5,93%	0,59%	-1,88%	2,09%	15,93%	0,92%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	3,82%	-2,02%	1,90%	1,22%	3,17%	17,37%	1,20%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	2,84%	-6,80%	1,03%	-2,77%	-1,94%	10,97%	1,13%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	0,70%	-6,20%	-1,74%	-3,57%	-3,57%	22,45%	1,59%
IDIV	1,89%	-1,57%	0,99%	1,47%	11,45%	32,35%	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	2,96%	-0,53%	3,22%	2,62%	8,78%	27,49%	0,87%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	1,51%	-9,08%	0,29%	-2,57%	-5,51%	0,00%	1,70%
SMLL	1,49%	-13,56%	-3,96%	-7,38%	-13,30%	1,65%	
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	3,23%	-8,27%	1,85%	-0,77%			1,62%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1,44%	-13,89%	-2,41%	-7,81%	-13,85%	0,43%	1,76%
BDRX	0,29%	41,47%	21,39%	35,02%	51,99%	65,02%	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,50%	40,22%	20,98%	34,10%	49,77%	60,78%	2,20%
MSCI WORLD	1,70%	12,70%	7,52%	10,34%	16,80%	33,51%	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	-0,02%	31,44%	15,31%	26,16%	43,29%	53,47%	1,51%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	2,24%	24,94%	13,31%	25,88%	28,13%	24,36%	1,48%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	2,65%	6,50%	5,46%	3,65%	11,69%	28,46%	0,61%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	5,11%	20,35%	13,14%	16,59%	25,70%	22,39%	1,48%
MSCI ACWI	1,51%	11,99%	7,05%	10,37%	15,40%	30,75%	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	1,03%	12,55%	7,86%	11,73%	15,86%	30,62%	1,38%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,39%	15,25%	9,02%	11,90%	20,12%	35,61%	
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,49%	29,53%	16,07%	24,15%	38,62%	45,09%	2,24%
S&P 500	1,13%	15,78%	9,05%	12,13%	20,52%	37,25%	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1,45%	17,93%	10,76%	15,99%	25,13%	45,13%	1,38%



## 8. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

### 8.1. RENTABILIDADE

A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 1,01% no mês de julho, totalizando um saldo de R\$ 243.845.812,54 (duzentos e quarenta e três milhões e oitocentos e quarenta e cinco mil e oitocentos e doze reais e cinquenta e quatro centavos).

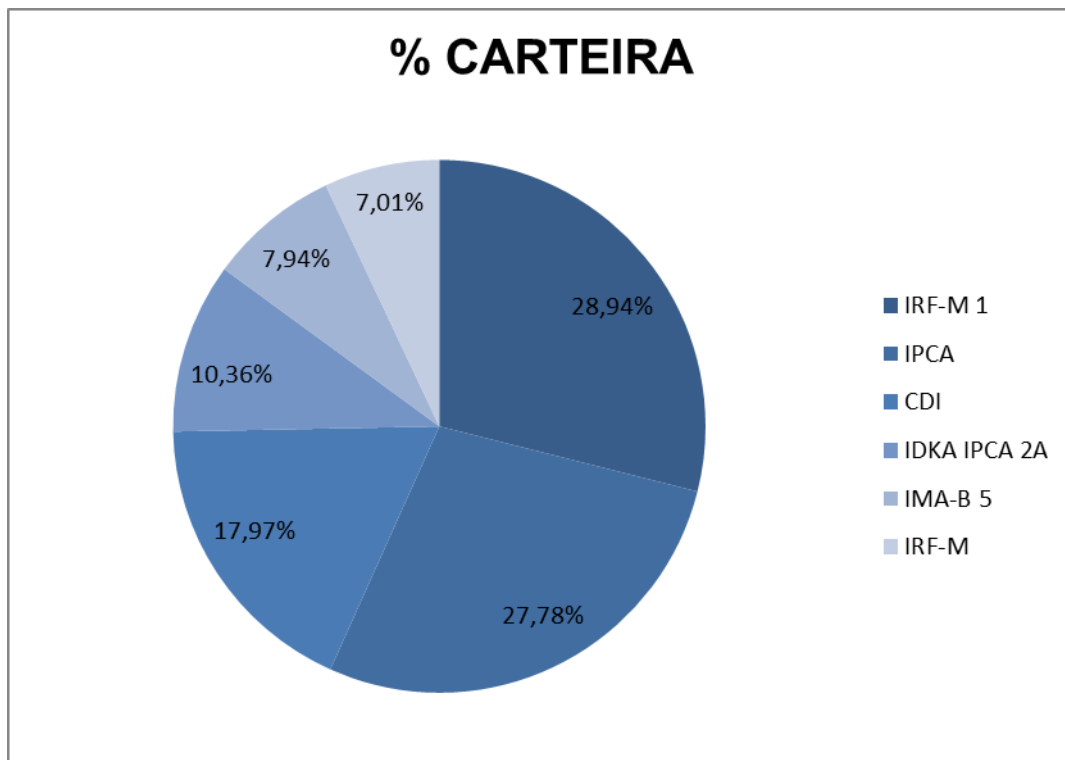
### 8.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

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
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub</b>		<b>54,25%</b>	<b>100,00%</b>	✓	<b>50,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>R\$132.291.007,04</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	IRF-M 1	28,84%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,86%	✓	R\$70.333.707,67
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	0,09%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,00%	✓	R\$227.670,93
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2A	10,36%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,47%	✓	R\$25.257.976,66
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	7,94%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,39%	✓	R\$19.368.234,89
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	IRF-M	7,01%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,46%	✓	R\$17.103.416,89
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>33,64%</b>	<b>65,00%</b>	✓	<b>65,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$82.036.026,28</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COT	CDI	5,71%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,08%	✓	R\$13.926.815,50
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	CDI	0,15%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,01%	✓	R\$375.531,58
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,00%	✓	R\$1.476,60
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	27,78%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	1,04%	✓	R\$67.732.202,60
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>12,11%</b>	<b>10,00%</b>	✓	<b>10,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$29.518.779,22</b>
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,11%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	2,34%	✓	R\$29.518.779,22
<b>Total:</b>											<b>R\$243.845.812,54</b>

### 8.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

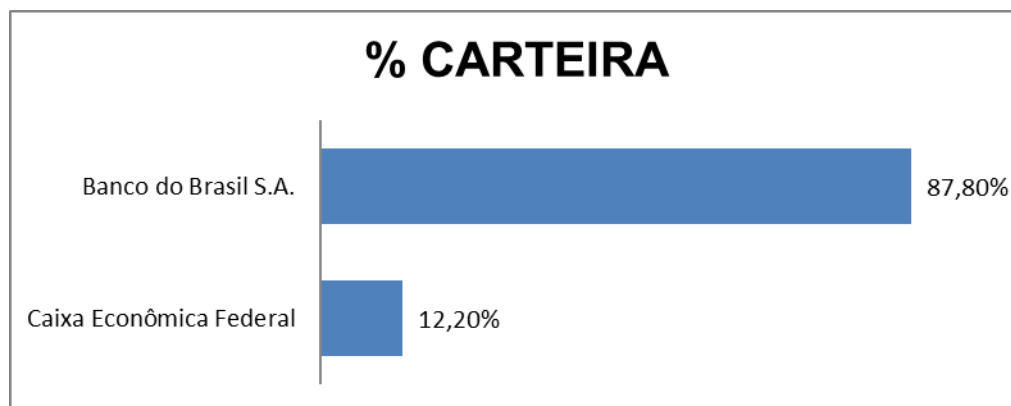
Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IRF-M 1	R\$70.561.378,60	28,94%
IPCA	R\$67.732.202,60	27,78%
CDI	R\$43.822.602,90	17,97%
IDKA IPCA 2A	R\$25.257.976,66	10,36%
IMA-B 5	R\$19.368.234,89	7,94%
IRF-M	R\$17.103.416,89	7,01%
	<b>R\$243.845.812,54</b>	<b>100,00%</b>



#### 8.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$29.747.926,75	12,20%
Banco do Brasil S.A.	R\$214.097.885,79	87,80%





## 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 0,93% e fechou o mês com o saldo de R\$ 29.270.376,04 (vinte e nove milhões e duzentos e setenta mil e trezentos e setenta e seis reais 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	
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub</b>		<b>58,82%</b>	<b>100,00%</b>	✓	<b>50,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>R\$17.218.132,20</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	6,54%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,02%	✓	R\$1.913.355,92
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	6,70%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,02%	✓	R\$1.962.061,36
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	15,27%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,10%	✓	R\$4.470.117,29
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	15,35%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.494.173,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	14,96%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.378.424,60
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>15,55%</b>	<b>65,00%</b>	✓	<b>65,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$4.550.299,83</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,55%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,07%	✓	R\$4.550.299,83
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>6,73%</b>	<b>35,00%</b>	✓	<b>25,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$1.971.347,88</b>
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	IBOVESPA	1,54%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$451.119,93
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,14%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$334.247,93
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,72%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,08%	✓	R\$503.901,98
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,33%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,07%	✓	R\$389.077,99
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,00%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$293.000,05
<b>Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>10,79%</b>	<b>10,00%</b>	✓	<b>10,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$3.159.215,76</b>
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	5,20%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,10%	✓	R\$1.523.284,95
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	5,59%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$1.635.930,81
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>8,10%</b>	<b>10,00%</b>	✓	<b>10,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$2.371.380,37</b>
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	2,54%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,71%	✓	R\$742.729,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,49%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,36%	✓	R\$728.955,37
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	3,07%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$899.695,47
<b>Total:</b>										<b>R\$29.270.376,04</b>	

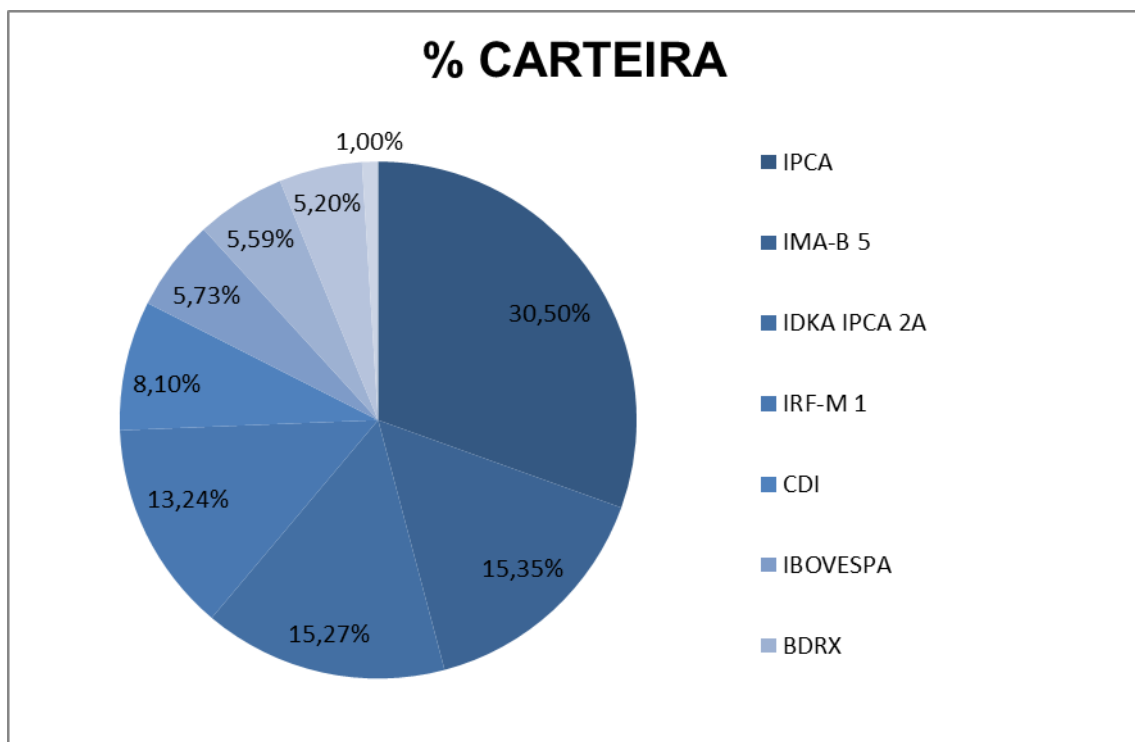




### 9.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IPCA	R\$8.928.724,43	30,50%
IMA-B 5	R\$4.494.173,03	15,35%
IDKA IPCA 2A	R\$4.470.117,29	15,27%
IRF-M 1	R\$3.875.417,28	13,24%
CDI	R\$2.371.380,37	8,10%
IBOVESPA	R\$1.678.347,83	5,73%
BDRX	R\$1.635.930,81	5,59%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.523.284,95	5,20%
SMLL	R\$293.000,05	1,00%
	<b>R\$29.270.376,04</b>	<b>100,00%</b>

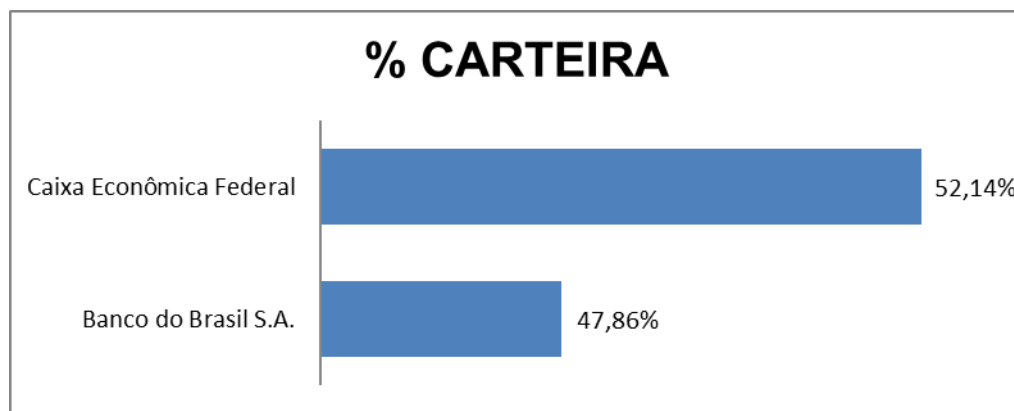




#### 9.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$14.009.211,12	47,86%
Caixa Econômica Federal	R\$15.261.164,92	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 0,98% e fechou o mês com o saldo de R\$ 20.954.327,21 (vinte milhões e novecentos e cinquenta e quatro mil e trezentos e vinte e sete reais e vinte e um centavos).

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

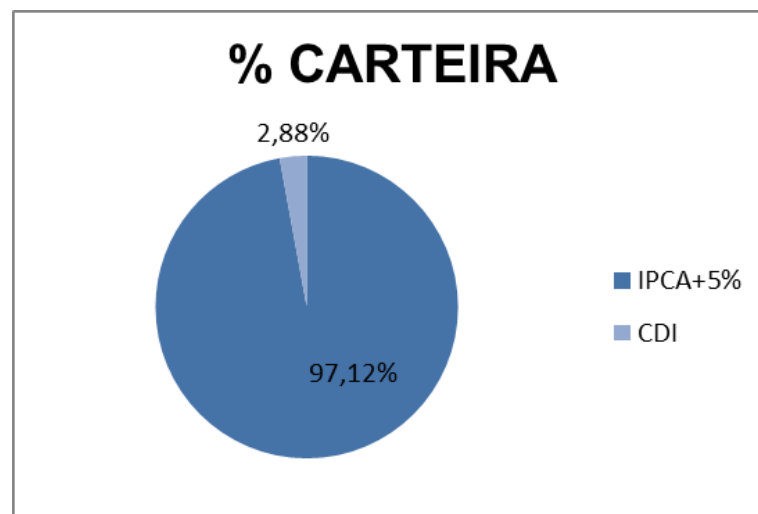
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024									
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total		
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		97,12%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$20.350.538,66		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA + 5%	97,12%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,57%	R\$20.350.538,66		
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00%	R\$603.788,55		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00%	R\$603.788,55		
<b>Total:</b>							<b>R\$20.954.327,21</b>		



### 10.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

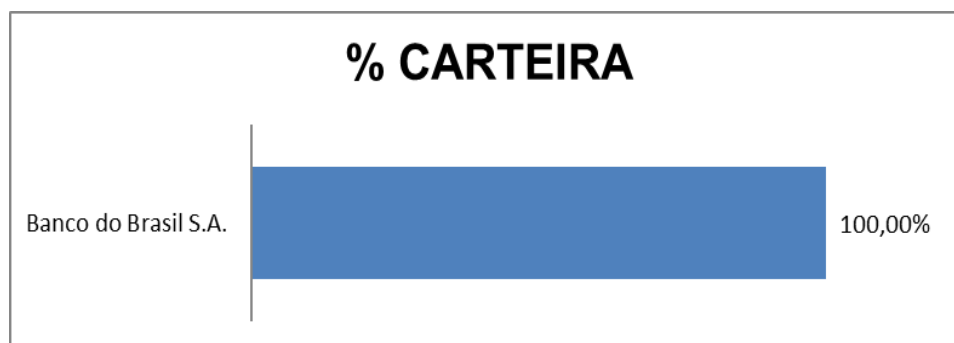
Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IPCA+5%	R\$20.350.538,66	97,12%
CDI	R\$603.788,55	2,88%
	<b>R\$20.954.327,21</b>	<b>100,00%</b>



### 10.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

#### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$20.954.327,21	100,00%





## 11. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023

### 11.1. RENTABILIDADE

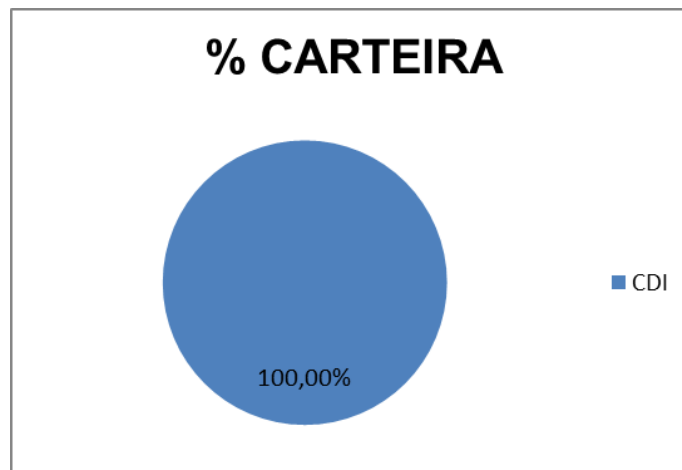
A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um resultado de 0,98% e fechou o mês com o saldo de R\$ 35.681.660,59 (trinta e cinco milhões e seiscentos e oitenta e um mil e seiscentos e sessenta reais e cinquenta e nove centavos).

### 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\$35.681.660,59		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA+5%	100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,01% ✓	R\$35.681.660,59		
<b>Total:</b>							<b>R\$35.681.660,59</b>		

### 11.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

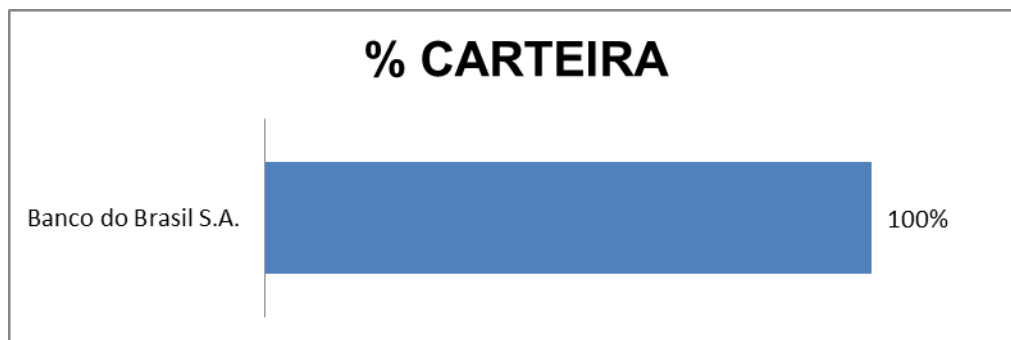
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IPCA+5%	R\$35.681.660,59	100,00%
	<b>R\$35.681.660,59</b>	<b>100,00%</b>





#### 11.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

<b>DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA</b>		
<b>Instituição Financeira</b>	<b>Saldo</b>	<b>Participação</b>
Banco do Brasil S.A.	R\$35.681.660,59	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 0,97% e fechou o mês com o saldo de R\$ 41.333.362,81 (quarenta e um milhões e trezentos e trinta e três mil e trezentos e sessenta e dois reais e oitenta e um centavos).

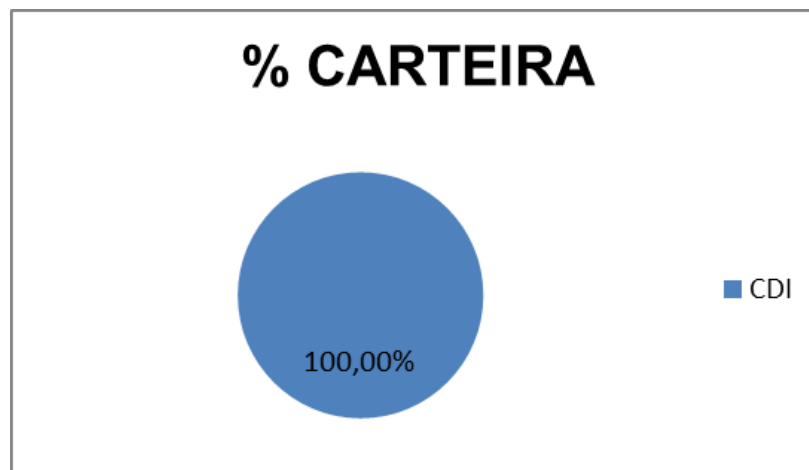
### 12.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

<b>ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024</b>											
<b>Artigo/Fundo</b>	<b>Indicador</b>	<b>% Carteira</b>	<b>% Limite Resolução</b>		<b>% Limite PAI 2024</b>		<b>% Limite dos Recursos do RPPS</b>		<b>% Participação no PL do Fundo</b>		<b>Total</b>
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		100,00%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$41.333.362,81
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	100,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,24%	✓	R\$41.333.362,81
<b>Total: R\$41.333.362,81</b>											



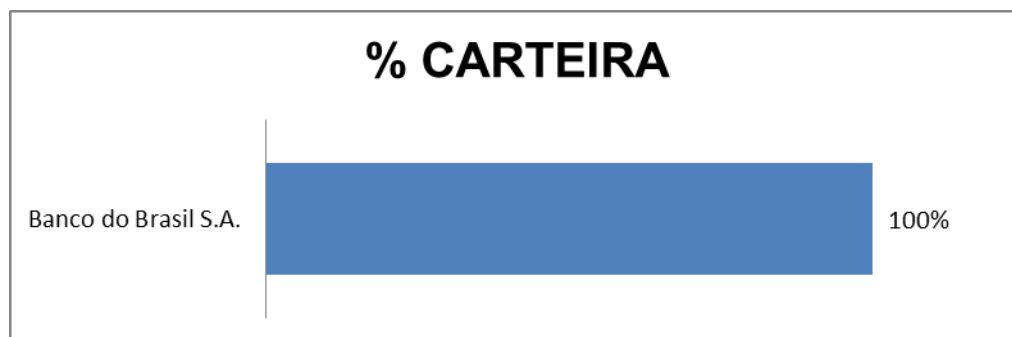
### 12.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
CDI	R\$41.333.362,81	100,00%
	<b>R\$41.333.362,81</b>	<b>100,00%</b>



### 12.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$41.333.362,81	100%





### 13. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES

#### 13.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

<b>CUSTOS DOS FUNDOS</b>		
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

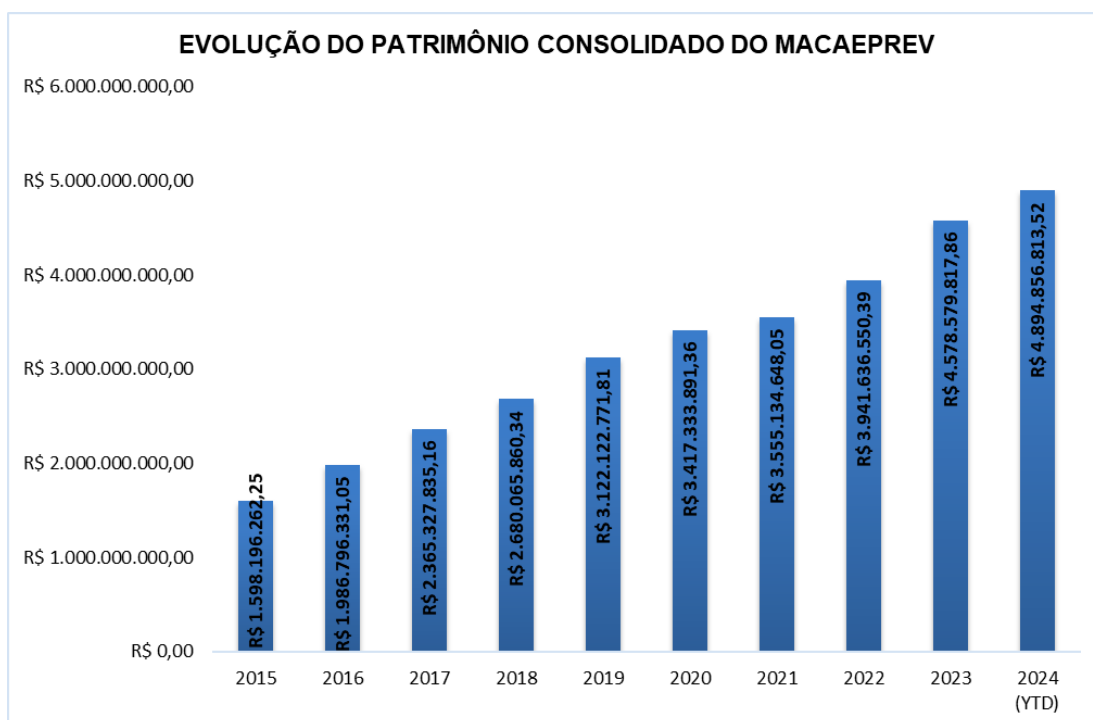
<b>CUSTOS SELIC</b>		
<b>Ativos</b>	<b>Patrimônio (R\$)</b>	<b>SELIC</b>
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	R\$ 2.404.663.186,67	R\$ 5.736,99





## 14. CONCLUSÃO

O Macaeprev encerrou o mês de julho de 2024 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 4.894.856.813,52 (quatro bilhões e oitocentos e noventa e quatro milhões e oitocentos e cinquenta e seis mil e oitocentos e treze reais e cinquenta e dois centavos). O gráfico a seguir apresenta a evolução patrimonial do Macaeprev a cada final de exercício.



Macaé, 28 de agosto 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 agosto 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 **julho** de 2024;

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

Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de **julho 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 **JULHO 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 Guimarães

  
Patrícia Alves de Vasconcelos

  
Claudio de Freitas Duarte

  
Fábio de Carvalho de Moraes Drumond

  
Miriam Amaral Queiroz

  
Viviane da Silva Lourenço Campos