

# RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



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



**AGOSTO - 2023**



## SUMÁRIO

<b>1. INTRODUÇÃO.....</b>	<b>3</b>
<b>2. CENÁRIO ECONÔMICO.....</b>	<b>3</b>
<b>3. RESULTADO DA CARTEIRA.....</b>	<b>9</b>
<b>4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA.....</b>	<b>14</b>
4.1. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023.....	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 TESOUREIRO 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. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO.....</b>	<b>21</b>
7.1. RENTABILIDADE.....	21
7.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023.....	21
7.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA.....	22
7.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA.....	22
<b>8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021.....</b>	<b>23</b>
8.1. RENTABILIDADE.....	23
8.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023.....	24
8.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA.....	24
8.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA.....	25
<b>9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022.....</b>	<b>26</b>
9.1. RENTABILIDADE.....	26
9.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023.....	26
9.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA.....	26
9.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA.....	27
<b>10. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023.....</b>	<b>27</b>
10.1. RENTABILIDADE.....	27
10.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023.....	28
10.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA.....	28
10.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA.....	29
<b>11. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES.....</b>	<b>30</b>
11.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS.....	30
<b>12. CONCLUSÃO.....</b>	<b>31</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 agosto de 2023.

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 agosto, o rumo da política monetária e indícios da desaceleração das economias mundiais permaneceram no centro das discussões. A expectativa do mercado é de que o ciclo de alta de juros tenha terminado. A lógica é a seguinte: quanto menos empregos, menor a pressão inflacionária dos salários e, portanto, menor a chance de novas altas de juros para conter os preços. A guerra da Ucrânia completa 17 meses e não há perspectiva de avanço nas negociações diplomáticas.

No início de agosto, a economia dos EUA apresentou uma surpresa. O país norte americano perdeu sua nota máxima de crédito para longo prazo segundo a agência de rating Fitch. A notícia é histórica, mas na prática teve impacto pequeno no mercado. A Fitch rebaixou a classificação de dívida soberana de longo prazo dos EUA de AAA para AA+. A agência citou uma deterioração fiscal esperada para os próximos três anos, com os impasses políticos consecutivos em relação ao teto da dívida. A maioria dos economistas e autoridades americanas ouvidas a respeito entenderam a reclassificação como pouco crível. Este foi o primeiro rebaixamento para os EUA desde 2011, quando a S&P colocou a nota americana em AA+.

Por um lado, os dados de atividade econômica nos EUA mostram um quadro mais firme do que boa parte do mercado esperava. O setor de serviços continua indicando expansão, ainda que em menor ritmo do que em 2022. As vendas no varejo de julho avançaram 0,7% (M/M) em termos nominais e a produção industrial acelerou, com variação de 1,0% (M/M).



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



Em agosto, também tivemos a divulgação da ata da última reunião do Comitê Federal de Mercado Aberto (FOMC, sigla em inglês), na qual foram elevados os juros básicos da economia para o intervalo entre 5,25% e 5,50%. No documento, os dirigentes alteraram marginalmente a sua avaliação geral, indicando que a atividade econômica se expandiu em ritmo moderado; que os ganhos de empregos seguem robustos; que a taxa de desemprego permaneceu baixa; que a inflação se manteve elevada e que os efeitos do aperto recente nas condições de crédito permanecem incertos.

No mercado de trabalho, o relatório oficial de emprego dos EUA, Payroll, mostra que em agosto foram criados 187 mil vagas de trabalho fora do setor agrícola, dado que veio acima do consenso do mercado, que projetava a criação de 170 mil vagas no mês. Ainda assim, a taxa de desemprego subiu de 3,5% para 3,8% em agosto. A previsão do mercado financeiro era de que permanecesse em 3,5%. O número veio em linha com o esperado pelo mercado financeiro, mas ainda representa um mercado de trabalho forte, estando em patamar historicamente baixo.

Sobre a inflação, o Índice de Preços ao Consumidor (CPI) manteve o ritmo de crescimento em julho, com relação a junho, ao registrar +0,2% (M/M). Com isso, o índice acumulado em 12 meses acelerou de 3,0% para 3,2%. Os dados de inflação ao consumidor nos EUA ficaram dentro do esperado, o que foi uma boa notícia, reforçando a tese de manutenção da taxa básica, hoje no intervalo de 5,25% e 5,5%, daqui para adiante.

Além disso, caso o núcleo do CPI permaneça entre 0,10% e 0,20%, indicará uma desaceleração relevante e sinalizará para o Fed que, a depender da evolução do mercado de trabalho, seu esforço em trazer a inflação corrente para a meta estará próximo do final. A partir daí, as discussões serão qual o tamanho e quando os cortes deverão acontecer.

Na China, a falta de empuxo no crescimento continua assustando o mercado. Os números do crescimento econômico da China têm levado o mercado a rebaixar suas previsões para o ano de 2023. Instituições financeiras e organismos internacionais estão cortando as projeções de crescimento econômico este ano para não muito além da meta de 5,0%.

A atividade econômica continua mostrando indicadores enfraquecidos apesar de algumas intervenções de estímulo vindas do governo. O Índice de Gerentes de Compras (PMI) da indústria manufatureira bateu 49,7 em agosto. A leitura foi superior às expectativas de 49,5, bem como a leitura de julho de 49,3, porém números abaixo de 50,0 mostram atividade fraca. A fraqueza no setor industrial foi impulsionada principalmente pela



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



desaceleração da procura local e externa, à medida que as condições econômicas nos maiores parceiros comerciais da China pioraram.

Por conta desses indicadores mais fracos, uma série de medidas tem sido tomadas pelo governo para melhorar esse quadro. O Banco Central da China (PBoC) reduziu diversas taxas de empréstimos durante o mês de agosto, com destaque para a taxa de 1 ano, de 2,65% para 2,5%. Mais ainda, reduziu a taxa básica de juros (LPR) de um ano de 3,55% para 3,45%, o segundo corte em 2 meses, onde inicialmente a taxa era de 3,65%. As decisões vieram abaixo do esperado pelo mercado que entende que o governo chinês precisa de ações mais contundentes.

Em relação ao mercado de trabalho, o país também divulgou sua taxa de desemprego, que apresentou redução marginal, de 5,5% em junho para 5,4% em julho, porém, com alta do desemprego entre jovens, de 19,3% para 19,9% - recorde histórico para esse indicador. Segundo o Escritório Nacional de Estatísticas (NBS), a divulgação do desemprego entre jovens será interrompida, o que gera preocupações sobre a transparência em relação aos indicadores econômicos do país.

As vendas no varejo de julho apresentaram desaceleração, passando de 3,1% para 2,5%, ficando abaixo do esperado pelo mercado (4,5%). Na produção industrial tivemos a mesma dinâmica, com desaceleração de 4,4% para 3,7%, resultado inferior às expectativas (4,1%).

Por fim, o governo chinês trará outra medida de ajuste via o mercado de capitais. O governo quer implementar corte de até 50% no imposto sobre transação em ações na tentativa de revitalizar o mercado acionário que foi impactado pelo recrudescimento da crise imobiliária

Na Zona do Euro, no início do mês de agosto o Banco Central Europeu (BCE) voltou a subir a taxa em 0,25%. Agora, a taxa básica atingiu 4,25% ao ano. Desde que o Euro foi introduzido, o bloco não tinha taxas de juros tão elevadas.

A ata da última reunião do BCE trouxe uma avaliação de que os riscos se moveram na direção de um panorama macroeconômico ainda mais deteriorado, diante de indicadores de atividade que surpreenderam negativamente e sinalizam maior fragilidade econômica nos próximos meses. No fim, era necessária uma elevação de 0,25 p.p. segundo os membros do BCE.



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



Sobre a atividade econômica, continuará fraca nos próximos trimestres devido sobretudo ao aperto das condições financeiras. O mercado projeta que o PIB crescerá apenas 0,5% em 2023 e 0,9% em 2024. Os juros altos e a inflação vêm minando o crescimento. O 2º trimestre deste ano registrou aumento da atividade de apenas 0,3% em comparação com o trimestre anterior. No primeiro trimestre do ano, o bloco havia registrado certa estabilidade, contra retração de -0,1%.

Ainda sobre a atividade econômica o volume de vendas do comércio varejista na Zona do Euro apresentou variação de -0,3% (M/M). Já a produção industrial variou 0,5% (M/M) no mesmo mês, acelerando em relação à estabilidade observada no mês imediatamente anterior.

Quanto ao cenário inflacionário, o Índice de Preços ao Consumidor (CPI) avançou 5,3% no acumulado de doze meses, mostrando uma redução gradual. Já o núcleo da inflação tem sido mais resistente, marcando também 5,3% ante 5,5% no mês anterior, ficando em linha com as expectativas do mercado e com o dado da prévia. A desaceleração foi bem disseminada, com destaque para os itens de “energia” (-6,1% ante -5,6% A/A) e “alimentos” (10,8% ante 11,6% A/A), enquanto, por outro lado, “serviços” aceleraram de 5,4% para 5,6% (A/A). O núcleo, medida que fornece um melhor direcionamento do caminho que a inflação deve seguir, é um ponto de atenção para as autoridades monetárias.

No Brasil, após alguns meses de dados mistos, nas divulgações de agosto houve predomínio positivo nos números da atividade econômica brasileira, principalmente pelo início dos cortes da taxa Selic neste novo ciclo de baixa para os juros.

Entre os indicadores referentes ao mês de junho, o varejo restrito teve variação mensal nula na margem mensal, mas, no conceito ampliado, que inclui veículos (8,5%) e material para construção (-0,3%), houve alta de 1,2% (M/M). Destaque para o efeito das isenções de IPI para carros populares. A produção industrial cresceu 0,1% (M/M) e o IBC-Br de junho teve expansão de 0,6% (M/M), puxado pelo varejo ampliado.

No âmbito de política fiscal, o resultado primário do governo central de julho surpreendeu com um déficit de R\$35,9 bilhões, abaixo do consenso de R\$ 33,2 bilhões, ante julho de 2022 com déficit de R\$19,0 bilhões. Receita líquida: -5,3%, A/A. Despesa primária: +31,3%, A/A), como efeito da arrecadação líquida menor para mês, na comparação anual (A/A). No acumulado do ano, o saldo primário apresenta déficit de R\$ 78,2 bilhões, e nos últimos 12 meses acumulou déficit de R\$ 97,0 bilhões, ou seja, 0,9% do PIB.



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



À medida que a atividade econômica desacelera nos setores que mais arrecadam, o mercado espera um novo declínio nas receitas. Olhando para o final do ano, a estimativa é de um déficit em torno de R\$ 108,5 bilhões.

Em relação ao campo monetário, a reunião do Copom de agosto contou com dois novos integrantes (Gabriel Galípolo e Ailton Aquino). No encontro, o Comitê decidiu pelo corte de 0,50 p.p. na taxa básica de juros da economia (5 votos favoráveis e 4 votos contrários, pelo corte de 0,25 p.p.), levando a Selic de 13,75% a.a. para 13,25% a.a. De forma geral, a decisão destoou da comunicação que vinha sendo adotada, na qual os representantes do Banco Central do Brasil (BCB) destacavam a necessidade de parcimônia na condução de política monetária em um cenário de persistência inflacionária global e alta probabilidade de uma maior persistência da inflação de serviços.

Sobre a Ata, o BCB buscou intensificar o tom hawkish e tentou pacificar alguns pontos de divergências observadas no comunicado. Entre os argumentos, destaque para a preocupação com o hiato do produto apertado, mercado de trabalho resiliente e a necessidade de manter uma política monetária contracionista pelo horizonte relevante para que ocorra a consolidação da convergência da inflação e das expectativas para patamares compatíveis com a meta. Apesar disso, a entidade, já indicou que efetuará novos cortes de mesma magnitude nas próximas reuniões

Em relação ao mercado de trabalho, segundo o MTE, houve saldo de empregos formais (Caged) de 142.702 em julho, puxado por serviços (56.303), setor que está se beneficiando do bom momento do mercado de trabalho e das características do novo padrão da economia, transformação que foi acelerada pós choque do Covid-19. Nesse contexto, a taxa de desemprego (PNAD/IBGE) recuou de 8,0% para 7,9% em julho.

O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) que avançou +0,23% (M/M) em agosto, acelerando em relação ao avanço de +0,12% (M/M) observado no mês anterior. Com isso, o índice acumulou alta de +4,61% em 12 meses (ante +3,99% em julho), acelerando nessa base de comparação. A maior contribuição para a variação do índice partiu do grupo “Habitação” influenciado pelo expressivo aumento dos itens de Combustíveis e energia, com destaque para Energia elétrica residencial.



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



Os preços administrados avançaram +1,26% em agosto ante +0,46% de julho, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Óleo diesel (+8,54% ante -1,37% na leitura anterior).

Nas aberturas dos preços livres houve avanço de produtos industriais e de serviços +0,12% para +0,32% e +0,25% para +0,08% respectivamente, enquanto alimentos apresentaram recuo de -0,72% para -1,26%. A média dos núcleos acelerou na comparação mensal (de +0,18% para +0,28%), enquanto quando observada a variação acumulada em 12 meses desacelerou (de +5,63% para +5,22%). Já o índice de difusão passou de 46,15% em julho para 53,05% em agosto.

No mês de agosto voltaram os temores com relação a uma possível recessão global, os ativos de risco performaram mal no mês. No exterior, o S&P 500, índice das principais empresas norte-americanas, apresentou baixa de -1,77% e o Stoxx 600, índice de ações europeias, fechou em queda de -2,79% no mês. No mercado emergente, o CSI 300, que mede a variação do mercado chinês, caiu -6,21%, e o MSCI Emerging Markets, que nos dá uma visão ampla do desempenho das Bolsas emergentes, teve queda de -6,16%.

O mês de agosto deste ano marcou a história da Bolsa e do Ibovespa. O índice apresentou uma sequência de 13 pregões consecutivos com oscilação negativa. A maior sequência até então havia sido de 12 pregões consecutivos com a oscilação negativa em 1970, de 26 maio a 11 de junho daquele ano. O Ibovespa, principal índice da bolsa de valores brasileira, apresentou queda de 5,05% no mês de agosto. Com esse desempenho negativo, o indicador acumula valorização de 5,47% no ano até o momento. Esse misto de queda e avanço no acumulado é sinal de alguns indicadores não muito convincentes, mas que também pode ser atribuído a um movimento de realização de lucros, que ocorre quando investidores vendem ações que tiveram forte valorização para efetivar os ganhos com os papéis.

O ambiente é favorável para que os juros continuem sendo cortados nos próximos meses. E isso, por sua vez, permitirá a recuperação de setores ligados ao ciclo econômico doméstico, que vem bastante descontados. Ainda que o presidente do Banco Central do Brasil, Roberto Campos Neto, continue com uma postura mais dura, estamos caminhando para uma possível virada de ciclo com os cortes nos próximos meses.



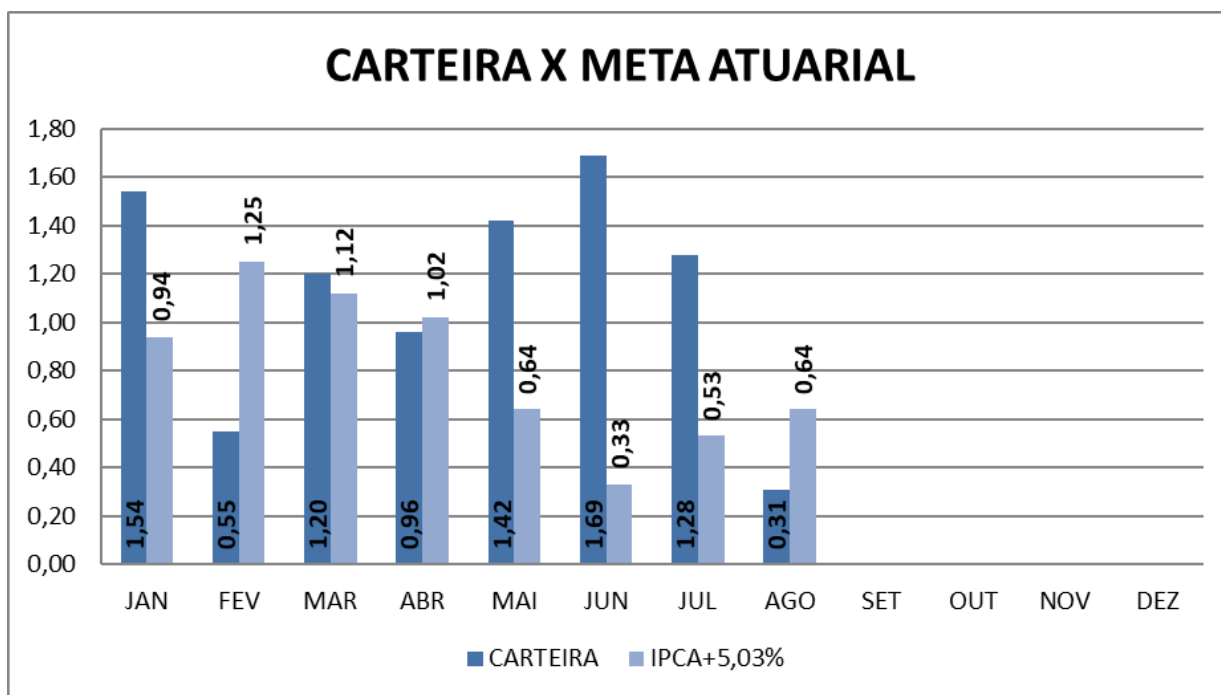


### 3. RESULTADO DA CARTEIRA

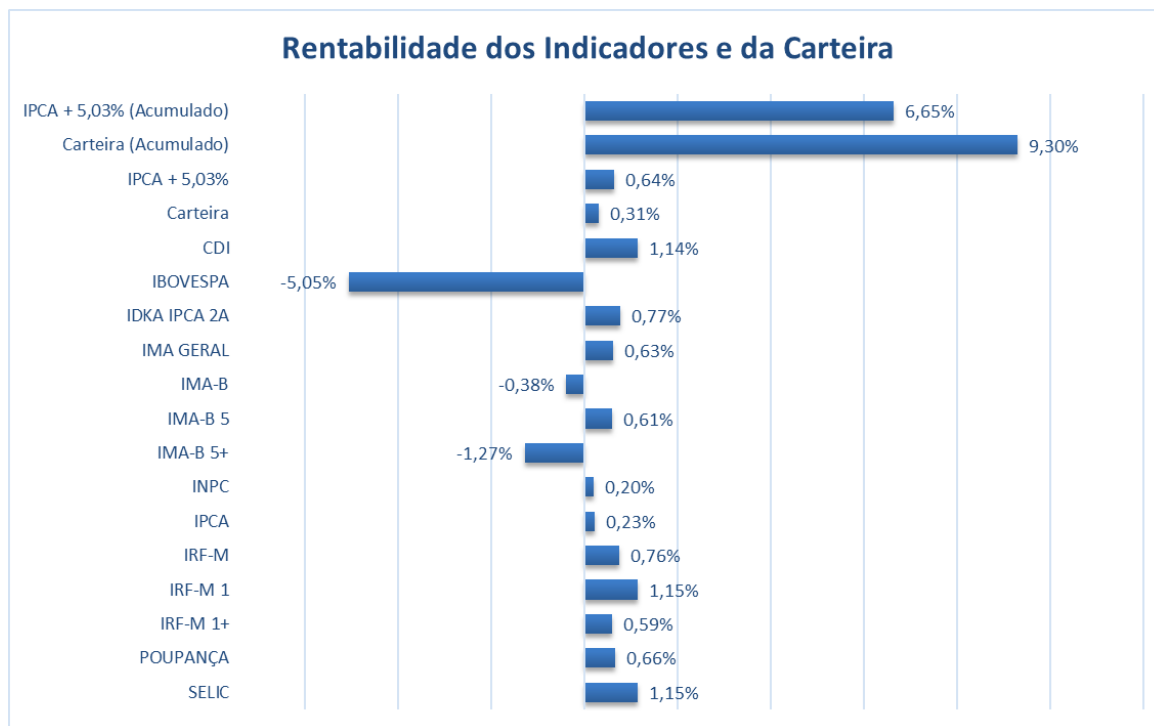
No mês de agosto, nosso portfólio teve desempenho inferior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com uma alta de 0,31%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 5,03%, foi de 0,64%.

#### HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

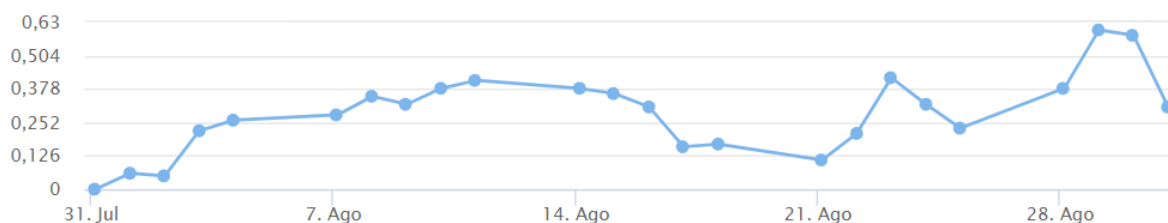
2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
CARTEIRA	1,54	0,55	1,20	0,96	1,42	1,69	1,28	0,31					9,30
IPCA+5,03%	0,94	1,25	1,12	1,02	0,64	0,33	0,53	0,64					6,65



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



A imagem a seguir traz o comportamento da carteira ao longo do mês de agosto.



No mês de agosto, nossos fundos de investimentos apresentaram rendimento misto, com destaque negativo principalmente para os que são voltados à renda variável e inflação, devido ao risco fiscal. No entanto, é importante salientar que já existem melhoras no ambiente interno e externo, algo que irá convergir nos papéis positivamente mais a frente, ou seja, verificamos nesse mês uma queda que é na verdade oportunidade de aumentar nossas participações nesses fundos com cautela e certa margem de segurança.



A carteira também apresentou alguns fundos com fechamento positivo e superiores a meta, sendo que as maiores altas foram principalmente em ações no exterior. Dentre eles, BB Multimercado Nordea IE com 3,38%, FIA Caixa Institucional BDR Nível I com 2,90%. Os dois novos fundos que colocamos na carteira também apresentaram resultado positivo. BB Ações Nordea Global Climate IE com 2,54% e o BB Ações BRL Universal Brands IE com 2,44%. Isso mostra a importância da diversificação em diferentes estratégias, principalmente, nos investimentos em renda variável. Mesmo que possam apresentar oscilações, os resultados e/ou ganhos costumam aparecer no médio e longo prazo.

Vale ressaltar que o balanço de risco está mais favorável para o mercado acionário. Mesmo com a indústria de fundos ainda recebendo saques e com o fluxo estrangeiro ainda modesto para a bolsa, a redução da Selic começou e a dos juros futuros também. Apesar das altas dos últimos meses, boas empresas continuam muito baratas e com retornos prospectivos elevados. Dessa forma, entendemos que a taxa de retorno esperada em um prazo maior é bem interessante. Por isso, a alocação em renda variável é importante, mesmo que pequena.

Em média, os fundos de ações brasileiras apresentaram rentabilidade de -4,52%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno médio de -0,84%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno de 1,47%. Os fundos de investimento no exterior tiveram resultado médio de 2,75%. Os fundos multimercado tiveram uma rentabilidade de 0,10%.

O fundo de vértice FI Caixa Brasil 2024 e o BB Previdenciário RF TP XXI renderam respectivamente 0,90%. As NTN-B 2024 renderam 0,82% e as NTN-B 2025 renderam 0,77%.

Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 1,14%. O fundo de renda fixa com gestão ativa rendeu 1,78%. Os fundos IMA-B 5 tiveram um retorno de 0,59%. Os fundos IMA-B 5+ tiveram retorno de -1,29%. O fundo que acompanha o IMA-B teve retorno de -0,37%. O fundo IRF-M 1+ rendeu 0,55%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade positiva de 0,33%. Até 31/08/2023 foram resgatados o total de R\$ 9.621.929,37 (nove milhões e seiscentos e vinte e um mil e novecentos e vinte e nove reais e trinta e sete centavos), cerca de 96% do total investido. O saldo em 31 de agosto estava em R\$ 707.031,79 (setecentos e sete mil e trinta e um reais e setenta e nove centavos).

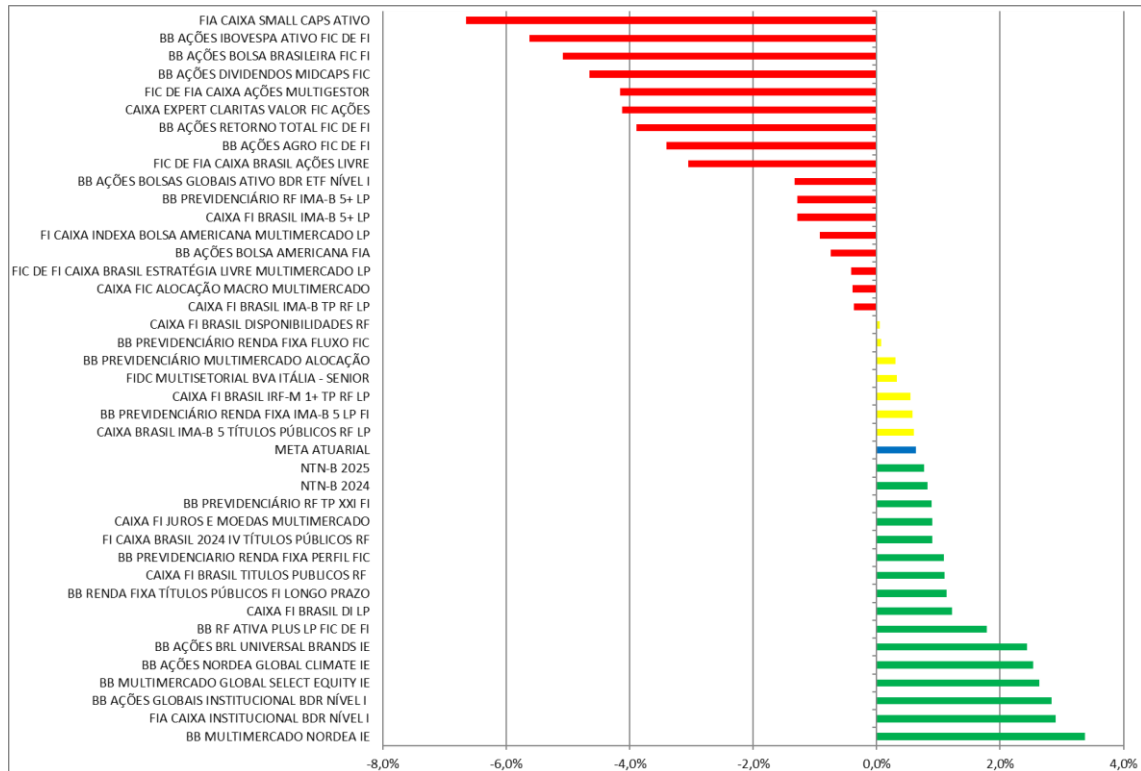
O gráfico a seguir mostra a comparação entre a rentabilidade dos fundos e a Meta Atuarial. Os fundos em verde bateram a Meta Atuarial, os fundos em amarelo apresentaram



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



resultado positivo, porém, abaixo da Meta Atuarial e os fundos em vermelho tiveram resultado negativo.



O rendimento de agosto da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 12.795.109,56 (doze milhões e setecentos e noventa e cinco mil e cento e nove reais e cinquenta e seis centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de agosto em R\$ 4.086.754.183,63 (quatro bilhões e oitenta e seis milhões e setecentos e cinquenta e quatro mil e cento e oitenta e três reais e sessenta e três centavos).



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



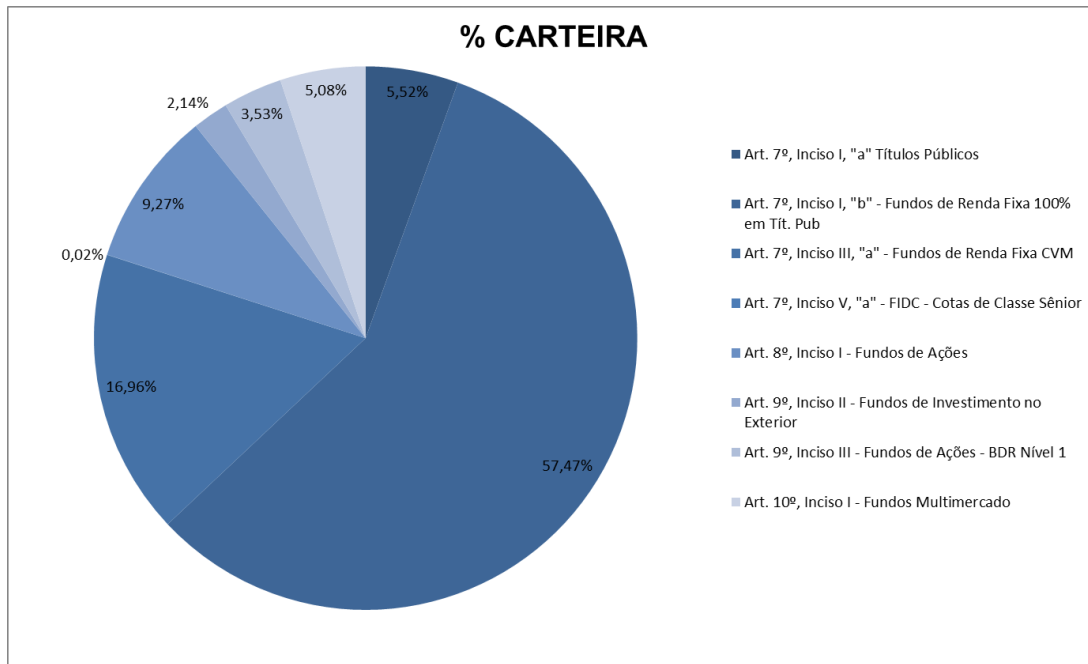
**SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS**

Fundo de Investimento	Saldo em 31/07/2023	Saldo em 31/08/2023	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$3.970,11	R\$2.723,85	-R\$3.721,57	R\$2.475,31	0,05%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$704.676,70	R\$707.031,79	R\$0,00	R\$2.355,09	0,33%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$730.607,46	R\$736.450,66	-R\$9.209,35	R\$15.052,55	0,07%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2024	R\$1.018.249,22	R\$996.976,48	R\$0,00	R\$8.272,35	0,82%
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	R\$4.051.691,49	R\$4.063.971,26	R\$0,00	R\$12.279,77	0,30%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$4.538.962,81	R\$4.351.584,05	R\$0,00	-R\$187.378,76	-4,13%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	R\$0,00	R\$6.146.383,97	R\$6.000.000,00	R\$146.383,97	2,44%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	R\$0,00	R\$6.152.528,11	R\$6.000.000,00	R\$152.528,11	2,54%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$21.348.872,83	R\$20.146.840,75	R\$0,00	-R\$1.202.032,08	-5,63%
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	R\$27.436.711,69	R\$27.325.098,69	R\$0,00	-R\$111.613,00	-0,41%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$29.783.775,04	R\$28.266.946,59	R\$0,00	-R\$1.516.828,45	-5,09%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$35.444.749,92	R\$36.643.589,98	R\$0,00	R\$1.198.840,06	3,38%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$37.604.380,41	R\$38.592.414,36	R\$0,00	R\$988.033,95	2,63%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$36.919.133,77	R\$40.919.037,41	R\$6.000.000,00	-R\$2.000.096,36	-4,66%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	R\$41.620.105,54	R\$41.459.375,48	R\$0,00	-R\$160.730,06	-0,39%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$42.058.720,49	R\$41.498.035,80	R\$0,00	-R\$560.684,69	-1,33%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$44.077.045,80	R\$42.574.601,96	R\$0,00	-R\$1.502.443,85	-3,41%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$42.934.301,99	R\$42.614.388,78	R\$0,00	-R\$319.913,21	-0,75%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$45.633.617,94	R\$45.215.252,01	R\$0,00	-R\$418.365,93	-0,92%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$42.639.163,51	R\$46.746.218,98	R\$6.000.000,00	-R\$1.892.944,53	-3,89%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$46.322.839,94	R\$48.841.780,06	R\$6.000.000,00	-R\$3.481.059,88	-6,65%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$46.879.587,81	R\$50.679.711,26	R\$6.000.000,00	-R\$2.199.876,55	-4,16%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$50.011.388,67	R\$51.424.953,61	R\$0,00	R\$1.413.564,94	2,83%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$50.040.493,87	R\$51.493.524,73	R\$0,00	R\$1.453.030,86	2,90%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$49.376.716,09	R\$53.685.524,06	R\$6.000.000,00	-R\$1.691.192,03	-3,05%
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$88.784.283,33	R\$89.585.265,77	R\$0,00	R\$800.982,44	0,90%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	R\$137.902.822,01	R\$142.053.524,34	R\$6.000.000,00	-R\$1.849.297,67	-1,29%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	R\$145.735.671,79	R\$143.859.661,62	R\$0,00	-R\$1.876.010,17	-1,29%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	R\$147.905.230,41	R\$148.764.383,52	R\$0,00	R\$859.153,11	0,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$174.870.468,08	R\$175.914.598,58	R\$0,00	R\$1.044.130,50	0,60%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	R\$205.073.395,67	R\$204.313.016,97	R\$0,00	-R\$760.378,70	-0,37%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$208.094.212,68	R\$204.547.624,20	R\$0,00	R\$1.865.689,95	0,90%
CAIXA FI BRASIL IRF-M1+ TP RF LP	R\$203.450.125,26	R\$204.565.205,37	R\$0,00	R\$1.115.080,11	0,55%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	R\$202.522.401,32	R\$206.126.177,05	R\$0,00	R\$3.603.775,73	1,78%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2025	R\$222.867.208,81	R\$224.581.700,23	R\$0,00	R\$1.714.491,42	0,77%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$220.100.507,59	R\$228.267.924,97	R\$5.416.000,00	R\$2.751.417,38	1,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$233.868.603,72	R\$229.538.976,20	-R\$6.421.893,74	R\$2.092.266,22	0,89%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$243.223.331,99	R\$258.138.146,41	R\$12.029.975,35	R\$2.884.839,07	1,09%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$355.826.891,89	R\$335.736.722,08	-R\$24.000.000,00	R\$3.909.830,19	1,10%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	R\$576.984.829,24	R\$559.476.311,64	-R\$24.000.000,00	R\$6.491.482,40	1,13%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$4.068.389.746,89</b>	<b>R\$4.086.754.183,63</b>	<b>R\$11.011.150,69</b>	<b>R\$12.795.109,56</b>	<b>0,31%</b>

#### 4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

##### 4.1. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023

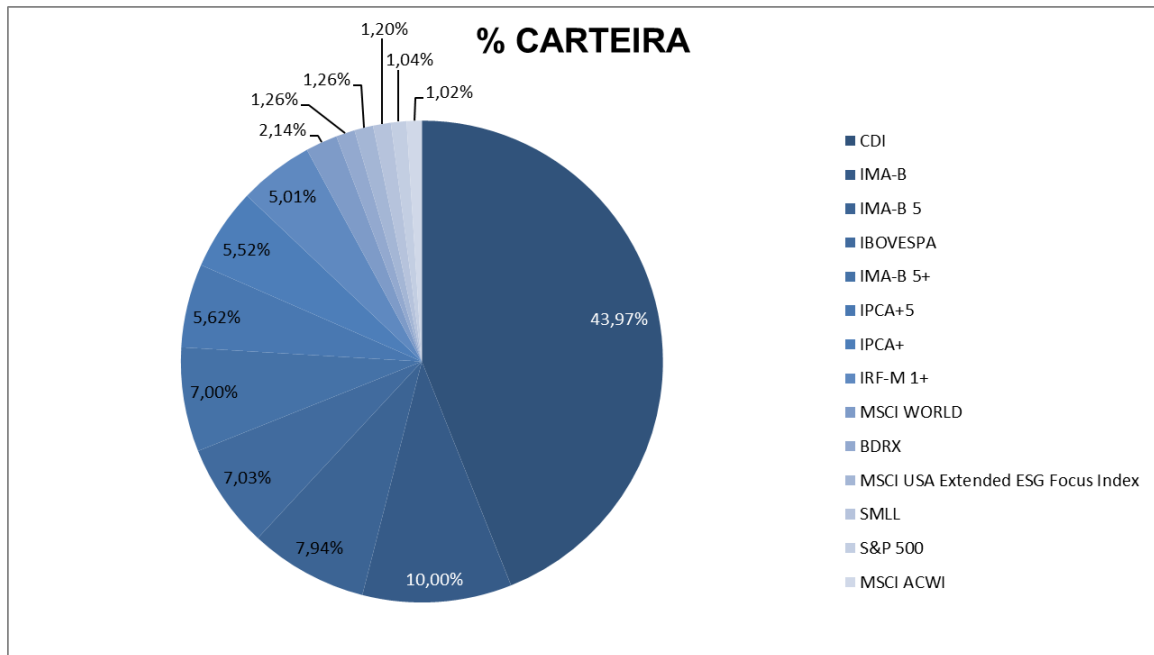
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023									
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2023	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo			Total
<b>Art. 7º, Inciso I, "a" Títulos Públicos</b>		<b>5,52%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>Não se Aplica</b>		<b>R\$225.578.676,71</b>
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	IPCA+	5,52%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	N/A		R\$225.578.676,71
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub</b>		<b>57,47%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>		<b>R\$2.348.770.024,52</b>
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	CDI	13,69%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	1,91%		R\$559.476.311,64
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	8,22%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	2,48%		R\$335.736.722,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	IMA-B 5	3,64%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	2,74%		R\$148.764.383,52
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	4,30%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	2,15%		R\$175.914.598,58
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	IMA-B	5,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	3,87%		R\$204.313.016,97
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	5,01%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	5,45%		R\$204.547.624,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	IMA-B 5+	3,52%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	7,74%		R\$143.859.661,62
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	IMA-B 5+	3,48%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	9,27%		R\$142.053.524,34
CAIXA FI BRASIL IRF-M1+ TP RF LP	IRF-M 1+	5,01%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	12,72%		R\$204.565.205,37
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	5,62%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	6,59%		R\$229.538.976,20
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>16,96%</b>	<b>65,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>			<b>R\$693.271.422,94</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	6,32%	65,00%	65,00%	20,00%	1,75%			R\$258.138.146,41
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,02%	65,00%	65,00%	20,00%	0,02%			R\$736.450,66
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	CDI	5,04%	65,00%	65,00%	20,00%	3,37%			R\$206.126.177,05
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	5,59%	65,00%	65,00%	20,00%	1,54%			R\$228.267.924,97
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%			R\$2.723,85
<b>Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior</b>		<b>0,02%</b>	<b>5,00%</b>	<b>0,50%</b>	<b>20,00%</b>	<b>5,00%</b>			<b>R\$707.031,79</b>
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,02%	5,00%	0,50%	20,00%	3,64%			R\$707.031,79
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>9,27%</b>	<b>35,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>			<b>R\$378.826.633,90</b>
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,49%	35,00%	35,00%	20,00%	13,13%			R\$20.146.840,75
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,69%	35,00%	35,00%	20,00%	12,15%			R\$28.266.946,59
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	1,04%	35,00%	35,00%	20,00%	12,50%			R\$42.574.601,96
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	1,04%	35,00%	35,00%	20,00%	3,45%			R\$42.614.388,78
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,14%	35,00%	35,00%	20,00%	5,60%			R\$46.746.218,98
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	1,00%	35,00%	35,00%	20,00%	9,33%			R\$40.919.037,41
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,11%	35,00%	35,00%	20,00%	12,92%			R\$4.351.584,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,20%	35,00%	35,00%	20,00%	7,13%			R\$48.841.780,06
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,24%	35,00%	35,00%	20,00%	7,88%			R\$50.679.711,26
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,31%	35,00%	35,00%	20,00%	8,39%			R\$53.685.524,06
<b>Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior</b>		<b>2,14%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>			<b>R\$87.534.916,42</b>
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	0,94%	10,00%	10,00%	20,00%	3,17%			R\$38.592.414,36
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	MSCI WORLD	0,15%	10,00%	10,00%	20,00%	1,27%			R\$6.152.528,11
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	MSCI WORLD	0,15%	10,00%	10,00%	20,00%	3,43%			R\$6.146.383,97
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	0,90%	10,00%	10,00%	20,00%	32,89%			R\$36.643.589,98
<b>Art. 9º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>3,53%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>			<b>R\$144.416.514,14</b>
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,26%	10,00%	10,00%	20,00%	3,87%			R\$51.424.953,61
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	1,02%	10,00%	10,00%	20,00%	11,09%			R\$41.498.035,80
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,26%	10,00%	10,00%	20,00%	2,44%			R\$51.493.524,73
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>5,08%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>			<b>R\$207.648.963,21</b>
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	0,10%	10,00%	10,00%	20,00%	3,08%			R\$4.063.971,26
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	1,01%	10,00%	10,00%	20,00%	2,68%			R\$41.459.375,48
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	CDI	2,19%	10,00%	10,00%	20,00%	5,62%			R\$89.585.265,77
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	CDI	0,67%	10,00%	10,00%	20,00%	11,21%			R\$27.325.098,69
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,11%	10,00%	10,00%	20,00%	2,80%			R\$45.215.252,01
<b>Total:</b>									<b>R\$4.086.754.183,63</b>



#### 4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

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

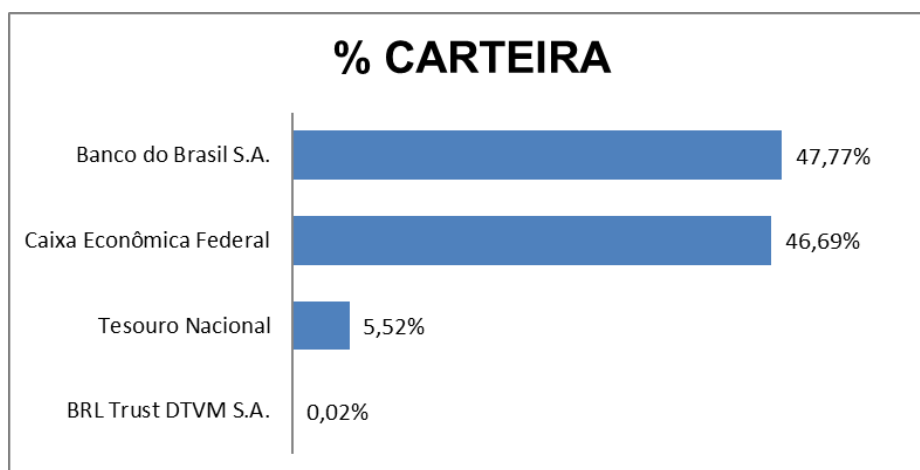
Indicador	Saldo em 31/08/2023	Participação
CDI	R\$1.796.840.451,66	43,97%
IMA-B	R\$408.860.641,17	10,00%
IMA-B 5	R\$324.678.982,10	7,94%
IBOVESPA	R\$287.370.465,06	7,03%
IMA-B 5+	R\$285.913.185,96	7,00%
IPCA+5	R\$229.538.976,20	5,62%
IPCA+	R\$225.578.676,71	5,52%
IRF-M 1+	R\$204.565.205,37	5,01%
MSCI WORLD	R\$87.534.916,42	2,14%
BDRX	R\$51.493.524,73	1,26%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$51.424.953,61	1,26%
SMLL	R\$48.841.780,06	1,20%
S&P 500	R\$42.614.388,78	1,04%
MSCI ACWI	R\$41.498.035,80	1,02%
<b>Total</b>	<b>R\$4.086.754.183,63</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\$707.031,79	0,02%
Tesouro Nacional	R\$225.578.676,71	5,52%
Caixa Econômica Federal	R\$1.908.038.456,47	46,69%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.952.430.018,66	47,77%







## 5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

### MOVIMENTAÇÕES

APLICAÇÕES		
Data	Valor	
01/08/2023	R\$13.397,66	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
02/08/2023	R\$1.482,02	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
04/08/2023	R\$4.580.274,32	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
07/08/2023	R\$4.800.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
08/08/2023	R\$1.195,06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
10/08/2023	R\$16.278,87	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
11/08/2023	R\$636,18	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
14/08/2023	R\$2.074,95	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
15/08/2023	R\$29.545,09	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
15/08/2023	R\$6.422.430,26	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/08/2023	R\$6.422.430,26	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
16/08/2023	R\$5.412.278,43	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
17/08/2023	R\$5.416.000,00	CAIXA FI BRASIL DI LP
18/08/2023	R\$987,68	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
18/08/2023	R\$6.000.000,00	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP
18/08/2023	R\$6.000.000,00	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC
21/08/2023	R\$150,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
21/08/2023	R\$6.000.000,00	FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR
21/08/2023	R\$6.000.000,00	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO
21/08/2023	R\$6.000.000,00	FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE
21/08/2023	R\$6.000.000,00	BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE
21/08/2023	R\$6.000.000,00	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE
21/08/2023	R\$6.000.000,00	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI
22/08/2023	R\$229,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
23/08/2023	R\$1.311,78	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
24/08/2023	R\$10.303.509,84	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
25/08/2023	R\$9.066.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
28/08/2023	R\$2.611,98	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
30/08/2023	R\$24.716,73	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

RESGATES		
Data	Valor	Ativo
03/08/2023	R\$513.343,06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
07/08/2023	R\$4.791.736,72	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
15/08/2023	R\$6.421.893,74	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI
16/08/2023	R\$6.156.211,51	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
17/08/2023	R\$5.416.000,00	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
18/08/2023	R\$24.000.000,00	CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP
18/08/2023	R\$24.000.000,00	BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP
24/08/2023	R\$8.288.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
25/08/2023	R\$9.026.671,32	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
31/08/2023	R\$892.533,37	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

TOTAL DAS AMORTIZAÇÕES	
NTN-B 2024	R\$29.545,09
FI CAIXA BRASIL 2024	R\$5.412.278,00
TOTAL	R\$5.441.823,52

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$100.517.540,41
Resgates	-R\$89.506.389,72
Saldo	R\$11.011.150,69

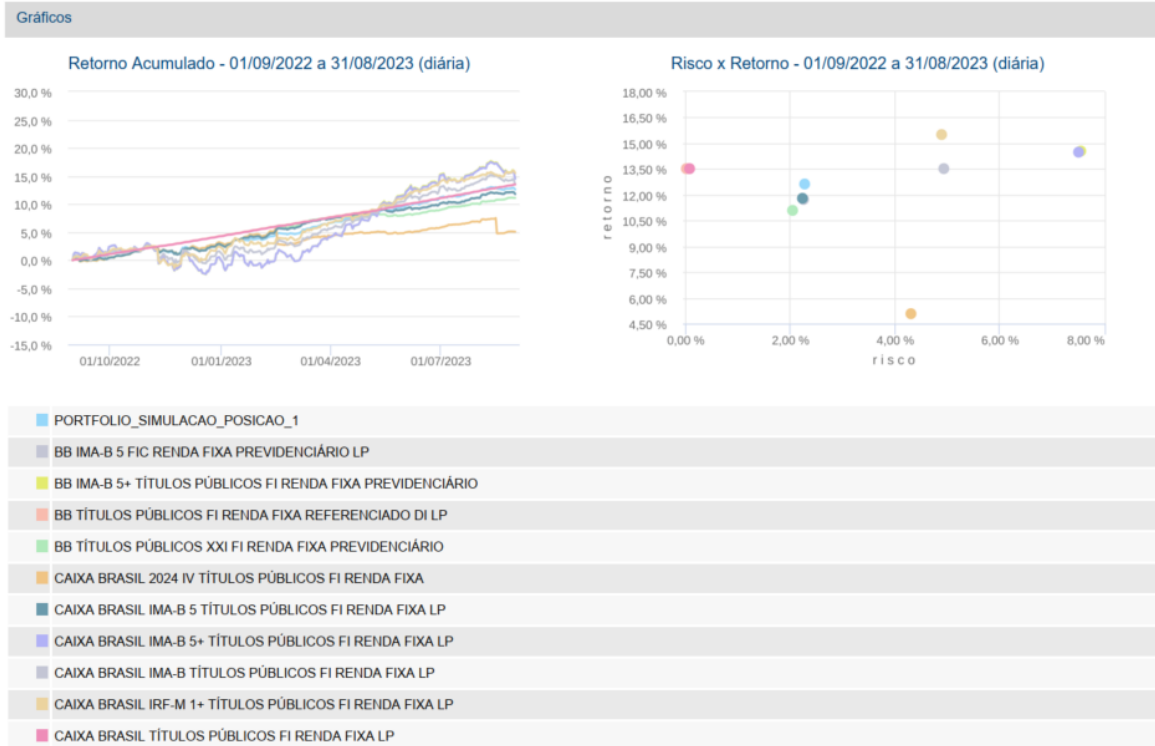
## 6. MONITORAMENTO DE RISCOS

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

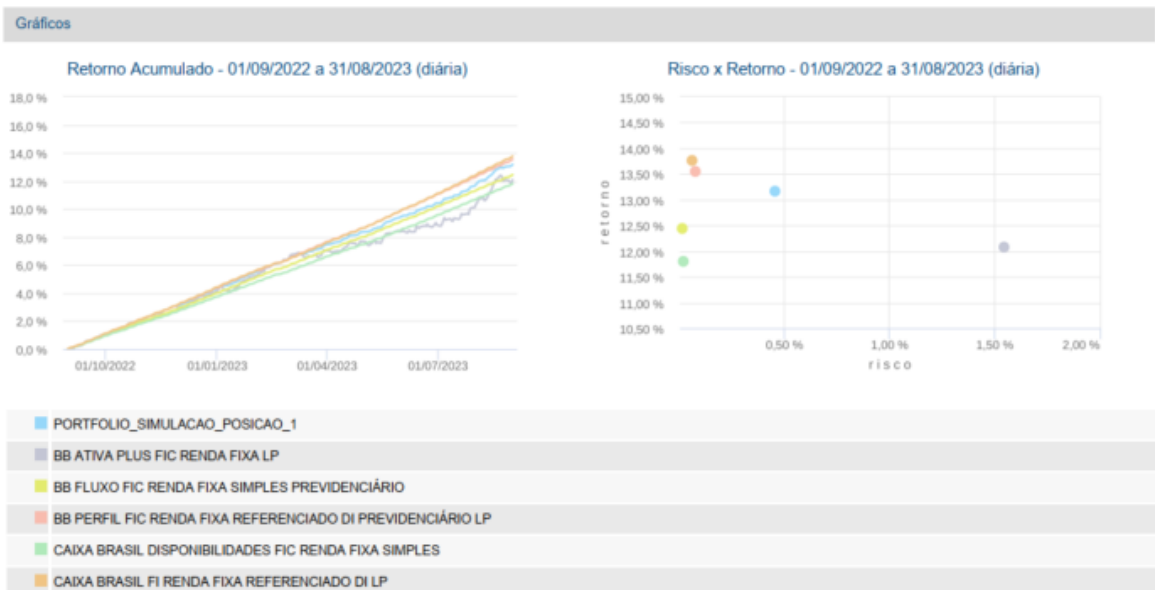




## 6.2. ART. 7º, INCISO I, “B” – FUNDOS DE RENDA FIXA 100% EM TP



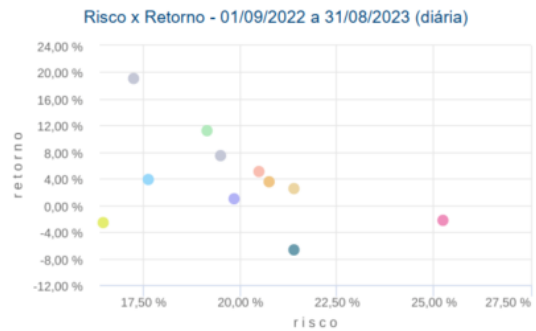
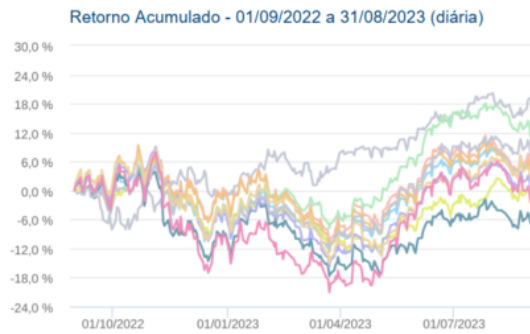
## 6.3. ART. 7º, INCISO III, “A” – FUNDOS DE RENDA FIXA CVM





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

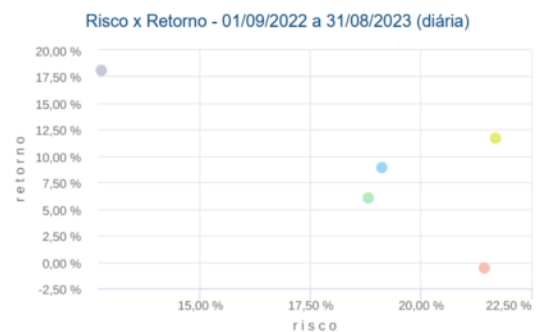
##### Gráficos



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES
BB AGRO FIC AÇÕES
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES

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

##### Gráficos

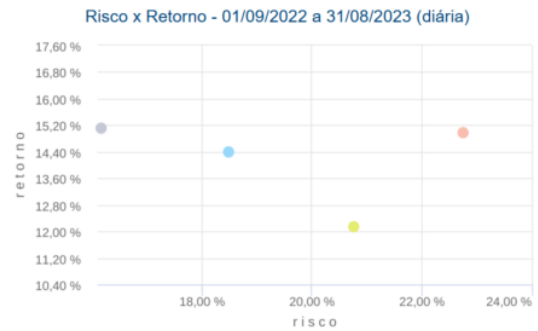
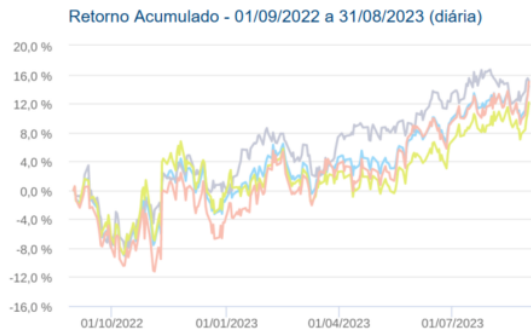


PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB BRL UNIVERSAL BRANDS PRIVATE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES
BB NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO



## 6.6. ART. 9º, INCISO III – FUNDOS DE AÇÕES – BDR NÍVEL I

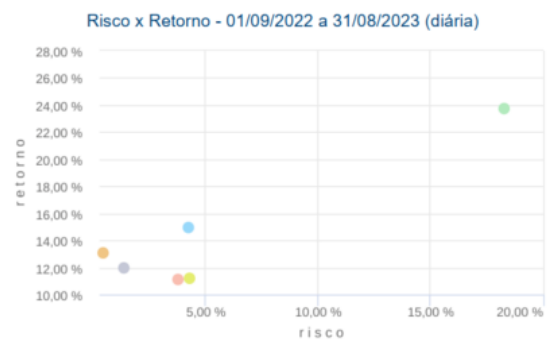
### Gráficos



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I

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

### Gráficos



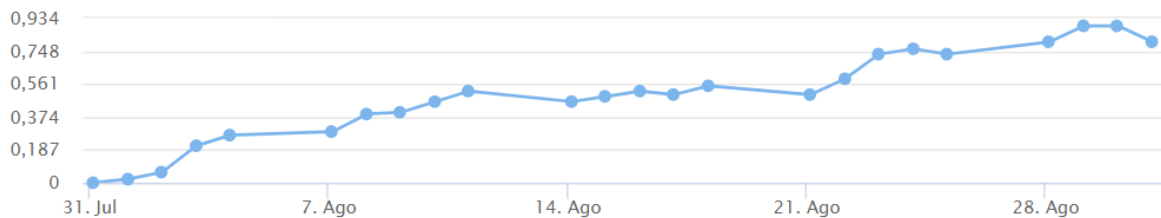
PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP



## 7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

### 7.1. RENTABILIDADE

A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,80% no mês de agosto, totalizando um saldo de R\$ 221.328.165,66 (duzentos e vinte e um milhões e trezentos e vinte e oito mil e cento e sessenta e cinco reais e sessenta e seis centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira ao longo do mês.



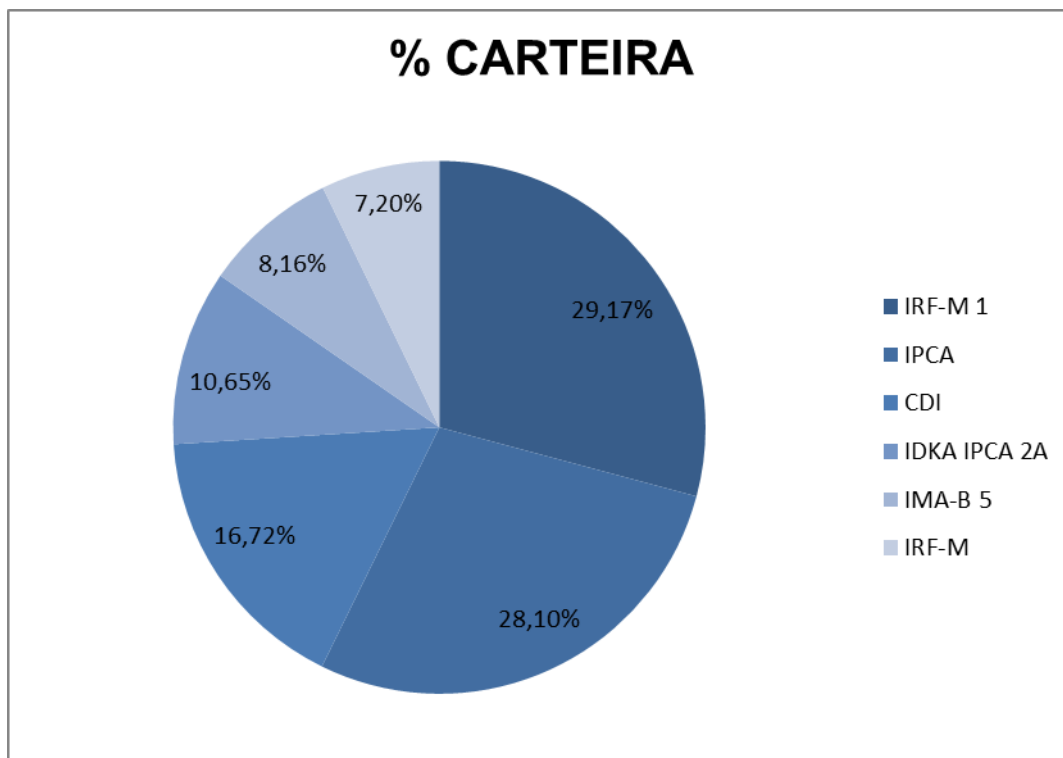
### 7.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023											
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução		% Limite PAI 2023		% 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>55,19%</b>	<b>100,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>R\$122.141.478,46</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	IRF-M 1	29,08%	100,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	0,95%	✓	R\$64.361.873,19
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	0,09%	100,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	0,00%	✓	R\$208.069,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2A	10,65%	100,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	0,38%	✓	R\$23.578.180,01
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	8,16%	100,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	0,33%	✓	R\$18.052.937,92
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	IRF-M	7,20%	100,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	0,49%	✓	R\$15.940.417,73
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>32,56%</b>	<b>65,00%</b>	✓	<b>65,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$72.066.286,75</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COT	CDI	4,31%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$9.535.419,87
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	CDI	0,16%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,01%	✓	R\$347.015,15
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,00%	✓	R\$1.279,91
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	28,10%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	1,04%	✓	R\$62.182.571,82
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>12,25%</b>	<b>10,00%</b>	✓	<b>10,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$27.120.400,45</b>
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,25%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	1,75%	✓	R\$27.120.400,45
<b>Total:</b>										<b>R\$221.328.165,66</b>	

### 7.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

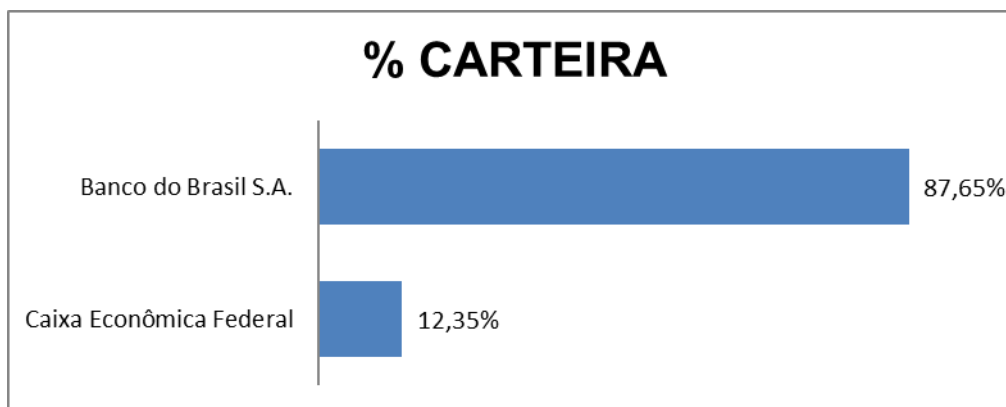
Indicador	Saldo em 31/08/2023	Participação
IRF-M 1	R\$64.569.942,80	29,17%
IPCA	R\$62.182.571,82	28,10%
CDI	R\$37.004.115,38	16,72%
IDKA IPCA 2A	R\$23.578.180,01	10,65%
IMA-B 5	R\$18.052.937,92	8,16%
IRF-M	R\$15.940.417,73	7,20%
	<b>R\$221.328.165,66</b>	<b>100,00%</b>



### 7.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

#### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

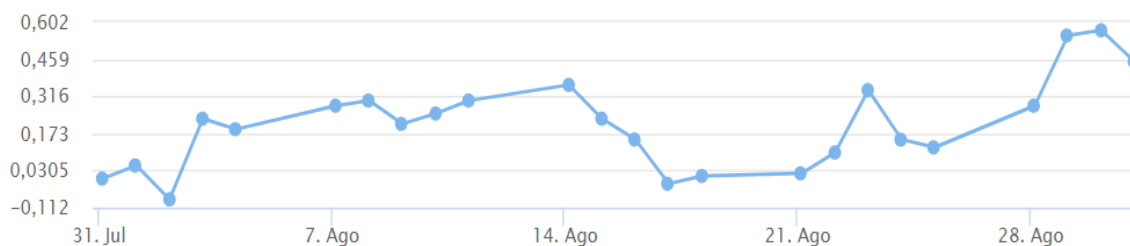
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$27.329.749,97	12,35%
Banco do Brasil S.A.	R\$193.998.415,69	87,65%



## 8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

### 8.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado positivo de 0,45% e fechou o mês com o saldo de R\$ 26.421.404,85 (vinte e seis milhões e quatrocentos e vinte e um mil e quatrocentos e quatro reais e oitenta e cinco centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de agosto.





## 8.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023

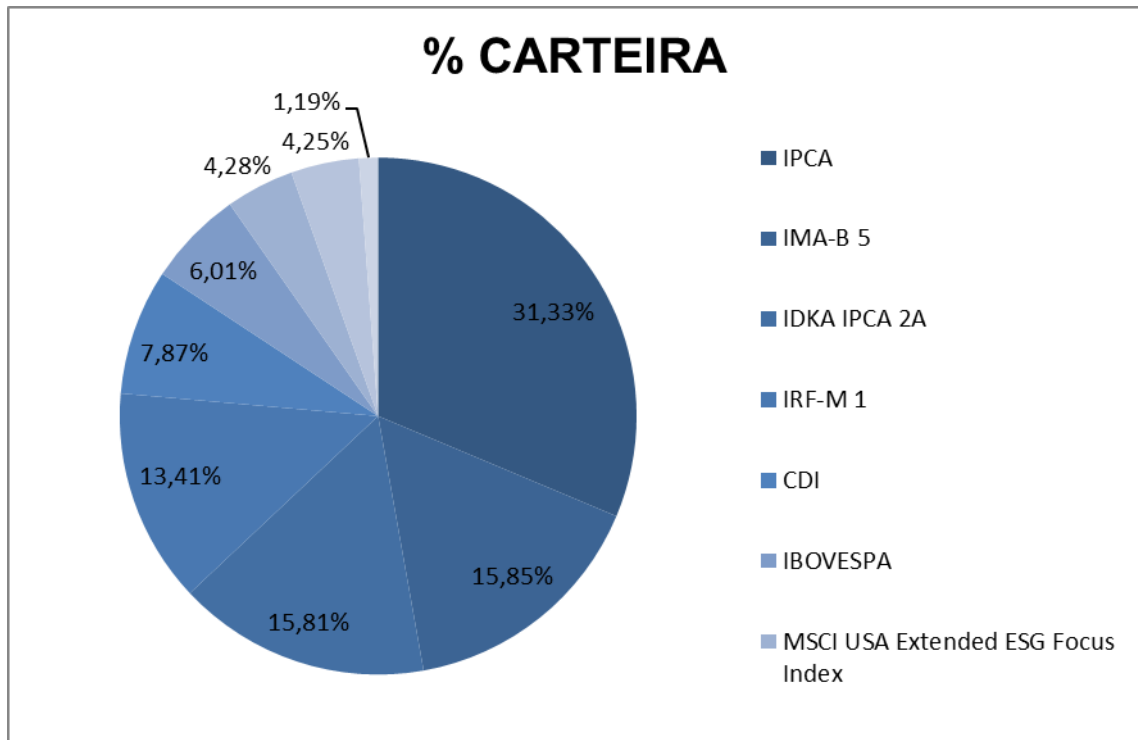
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023								
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2023	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total	
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub</b>		<b>60,59%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$16.008.750,39</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	6,63%	100,00%	100,00%	100,00%	0,03%	R\$1.750.898,33	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	6,79%	100,00%	100,00%	100,00%	0,02%	R\$1.793.137,76	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	15,81%	100,00%	100,00%	100,00%	0,08%	R\$4.175.957,43	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	15,85%	100,00%	100,00%	100,00%	0,08%	R\$4.188.973,71	
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	15,52%	100,00%	100,00%	100,00%	0,07%	R\$4.099.783,16	
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>15,81%</b>	<b>65,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$4.177.471,50</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,81%	65,00%	65,00%	20,00%	0,07%	R\$4.177.471,50	
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>7,20%</b>	<b>35,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$1.902.060,99</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	IBOVESPA	1,57%	35,00%	35,00%	20,00%	0,05%	R\$414.460,23	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,23%	35,00%	35,00%	20,00%	0,04%	R\$323.928,29	
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,78%	35,00%	35,00%	20,00%	0,07%	R\$470.174,90	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,43%	35,00%	35,00%	20,00%	0,06%	R\$378.055,80	
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,19%	35,00%	35,00%	20,00%	0,05%	R\$315.441,77	
<b>Art. 9º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>8,53%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$2.253.863,38</b>	
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	4,28%	10,00%	10,00%	20,00%	0,08%	R\$1.129.920,82	
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	4,25%	10,00%	10,00%	20,00%	0,05%	R\$1.123.942,56	
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>7,87%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$2.079.258,59</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	2,61%	10,00%	10,00%	20,00%	0,52%	R\$689.854,20	
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,59%	10,00%	10,00%	20,00%	0,28%	R\$684.951,66	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,67%	10,00%	10,00%	20,00%	0,04%	R\$704.452,73	
<b>Total:</b>							<b>R\$26.421.404,85</b>	

## 8.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 31/08/2023	Participação
IPCA	R\$8.277.254,66	31,33%
IMA-B 5	R\$4.188.973,71	15,85%
IDKA IPCA 2A	R\$4.175.957,43	15,81%
IRF-M 1	R\$3.544.036,09	13,41%
CDI	R\$2.079.258,59	7,87%
IBOVESPA	R\$1.586.619,22	6,01%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.129.920,82	4,28%
BDRX	R\$1.123.942,56	4,25%
SMLL	R\$315.441,77	1,19%
	<b>R\$26.421.404,85</b>	<b>100,00%</b>

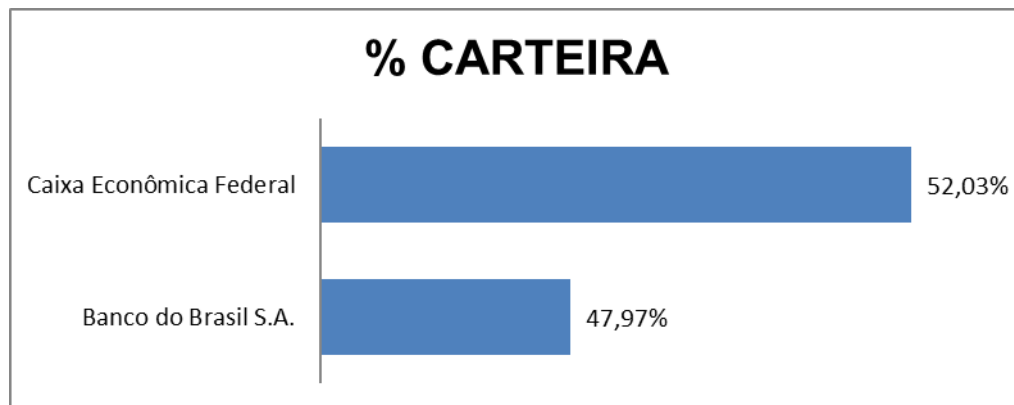




#### 8.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

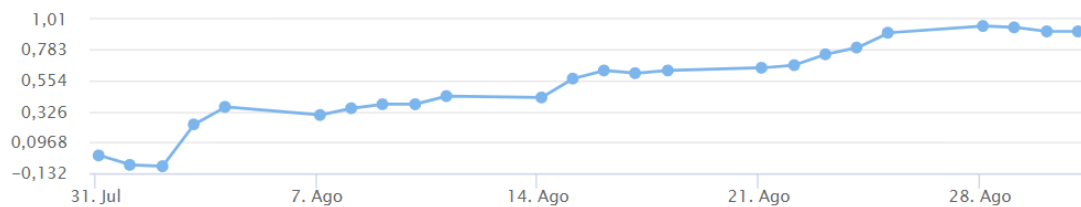
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$12.675.507,08	47,97%
Caixa Econômica Federal	R\$13.745.897,77	52,03%



## 9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

### 9.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de 0,92% e fechou o mês com o saldo de R\$ 18.987.844,33 (dezoito milhões e novecentos e oitenta e sete mil e oitocentos e quarenta e quatro reais e trinta e três centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de agosto.



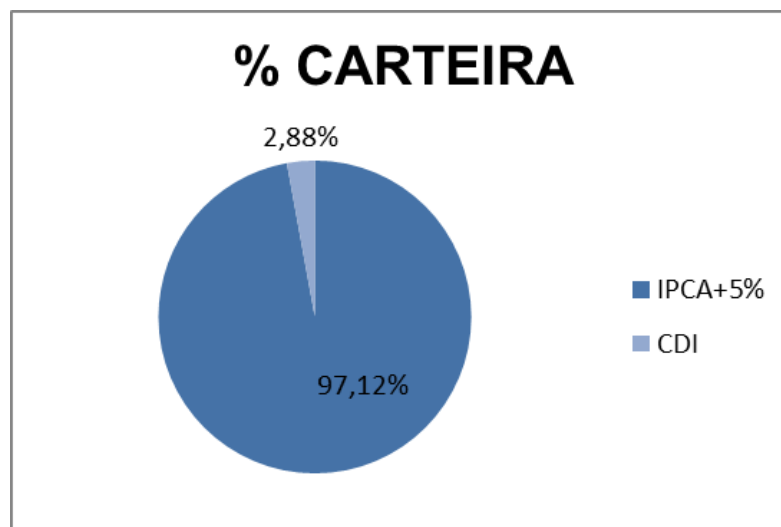
### 9.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023							
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2023	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		97,12%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$18.440.596,88
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA + 5%	97,12%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	0,76% ✓	R\$18.440.596,88
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$547.247,45
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$547.247,45
<b>Total:</b>							<b>R\$18.987.844,33</b>

### 9.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

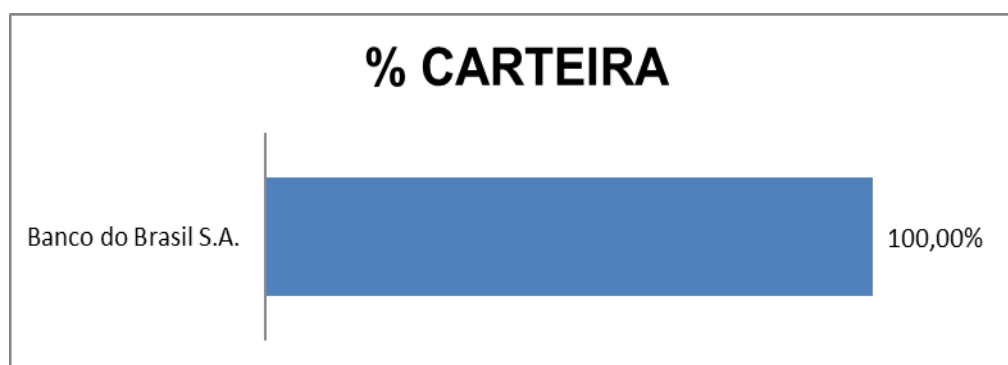
Indicador	Saldo em 31/08/2023	Participação
IPCA+5%	R\$18.440.596,88	97,12%
CDI	R\$547.247,45	2,88%
	<b>R\$18.987.844,33</b>	<b>100,00%</b>



#### 9.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$18.987.844,33	100,00%



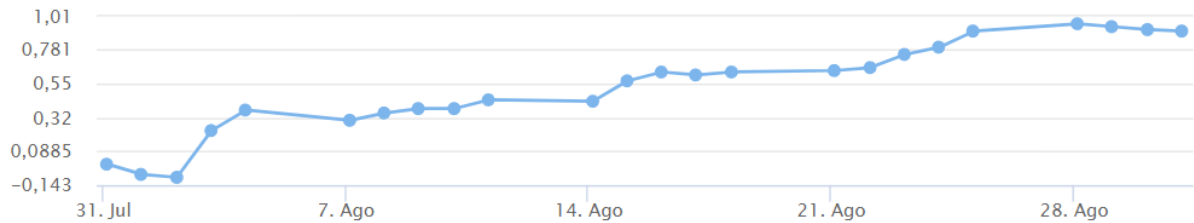
## 10. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023

### 10.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um resultado de 0,91% e fechou o mês com o saldo de R\$ 32.332.860,08 (trinta e dois milhões e



trezentos e trinta e dois mil e oitocentos e sessenta reais e oito centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de agosto.

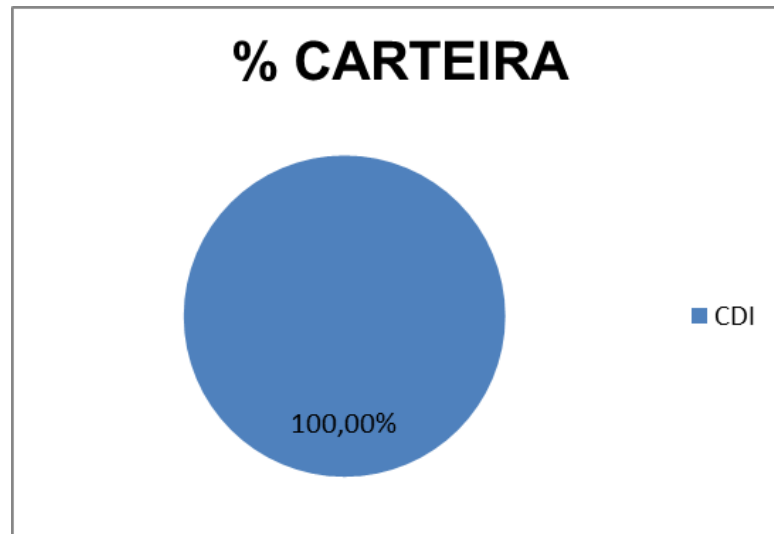


## 10.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2023							
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2023	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		100,00%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$32.332.860,08
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA+5%	100,00%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	1,34% ✓	R\$32.332.860,08
<b>Total:</b>							<b>R\$32.332.860,08</b>

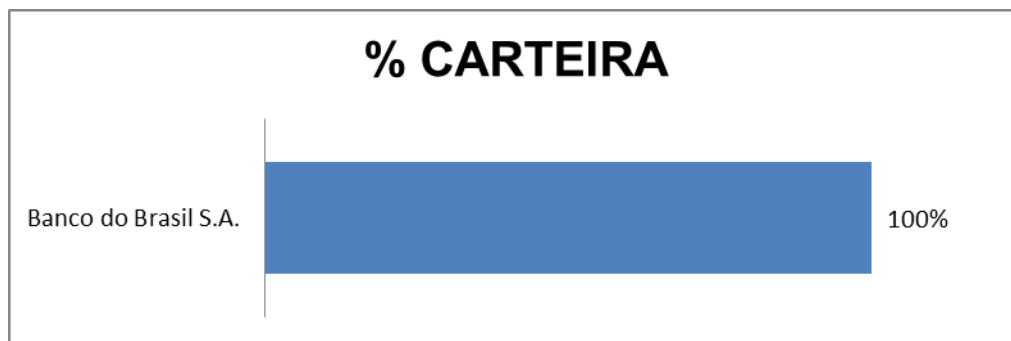
## 10.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 31/08/2023	Participação
IPCA+5%	R\$32.332.860,08	100,00%
	<b>R\$32.332.860,08</b>	<b>100,00%</b>



10.4. 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\$32.332.860,08	100%





## 11. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES

### 11.1. 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 MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	1,35%	20% do que excede 100% do CDI
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	1,00%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5+ LP	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,20%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,80%	0,00%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	2,00%	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 ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	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%
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	0,70%	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 BRL UNIVERSAL BRANDS IE	0,60%	0,00%



## 12. CONCLUSÃO

O Macaeprev encerrou o mês de agosto de 2023 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 4.385.824.456,55 (quatro bilhões e trezentos e oitenta e cinco milhões e oitocentos e vinte e quatro mil e quatrocentos e cinquenta e seis reais e cinquenta e cinco centavos).

Macaé, 25 de setembro de 2023.

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



## PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e cinco dias do mês de setembro de 2023, 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 agosto de 2023;

Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos o qual segue na íntegra na ata do dia de hoje: **25 de setembro de 2023**.

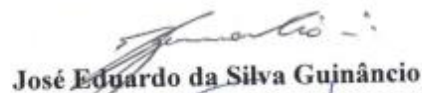
Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de **agosto de 2023**, e que foram devidamente fundamentadas e registradas nas atas de reunião do Comitê.

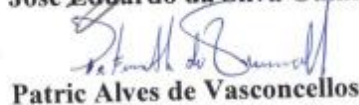
Considerando, por fim, que os investimentos são aderentes a Política Anual de Investimentos (PAI) do Macaeprev para o ano de 2023 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução CMN nº 4.963, **APROVAMOS** o relatório apresentado referente a **AGOSTO de 2023**, o qual segue para aprovação do Conselho 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





**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**

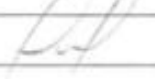


**AGOSTO DE 2023**

**TERMO DE APROVAÇÃO CONSELHO FISCAL**

Ao dia 11/10/2023, nas dependências do Instituto de Previdência Social de Macaé – MACAEPREV, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, 293, Centro, Macaé/RJ, o Conselho Fiscal reuniu-se para análise dos investimentos, acompanhamento da rentabilidade, dos riscos das diversas modalidades de operações realizados na aplicação dos recursos do RPPS, da aderência das alocações, processos decisórios de investimentos e políticas de investimentos referentes à **AGOSTO DE 2023**. Considerando todas as informações constantes no presente relatório, **APROVAMOS** o relatório de investimentos referente à **AGOSTO DE 2023**.

*Macaé, 11 de outubro de 2023.*

**CONSELHO FISCAL**

JÚLIO CÉSAR VIANA CARLOS	PRESIDENTE	
UELITON MACHADO PINTO	MEMBRO	
MARCELO P. TAVARES	MEMBRO	
SUSAN C. V. FERRAZ	MEMBRO	