

# RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



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



**SETEMBRO - 2024**



## SUMÁRIO

<b>1. INTRODUÇÃO .....</b>	<b>4</b>
<b>2. CENÁRIO ECONÔMICO.....</b>	<b>4</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 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 setembro 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

Após um longo período de juros altos, que seguiram a elevada inflação impulsionada pela pandemia da Covid-19, em setembro o mundo desenvolvido iniciou o tão esperado processo de afrouxamento monetário.

A novidade é que finalmente estamos observando o mesmo movimento nos Estados Unidos. Isso porque os últimos meses foram marcados por resultados de inflação melhores do que o esperado, ao mesmo tempo em que o mercado de trabalho caminha em direção ao reequilíbrio.

No front geopolítico, a tensão no Oriente Médio apresentou uma nova escalada com o ataque do Irã a Israel com reflexos nos mercados globais, bem como nas commodities energéticas. Além disso, a guerra da Ucrânia completa 31 meses, sem perspectivas de avanço nas negociações diplomáticas.

Nos EUA, a produção industrial subiu 0,8% em agosto, após ter registrado queda de 0,6% em julho, informou o Federal Reserve (Fed, o banco central americano). Especificamente, o setor de manufatura avançou 0,9% em agosto após cair 0,7% no mês anterior. Esse padrão foi motivado em parte por uma recuperação no índice de veículos automotores e peças, que saltou quase 10% em agosto após recuo de 9% em julho. Excluindo os veículos automotores e peças, no entanto, a manufatura cresceu apenas 0,3% em agosto.

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, caiu para 54,4 em setembro, ante 54,6 em agosto, segundo dados preliminares da S&P Global. É o menor nível



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



em dois meses. O índice de serviços caiu de 55,7 para 55,4, ficando em linha com o consenso de economistas consultados pelo The Wall Street Journal. O PMI industrial, por sua vez, caiu de 47,9 para 47,0 na mesma comparação, abaixo do consenso.

“Os indicadores iniciais da pesquisa de setembro apontam para uma economia que continua a crescer em um ritmo sólido, embora com um setor industrial enfraquecido e a intensificação da incerteza política atuando como ventos contrários substanciais. Enquanto isso, uma reaceleração da inflação também é sinalizada, sugerindo que o Fed não pode desviar totalmente o foco de sua meta de inflação ao tentar sustentar a recuperação econômica”, destaca Chris Williamson, economista-chefe de negócios da S&P Global Market Intelligence.

A inflação medida pelo índice CPI em agosto variou +0,2% (M/M), ante 0,2% (M/M) em julho. Com o dado de agosto, o índice acumulado em 12 meses reduziu de 2,9% para 2,5% (A/A). Já a inflação medida pelo PCE de agosto apresentou um crescimento de 0,1%, ante o crescimento de 0,2% (M/M) em julho, com redução da inflação anualizada de 2,5% para 2,2%.

Sobre o mercado de trabalho, o relatório de emprego *payroll* revelou que foram criados 142 mil postos de trabalho em agosto, ligeiramente abaixo do esperado, e foram feitas revisões para baixo nos números dos meses anteriores. Os números mostram uma melhoria em relação a julho, quando dados vieram consideravelmente abaixo das expectativas e levantaram temores de uma recessão. Em agosto, os salários cresceram acima das expectativas e registram alta interanual de 3,83%, acelerando em relação aos 3,63% de julho. A taxa de desemprego caiu levemente no mês, de 4,3% para 4,2%.

Após a divulgação do *payroll*, Christopher Waller, membro do Comitê de Política Monetária do Federal Reserve (FOMC), destacou que a economia americana não está em recessão nem se encaminha para uma, mas reconheceu a necessidade de ajustar a política monetária caso seja necessário.

A ata da última reunião do FOMC revelou a decisão de reduzir a taxa básica de juros em 50 pontos-base, para o intervalo de 4,75% a 5,00% ao ano, um corte 25 pontos-base acima das expectativas do consenso de mercado. O comunicado trouxe revisões importantes em relação ao anterior, com o comitê atualizando a avaliação do cenário, mantendo a visão de que a atividade continuou se expandindo em um ritmo sólido, mas trazendo a revisão sobre os ganhos do mercado de trabalho, cuja avaliação passou de moderados para uma desaceleração.



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



Com sinais mais claros de que o Federal Reserve será tempestivo nos cortes de juros e ajustará a rota a depender da evolução do emprego, o mercado, por sua vez, passa a esperar mais 2 cortes de 25 bps até o final do ano.

Na China, o risco de desaquecimento da economia reduziu após anúncio de mais estímulos do governo. O anúncio visa uma série de medidas para impulsionar a economia, desde cortes nas taxas de juros a medidas de flexibilização relacionadas à propriedade e novos instrumentos para apoiar o desenvolvimento do mercado de ações.

Em relação às taxas de juros, o People's Bank of China (PBoC) reduzirá a RRR, taxa de compulsório dos bancos em 50 pontos-base, o que corresponderá a uma injeção de liquidez no sistema financeiro de 1 trilhão de yuans (US\$ 142,21 bilhões). Entre as medidas relacionadas à propriedade, anunciou o corte de 50 bps nas taxas de hipotecas, cuja perspectiva é beneficiar aproximadamente 50 milhões de famílias, que pagarão 150 bilhões de yuans a menos em juros por ano.

A reação do governo ocorre com o intuito de atingir seu objetivo de crescimento de 5,0% para este ano. As frustrações com os dados econômicos e preocupação crescente com a falta de confiança do consumidor e das empresas pode resultar em uma desaceleração mais profunda. Apesar da aceleração do CPI com uma alta de 0,6% no acumulado de doze meses, observa-se que ainda está aquém da meta de 3,0%.

Na Zona do Euro, a inflação desacelerou para menos de 2% em setembro pela primeira vez desde meados de 2021, reforçando um argumento já sólido pelo corte na taxa de juros do Banco Central Europeu (BCE), à medida que a batalha de três anos para controlar a alta dos preços está sinaliza para um término.

A inflação nos 20 países que compartilham o euro atingiu 1,8% em setembro, de 2,2% em agosto, mostraram os dados do Eurostat, em linha com a expectativa em pesquisa da Reuters, principalmente devido à queda nos custos de energia e aos preços inalterados de outros produtos. A taxa de desemprego na Zona do Euro no mês de agosto registrou redução na margem, passando de 6,5% para 6,4%.

O BCE decidiu, por unanimidade, reduzir suas três taxas de juros diretoras, em linha com a expectativa do mercado. Assim, a taxa de juros de depósito, que define a orientação da política monetária, foi reduzida em 25 bps, ao passo que as taxas de operações principais de refinanciamento e de cedência liquidez foram reduzidas em 60 bps. Conforme anunciado, o





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



spread entre as taxas de juros será alterado, assim as três taxas diretoras alcançaram o patamar de 3,50%, 3,65% e 3,90%, respectivamente.

O Comitê de Política Monetária (MPC) do Bank of England (BoE) manteve a taxa básica de juros inalterada em 5% a.a., após redução de 25 pontos-base na reunião de agosto. Dos seus nove membros, oito votaram pela manutenção e um sugeriu reduzir a taxa em 25 bps.

Apesar da necessidade de capturar mais informações sobre a evolução dos dados de inflação, a projeção da autoridade monetária direciona para o atingimento da meta de inflação somente no próximo ano. Ainda assim, foi justificada a decisão com o intuito de amenizar o enfraquecimento da economia. Com a preliminar do CPI de setembro ficando em 1,8%, sinaliza maior possibilidade de mais um corte na reunião de outubro.

No Brasil, o Índice de Confiança da Indústria (ICI) de setembro recuou 1,2 ponto na comparação com o mês anterior e foi a 100,5 pontos, de acordo com os dados da FGV. O maior impacto para a queda do ICI em setembro veio do Índice de Expectativas (IE), indicador da percepção sobre os próximos meses, que caiu 1,7 ponto no mês, para 98,1 pontos, após dois meses consecutivos de alta.

Em relação aos dados da atividade econômica, o mercado de trabalho continuou significativamente robusto. Nesse sentido, destaque para a queda da taxa de desemprego (PNAD/IBGE), de 6,8% para 6,6% em agosto de 2024, mesmo com avanço da taxa de participação (62,1% para 62,3%). Entre os vetores, destaque para a expansão da população ocupada (+486 mil). A renda voltou a acelerar após um mês de desaceleração. Nessa seara, destaque para a renda habitual real (4,8% para 5,0%, A/A) e a massa salarial real (7,9% para 8,3%, A/A), o que correspondeu à patamares próximos aos recordes máximos históricos.

O volume de serviços no Brasil subiu 1,2% (M/M) em julho, o que levou o nível do volume de serviços ao recorde da série histórica. Destaque para Serviços de informação e comunicação (2%), Transportes, serviços auxiliares aos transportes e correio (1,8%). A indústria de julho recuou 1,4% (M/M). Destaque para bens de consumo semiduráveis e não duráveis (-3,1%). Já entre os ramos industriais, destaque para derivados do Petróleo (-3,9%).

Em relação ao campo monetário, o Comitê de Política Monetária (Copom), optou, unanimemente, por elevar a Selic em 0,25pp (10,50% para 10,75% aa). Sobre o comunicado, destaque para o comitê reforçando o risco altista para a inflação no cenário prospectivo, e que, portanto, há um viés ainda mais contracionista para política monetária. Houve ainda a



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



publicação da Ata do Copom. No documento, o comitê reforçou pontos trazidos no comunicado, como a preocupação com o cenário prospectivo para a inflação. O comitê salientou que o início do ciclo deveria ser gradual, mas que os próximos passos e a magnitude do ajuste dependerão dos dados. Sobre a inflação, deixou de fazer menção ao processo desinflacionário. Os itens do balanço de riscos para a inflação não mudaram, mas foi reafirmado sua assimetria altista, em linha com o comunicado.

O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) que avançou 0,44% (M/M) em setembro, acelerando em relação ao recuo de -0,02% (M/M) observado no mês anterior. Foi a maior variação mensal dos últimos 4 meses. Sendo que a variação foi superior a projeção de mercado de +0,4%. Com isso, o índice acumulou alta de +4,42% em 12 meses (ante +4,24% em agosto), acelerando assim nessa base comparação.

Os itens que mais contribuíram vieram dos grupos Despesas pessoais (variação de -0,31% ante projeção de +0,35%) e Alimentação e bebidas (+0,5% ante projeção de +0,29%). A maior contribuição para a variação do índice contudo, partiu do grupo Habitação influenciado pelo expressivo aumento dos itens de Combustíveis e energia com destaque para Energia elétrica residencial.

Os preços administrados avançaram +1,01% em setembro ante -0,12% de agosto, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Energia elétrica residencial (+5,36% ante -2,77% na leitura anterior). Já os preços livres aceleraram (de +0,02% para +0,24%) deixando de ser os principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres, produtos industriais e serviços desaceleraram de +0,18% para +0,16% e de +0,24% para +0,15% respectivamente. Por outro lado, alimentos aceleraram de -0,73% para +0,56%.

O Ibovespa, principal índice da bolsa de valores brasileira, apresentou desvalorização de 3,08% em relação ao mês anterior, fechando aos 131.816 pontos. No ano, o índice acumula queda de 1,77%.

Neste contexto, a performance negativa no mês pode ser explicada, majoritariamente, pelo aumento da aversão ao risco dos investidores em função da elevação da curva de juros doméstica e, conseqüentemente, do aumento do prêmio de risco. Investidores continuam com dúvidas sobre como se dará a evolução da política fiscal brasileira, ao mesmo tempo em que a economia continua apresentando forte expansão e com um mercado de trabalho apertado, fazendo com que as expectativas de inflação para os próximos anos aumentem, que por sua





vez, faz com que os investidores esperem que o Banco Central precisará elevar os juros mais que o anteriormente previsto, impactando negativamente os ativos de risco.

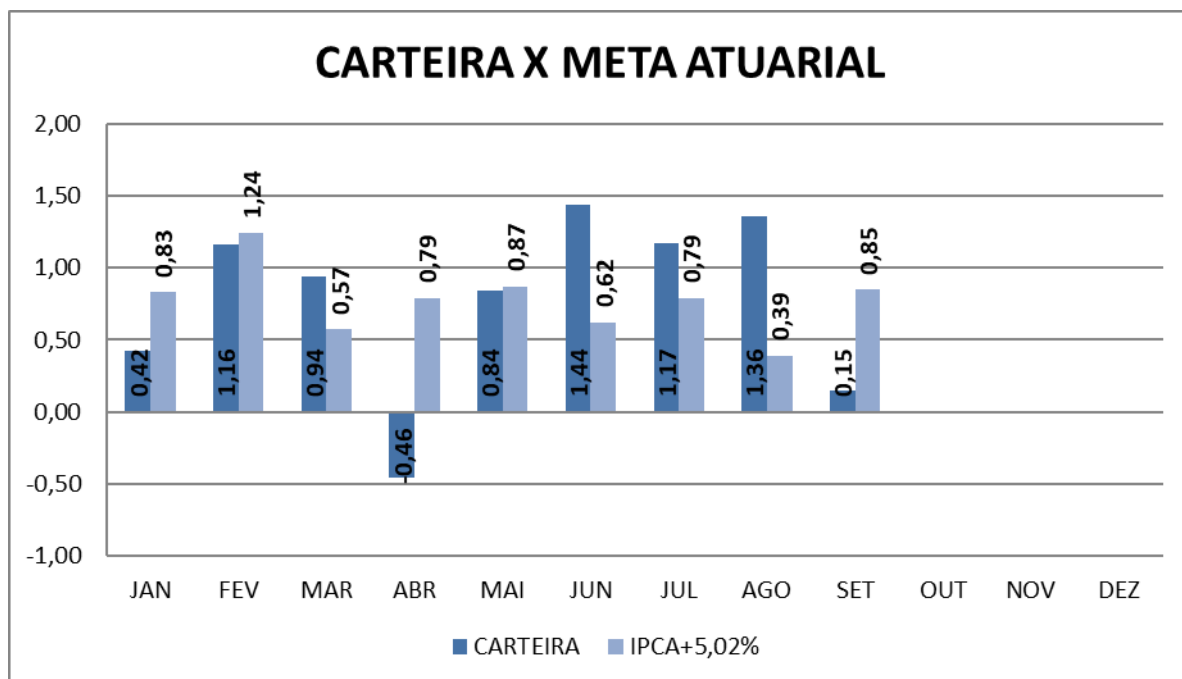
No entanto, as ações estão sendo negociadas com múltiplos consideravelmente inferiores à média histórica. A flexibilização monetária nos EUA pode atrair investidores estrangeiros para o Ibovespa, elevando os ativos de risco. Mas para que os ativos domésticos voltem a ser atraentes, é necessário que haja confiança na sustentabilidade fiscal e clareza sobre os juros.

### 3. RESULTADO DA CARTEIRA

No mês de setembro, nosso portfólio teve desempenho inferior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com uma rentabilidade de 0,15%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 5,02%, foi de 0,85%.

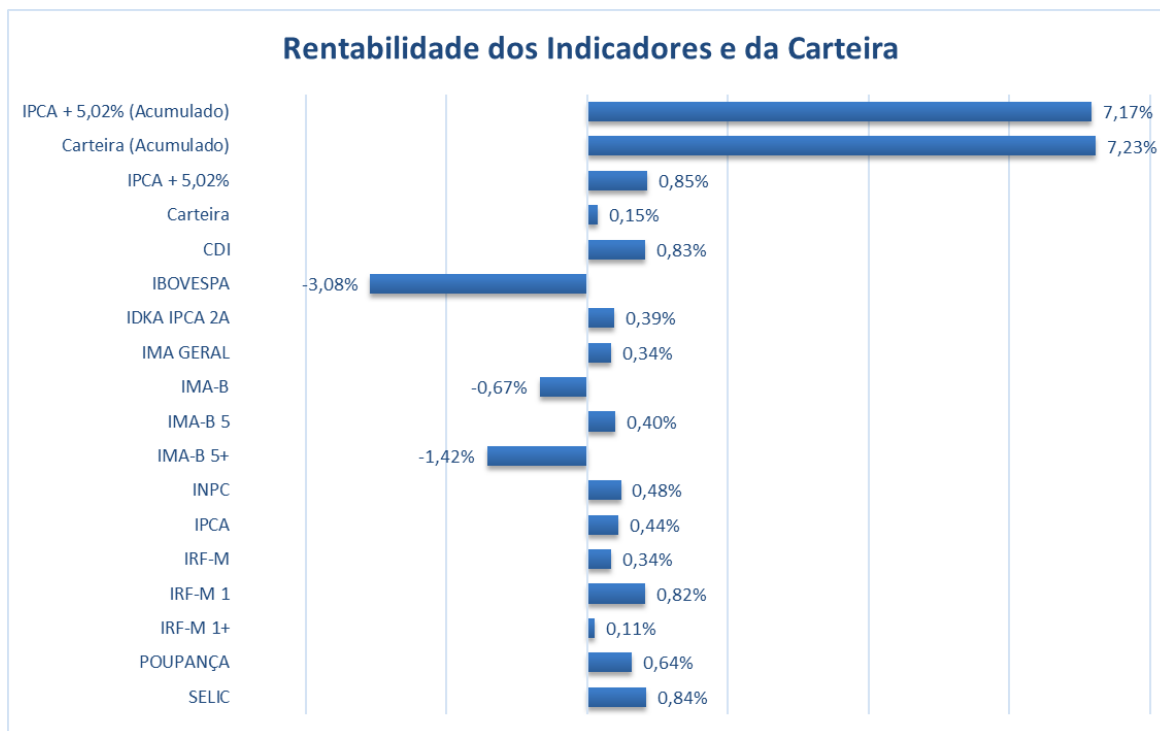
#### HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
CARTEIRA	0,42	1,16	0,94	-0,46	0,84	1,44	1,17	1,36	0,15				7,23
IPCA+5,02%	0,83	1,24	0,57	0,79	0,87	0,62	0,79	0,39	0,85				7,17





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



No mês de setembro, nossos fundos de investimento apresentaram um desempenho abaixo do esperado, com destaque negativo para os investimentos em bolsa doméstica, que mais contribuíram para a queda da carteira. Em contrapartida, os maiores ganhos vieram do Caixa Indexa Bolsa Americana Multimercado, com alta de 2,33%, BB Ações Universal Brands, com 1,79%, e FIDC Multisetorial Itália, com 0,89%. Esse resultado reflete, sobretudo, o impacto do aumento da taxa de juros no Brasil e o constante risco fiscal, que frequentemente assume o protagonismo no cenário econômico.

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 visto no mês de agosto e no final de 2023. 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 -3,83%. O fundo Caixa Indexa Bolsa Americana com proteção cambial apresentou um retorno de 2,33%. Já o fundo Caixa Institucional BDR teve um retorno de -0,32%. Os fundos de investimento no exterior tiveram resultado médio de -1,17%.

As NTN-B 2025 renderam 0,69%, as NTN-B 2026 renderam 0,69%, as NTN-B 2027 renderam 0,70%, as NTN-B 2028 renderam 0,70%, as NTN-B 2029 renderam 0,73%, as NTN-B 2035 renderam 0,73%, as NTN-B 2040 renderam 0,67%, as NTN-B 2045 renderam 0,67%, as NTN-B 2050 renderam 0,68%, as NTN-B 2055 renderam 0,68% e as NTN-B 2060 renderam 0,68%. Em média, as NTN-B ficaram com 0,69%.

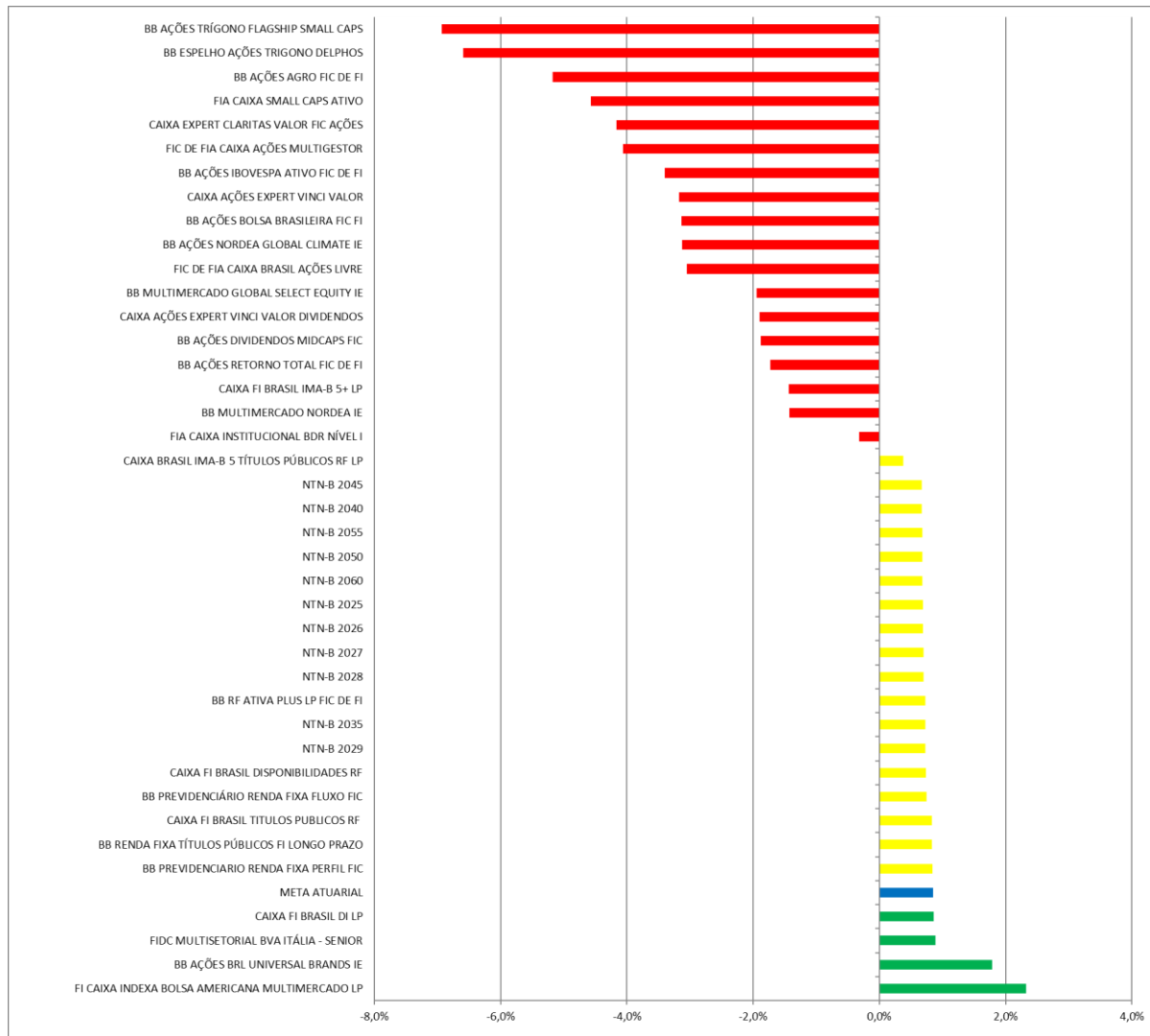
Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,84%. O fundo de renda fixa com gestão ativa rendeu 0,73%. O fundo IMA-B 5 teve um retorno de 0,38%. O fundo IMA-B 5+ teve retorno de -1,43%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade positiva de 0,89%. No dia 05 de setembro houve uma amortização no valor de R\$ 146.197,03 (cento e quarenta e seis mil e cento e noventa e sete reais e três centavos). Até 30/09/2024 foram resgatados o total de R\$ 10.278.352,70 (dez milhões e duzentos e setenta e oito mil e trezentos e cinquenta e dois reais e setenta centavos), mais de 100% do capital total investido. O saldo em 30 de setembro estava em R\$ 2.060.638,96 (dois milhões e sessenta mil e seiscentos e trinta e oito reais e noventa e seis 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 setembro da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 6.927.649,16 (seis milhões e novecentos e vinte e sete mil e seiscentos e quarenta e nove reais e dezesseis centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de setembro em R\$ 4.597.648.207,74 (quatro bilhões e quinhentos e noventa e sete milhões e seiscentos e quarenta e oito mil e duzentos e sete reais e setenta e quatro centavos).



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



**SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS**

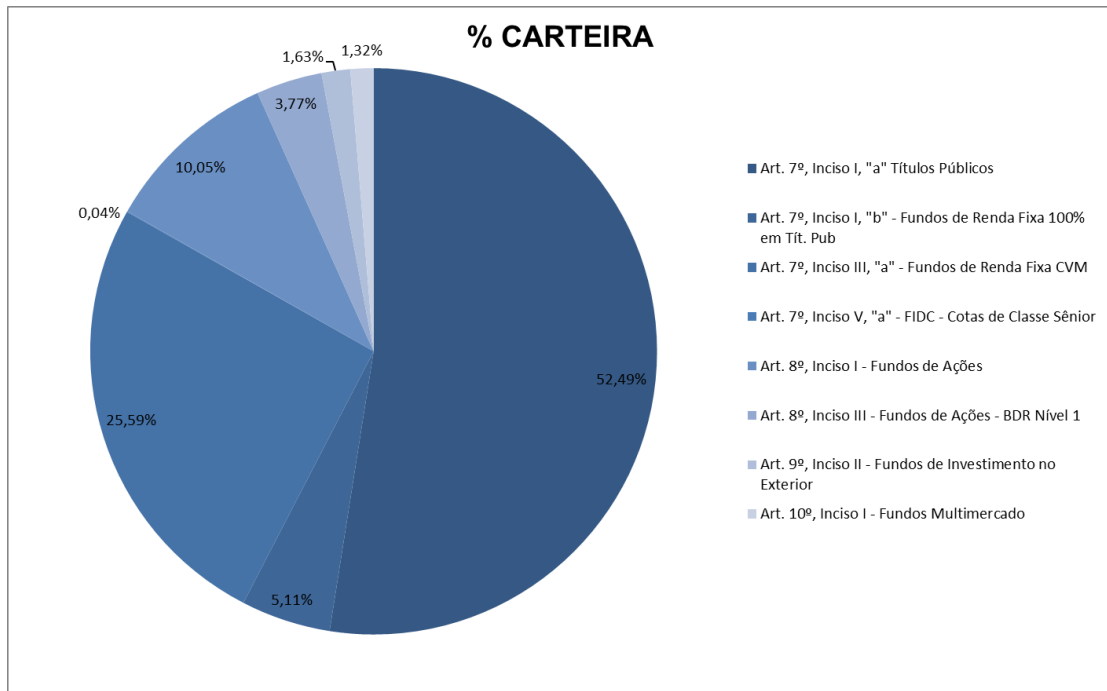
Fundo de Investimento	Saldo em 30/08/2024	Saldo em 30/09/2024	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$171,92	R\$290,02	R\$0,00	R\$118,10	0,74%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$121.849,90	R\$57.029,03	-R\$76.345,16	R\$11.524,29	0,75%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$2.188.485,55	R\$2.060.638,96	-R\$146.197,03	R\$18.350,44	0,89%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	R\$2.150.516,19	R\$2.168.432,97	R\$0,00	R\$17.916,78	0,83%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$4.898.245,12	R\$4.694.428,18	R\$0,00	-R\$203.816,94	-4,16%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$6.518.132,71	R\$6.572.422,05	R\$0,00	R\$54.289,34	0,83%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	R\$19.764.522,04	R\$18.462.056,41	R\$0,00	-R\$1.302.465,63	-6,59%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	R\$20.014.441,01	R\$18.627.709,17	R\$0,00	-R\$1.386.731,84	-6,93%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$22.322.385,58	R\$21.563.024,22	R\$0,00	-R\$759.361,36	-3,40%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	R\$22.714.293,79	R\$23.120.896,03	R\$0,00	R\$406.602,24	1,79%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$25.708.742,01	R\$24.379.218,41	R\$0,00	-R\$1.329.523,60	-5,17%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	R\$26.130.989,68	R\$25.303.742,27	R\$0,00	-R\$827.247,41	-3,17%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	R\$26.708.030,01	R\$25.874.899,52	R\$0,00	-R\$833.130,49	-3,12%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$32.976.419,25	R\$31.943.259,00	R\$0,00	-R\$1.033.160,25	-3,13%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	R\$48.852.613,62	R\$47.926.512,77	R\$0,00	-R\$926.100,85	-1,90%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$52.088.628,18	R\$49.706.193,99	R\$0,00	-R\$2.382.434,19	-4,57%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$50.875.103,24	R\$49.992.557,81	R\$0,00	-R\$882.545,43	-1,73%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$54.511.198,75	R\$52.295.725,95	R\$0,00	-R\$2.215.472,80	-4,06%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$56.930.057,29	R\$55.860.452,15	R\$0,00	-R\$1.069.605,14	-1,88%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$58.416.487,17	R\$57.585.293,98	R\$0,00	-R\$831.193,19	-1,42%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$59.180.996,48	R\$60.559.185,96	R\$0,00	R\$1.378.189,48	2,33%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$63.026.946,66	R\$61.104.578,76	R\$0,00	-R\$1.922.367,90	-3,05%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$67.971.662,31	R\$66.652.643,73	R\$0,00	-R\$1.319.018,58	-1,94%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$75.374.134,60	R\$75.129.653,36	R\$0,00	-R\$244.481,24	-0,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$81.702.021,38	R\$82.014.019,81	R\$0,00	R\$311.998,43	0,38%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2060	R\$87.987.867,17	R\$88.586.885,31	R\$0,00	R\$599.018,14	0,68%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2040	R\$100.923.940,87	R\$101.606.105,87	R\$0,00	R\$682.165,00	0,67%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	R\$146.405.740,94	R\$144.318.680,60	R\$0,00	-R\$2.087.060,34	-1,43%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2028	R\$151.083.582,87	R\$152.145.032,74	R\$0,00	R\$1.061.449,87	0,70%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2035	R\$152.319.967,86	R\$153.433.103,34	R\$0,00	R\$1.113.135,48	0,73%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2029	R\$152.335.917,88	R\$153.456.048,29	R\$0,00	R\$1.120.130,41	0,73%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2055	R\$189.935.922,15	R\$191.228.293,21	R\$0,00	R\$1.292.371,06	0,68%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	R\$199.159.492,41	R\$200.621.374,25	R\$0,00	R\$1.461.881,84	0,73%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2026	R\$203.672.283,20	R\$205.092.452,36	R\$0,00	R\$1.420.169,16	0,69%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2045	R\$274.173.220,79	R\$276.032.699,80	R\$0,00	R\$1.859.479,01	0,67%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2050	R\$291.980.561,76	R\$293.965.934,50	R\$0,00	R\$1.985.372,74	0,68%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$341.075.076,47	R\$343.992.079,41	R\$0,00	R\$2.917.002,94	0,86%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2027	R\$354.627.025,00	R\$357.119.134,86	R\$0,00	R\$2.492.109,86	0,70%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2025	R\$437.496.178,28	R\$440.515.027,49	R\$0,00	R\$3.018.849,21	0,69%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$624.206.248,68	R\$631.880.491,20	R\$2.413.000,00	R\$5.261.242,52	0,84%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$4.588.530.100,77</b>	<b>R\$4.597.648.207,74</b>	<b>R\$2.190.457,81</b>	<b>R\$6.927.649,16</b>	<b>0,15%</b>

#### 4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

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

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024								
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total	
<b>Art. 7º, Inciso I, "a" - Títulos Públicos</b>		<b>52,49%</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>Não se Aplica</b>	<b>R\$2.413.180.717,77</b>	
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	IPCA+	52,49%	100,00%	50,00%	100,00%	N/A	R\$2.413.180.717,77	
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub</b>		<b>5,11%</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$235.073.555,43</b>	
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	CDI	0,05%	100,00%	50,00%	100,00%	0,01%	R\$2.168.432,97	
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	0,14%	100,00%	50,00%	100,00%	0,06%	R\$6.572.422,05	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	1,78%	100,00%	50,00%	100,00%	1,19%	R\$82.014.019,81	
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	IMA-B 5+	3,14%	100,00%	50,00%	100,00%	12,35%	R\$144.318.680,60	
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>25,59%</b>	<b>65,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$1.176.551.263,91</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	13,74%	65,00%	65,00%	20,00%	3,15%	R\$631.880.491,20	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$57.029,03	
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	CDI	4,36%	65,00%	65,00%	20,00%	4,97%	R\$200.621.374,25	
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	7,48%	65,00%	65,00%	20,00%	1,80%	R\$343.992.079,41	
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$290,02	
<b>Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior</b>		<b>0,04%</b>	<b>5,00%</b>	<b>0,20%</b>	<b>20,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>R\$2.060.638,96</b>	
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,04%	5,00%	0,20%	20,00%	3,64%	R\$2.060.638,96	
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>10,05%</b>	<b>35,00%</b>	<b>25,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$461.859.459,09</b>	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,47%	35,00%	25,00%	20,00%	15,77%	R\$21.563.024,22	X
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,69%	35,00%	25,00%	20,00%	15,74%	R\$31.943.259,00	X
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,53%	35,00%	25,00%	20,00%	11,95%	R\$24.379.218,41	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,09%	35,00%	25,00%	20,00%	7,06%	R\$49.992.557,81	
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	1,21%	35,00%	25,00%	20,00%	6,89%	R\$55.860.452,15	
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	IDIV	0,40%	35,00%	25,00%	20,00%	11,13%	R\$18.462.056,41	
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	SMLL	0,41%	35,00%	25,00%	20,00%	38,72%	R\$18.627.709,17	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	IBOVESPA	0,55%	35,00%	25,00%	20,00%	3,36%	R\$25.303.742,27	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	IDIV	1,04%	35,00%	25,00%	20,00%	4,50%	R\$47.926.512,77	
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,10%	35,00%	25,00%	20,00%	17,36%	R\$4.694.428,18	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,08%	35,00%	25,00%	20,00%	8,48%	R\$49.706.193,99	
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,14%	35,00%	25,00%	20,00%	9,87%	R\$52.295.725,95	
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,33%	35,00%	25,00%	20,00%	8,76%	R\$61.104.578,76	
<b>Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>1,63%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$75.129.653,36</b>	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL 1	BDRX	1,63%	10,00%	10,00%	20,00%	2,85%	R\$75.129.653,36	
<b>Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior</b>		<b>3,77%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$173.233.733,26</b>	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	1,45%	10,00%	10,00%	20,00%	4,09%	R\$66.652.643,73	
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	MSCI WORLD	0,56%	10,00%	10,00%	20,00%	7,67%	R\$25.874.899,52	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	MSCI WORLD	0,50%	10,00%	10,00%	20,00%	11,41%	R\$23.120.896,03	
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	1,25%	10,00%	10,00%	20,00%	39,22%	R\$57.585.293,98	
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>1,32%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$60.559.185,96</b>	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,32%	10,00%	10,00%	20,00%	2,98%	R\$60.559.185,96	
<b>Total:</b>							<b>R\$4.597.648.207,74</b>	

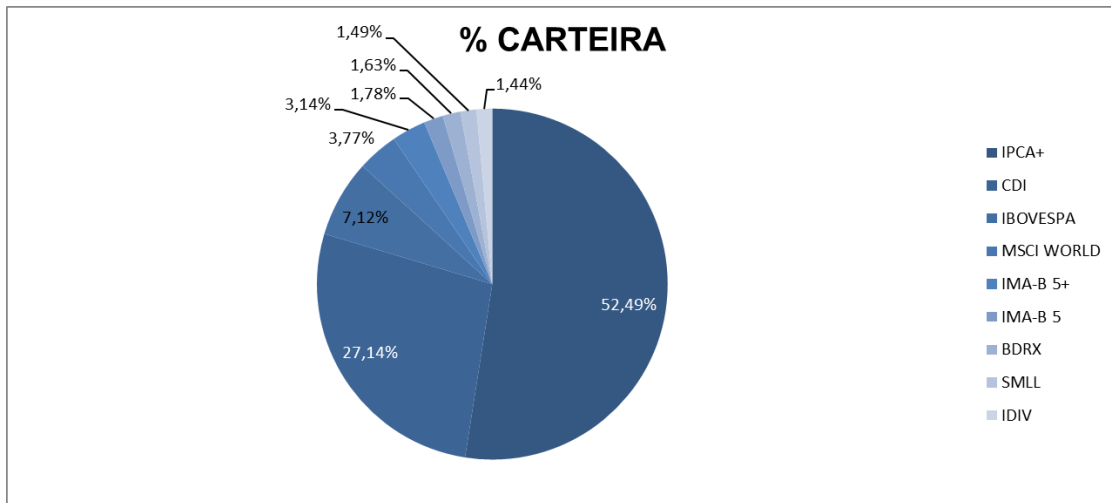




#### 4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

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

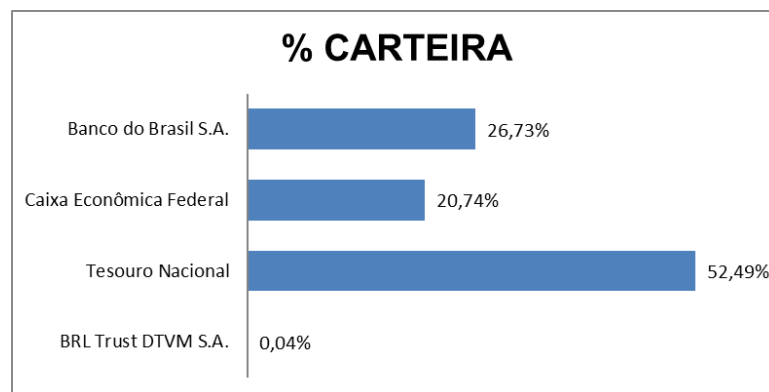
Indicador	Saldo em 30/09/2024	Participação
IPCA+	R\$2.413.180.717,77	52,49%
CDI	R\$1.247.911.943,85	27,14%
IBOVESPA	R\$327.136.986,75	7,12%
MSCI WORLD	R\$173.233.733,26	3,77%
IMA-B 5+	R\$144.318.680,60	3,14%
IMA-B 5	R\$82.014.019,81	1,78%
BDRX	R\$75.129.653,36	1,63%
SMLL	R\$68.333.903,16	1,49%
IDIV	R\$66.388.569,18	1,44%
<b>Total</b>	<b>R\$4.597.648.207,74</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\$2.060.638,96	0,04%
Tesouro Nacional	R\$2.413.180.717,77	52,49%
Caixa Econômica Federal	R\$953.617.513,13	20,74%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.228.789.337,88	26,73%





## 5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

### MOVIMENTAÇÕES

APLICAÇÕES		
Data	Valor	
02/09/2024	R\$108.500,35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
03/09/2024	R\$650.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
04/09/2024	R\$41.513,82	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
05/09/2024	R\$166.860,32	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
06/09/2024	R\$288,37	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
06/09/2024	R\$3.011,50	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
09/09/2024	R\$298.260,21	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
10/09/2024	R\$1.119,24	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
11/09/2024	R\$611,88	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
12/09/2024	R\$4.556.446,58	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
13/09/2024	R\$5.897,67	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/09/2024	R\$229,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
17/09/2024	R\$21.850,52	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
18/09/2024	R\$741,02	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
19/09/2024	R\$5.150.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
24/09/2024	R\$1.134,93	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
25/09/2024	R\$1.020.424,28	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
26/09/2024	R\$33.328,07	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
27/09/2024	R\$2.704,04	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

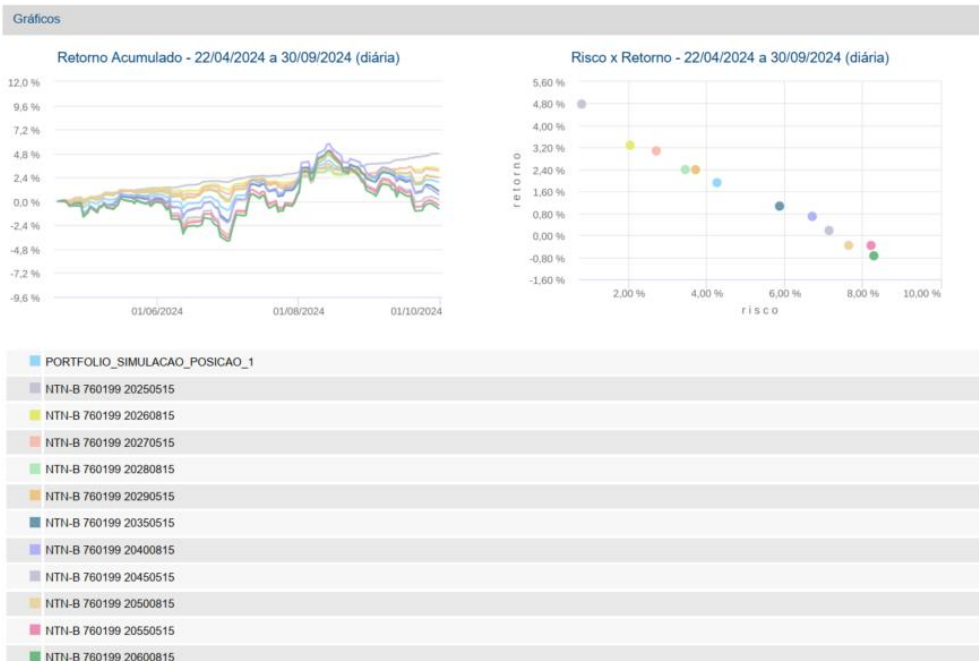
RESGATES		
Data	Valor	Ativo
03/09/2024	R\$650.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
05/09/2024	R\$288,37	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
05/09/2024	R\$329.694,31	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
19/09/2024	R\$5.133.139,60	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
25/09/2024	R\$2.087.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
30/09/2024	R\$1.054.228,92	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

TOTAL DAS AMORTIZAÇÕES	
Fidc Italia	R\$146.197,03

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$12.062.922,10
Resgates	-R\$9.254.351,20
Saldo	R\$2.808.570,90

## 6. MONITORAMENTO DE RISCOS

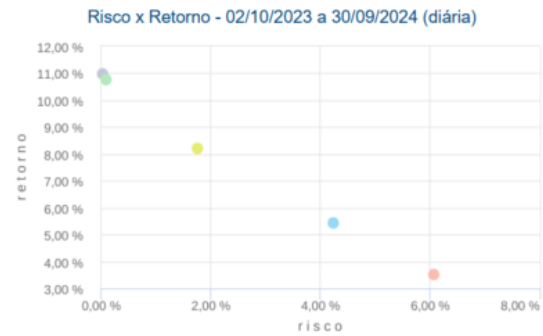
### 6.1. ART. 7º, INCISO I, "A" – TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOURO NACIONAL





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

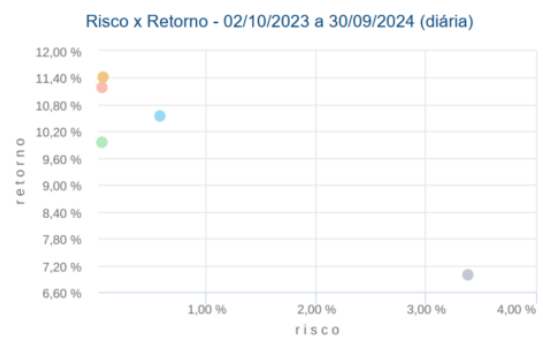
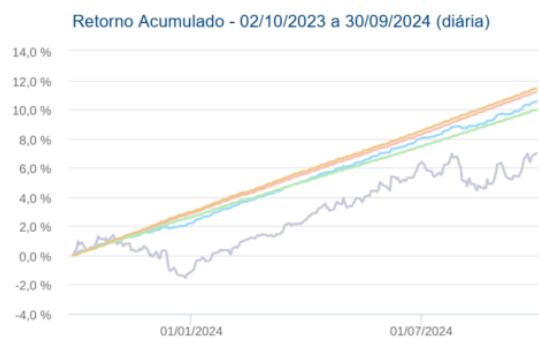
### Gráficos



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
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

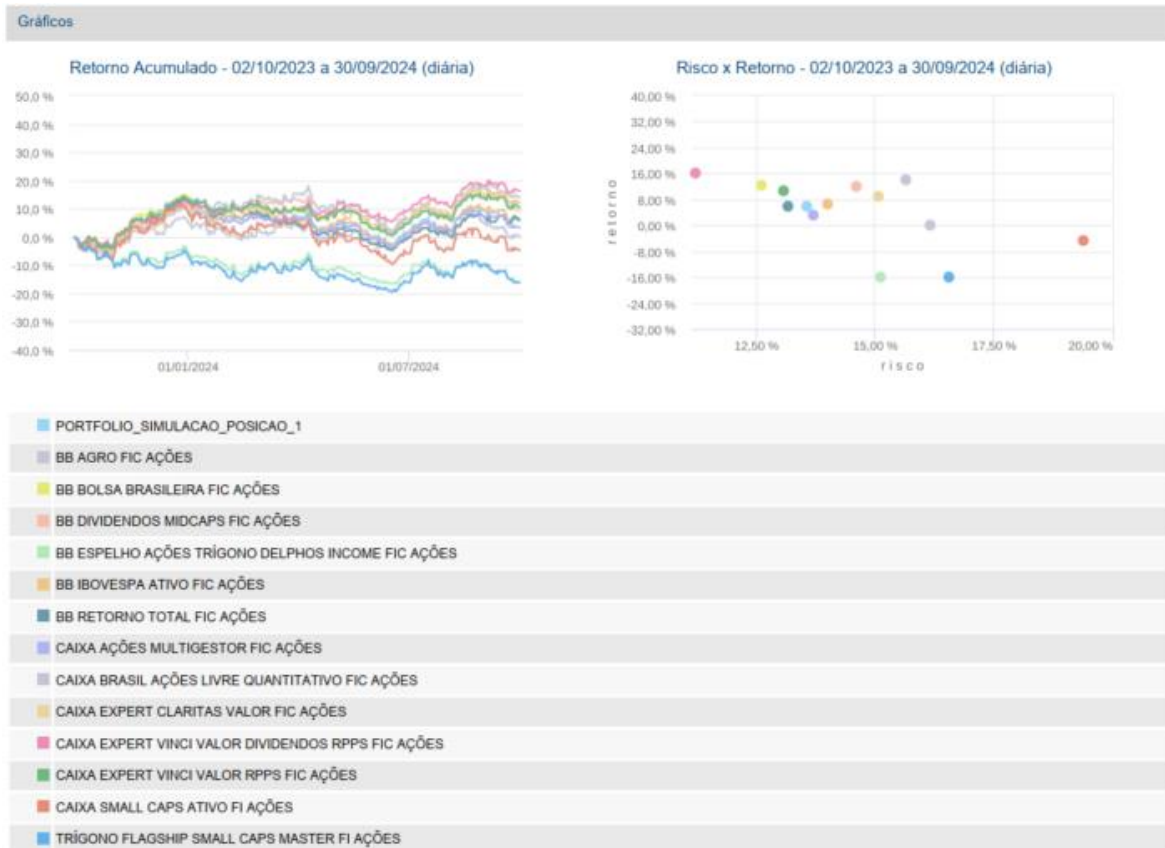
## 6.3. ART. 7º, INCISO III, “A” – FUNDOS DE RENDA FIXA CVM

### 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 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	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,99%	
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,83%	7,97%	2,63%	5,21%	10,99%	25,88%	0,03%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,83%	7,77%	2,64%	5,08%	10,77%	25,55%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,84%	8,11%	2,73%	5,33%	11,17%	26,08%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	0,75%	7,19%	2,38%	4,70%	9,96%	23,52%	0,03%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	0,73%	8,36%	0,82%	4,68%	6,99%	21,54%	0,34%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,86%	8,25%	2,74%	5,38%	11,42%	26,66%	0,03%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,75%	7,17%	2,36%	4,69%	9,95%	22,88%	0,03%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	-5,84%	-5,11%	-3,78%	-6,73%	160,77%	156,48%	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	2,33%	24,07%	6,32%	11,65%	40,19%	81,31%	1,26%
IMA-B 5	0,40%	5,30%	1,92%	3,18%	8,43%	21,06%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	0,38%	5,06%	1,80%	3,00%	8,13%	20,47%	0,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,38%	5,14%	1,87%	3,07%	8,21%	20,61%	0,18%
IMA-B	-0,67%	0,82%	1,94%	0,64%	5,61%	17,28%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	-0,69%	0,63%	1,88%	0,50%	5,37%	16,71%	0,43%
IMA-B 5+	-1,42%	-2,62%	2,55%	-1,13%	3,64%	14,16%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	-1,43%	-2,71%	2,50%	-1,20%	3,52%	13,61%	0,61%
IBOVESPA	-3,08%	-1,77%	5,69%	3,80%	14,57%	13,50%	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	-3,40%	-6,33%	6,44%	-0,71%	6,47%	10,58%	1,40%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	-3,13%	-2,26%	6,21%	2,54%	12,32%	18,34%	1,38%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	-5,17%	-6,38%	-0,77%	-4,40%	0,22%	3,52%	1,66%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	-1,74%	-6,42%	7,13%	0,67%	6,02%	2,69%	1,43%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	-1,88%	0,54%	6,79%	-1,44%	12,01%	25,23%	1,18%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	-3,17%	-3,36%	5,99%	0,22%	10,50%	11,68%	1,34%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	-4,16%	-1,78%	4,08%	-1,54%	9,05%	9,65%	1,48%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	-4,06%	-6,56%	3,12%	-3,79%	3,20%	4,83%	1,44%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	-3,05%	-0,39%	6,95%	-1,23%	13,96%	26,32%	1,54%
IDIV	-0,71%	4,25%	7,54%	8,57%	20,34%	29,45%	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	-1,90%	3,18%	6,80%	5,64%	16,25%	27,82%	1,11%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	-6,59%	-13,20%	-3,08%	-8,28%	-15,98%	0,00%	1,61%
SMLL	-4,38%	-13,65%	1,45%	-9,13%	-1,98%	-11,16%	
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	-6,93%	-11,91%	-0,86%	-7,20%	-16,54%		1,56%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-4,57%	-14,25%	1,02%	-10,43%	-4,77%	-7,85%	1,95%
BDRX	3,61%	26,15%	1,57%	12,55%	40,75%	80,91%	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,32%	40,56%	0,75%	22,25%	51,31%	81,77%	1,91%
MSCI WORLD	1,69%	17,48%	4,51%	9,19%	30,36%	54,88%	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	-1,94%	32,74%	0,97%	16,90%	43,66%	66,83%	1,50%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	-3,12%	24,86%	2,18%	13,11%	31,95%	36,51%	1,46%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	1,79%	11,69%	7,65%	6,61%	21,09%	45,78%	0,58%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	-1,42%	23,17%	7,58%	15,57%	26,44%	37,76%	1,23%
MSCI ACWI	2,17%	17,16%	4,79%	9,51%	29,70%	52,18%	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	1,69%	17,07%	5,09%	8,16%	26,77%	52,75%	1,26%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	2,15%	20,33%	4,39%	10,62%	33,97%	56,50%	
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,17%	31,57%	1,07%	15,48%	41,58%	63,92%	1,67%
S&P 500	2,02%	20,81%	5,25%	9,89%	34,37%	56,66%	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	2,30%	22,74%	5,59%	11,03%	37,64%	69,92%	1,30%



## 8. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

### 8.1. RENTABILIDADE

A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,59% no mês de setembro, totalizando um saldo de R\$ 245.915.471,04 (duzentos e quarenta e cinco milhões e novecentos e quinze mil e quatrocentos e setenta e um reais e quatro centavos).

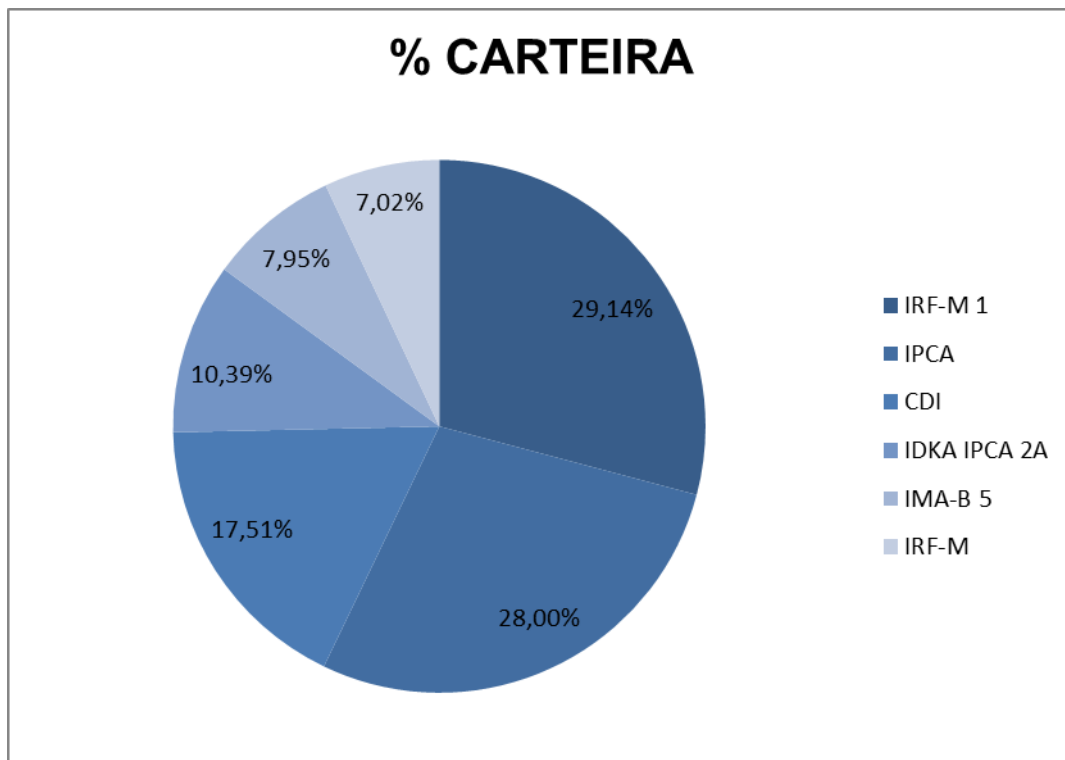
### 8.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024											
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução		% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS		% Participação no PL do Fundo		Total	
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub</b>		54,49%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$134.006.006,91
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	IRF-M 1	29,04%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,86%	✓	R\$71.422.505,73
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	0,09%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,00%	✓	R\$231.225,14
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2A	10,39%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,51%	✓	R\$25.539.845,56
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	7,95%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,42%	✓	R\$19.542.649,14
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	IRF-M	7,02%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,51%	✓	R\$17.269.781,34
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		33,33%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$81.972.230,50
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COT	CDI	5,19%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$12.760.661,17
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	CDI	0,14%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,01%	✓	R\$353.296,82
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,00%	✓	R\$1.499,22
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	28,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	1,12%	✓	R\$68.856.773,29
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		12,17%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$29.937.233,63
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,17%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	2,47%	✓	R\$29.937.233,63
<b>Total:</b>										<b>R\$245.915.471,04</b>	

### 8.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

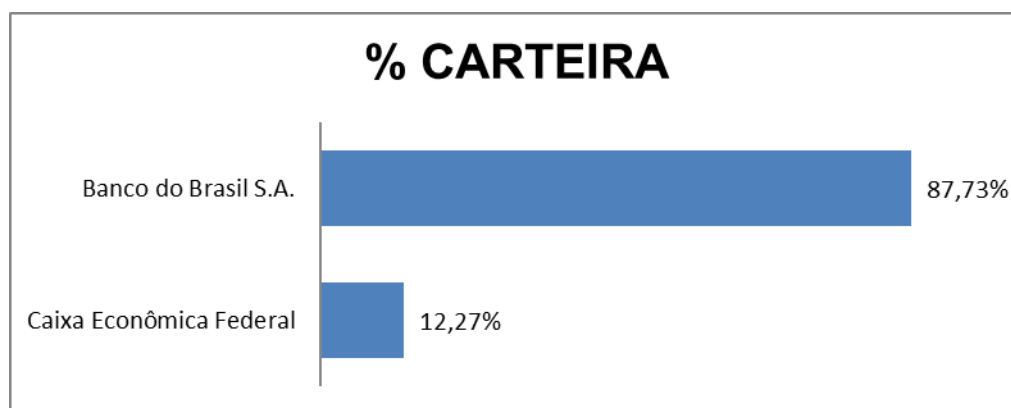
Indicador	Saldo em 30/09/2024	Participação
IRF-M 1	R\$71.653.730,87	29,14%
IPCA	R\$68.856.773,29	28,00%
CDI	R\$43.052.690,84	17,51%
IDKA IPCA 2A	R\$25.539.845,56	10,39%
IMA-B 5	R\$19.542.649,14	7,95%
IRF-M	R\$17.269.781,34	7,02%
	<b>R\$245.915.471,04</b>	<b>100,00%</b>



#### 8.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$30.169.957,99	12,27%
Banco do Brasil S.A.	R\$215.745.513,05	87,73%



## 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 0,24% e fechou o mês com o saldo de R\$ 29.682.429,86 (vinte e nove milhões e seiscentos e oitenta e dois mil e quatrocentos e vinte e nove reais e oitenta e seis centavos).

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

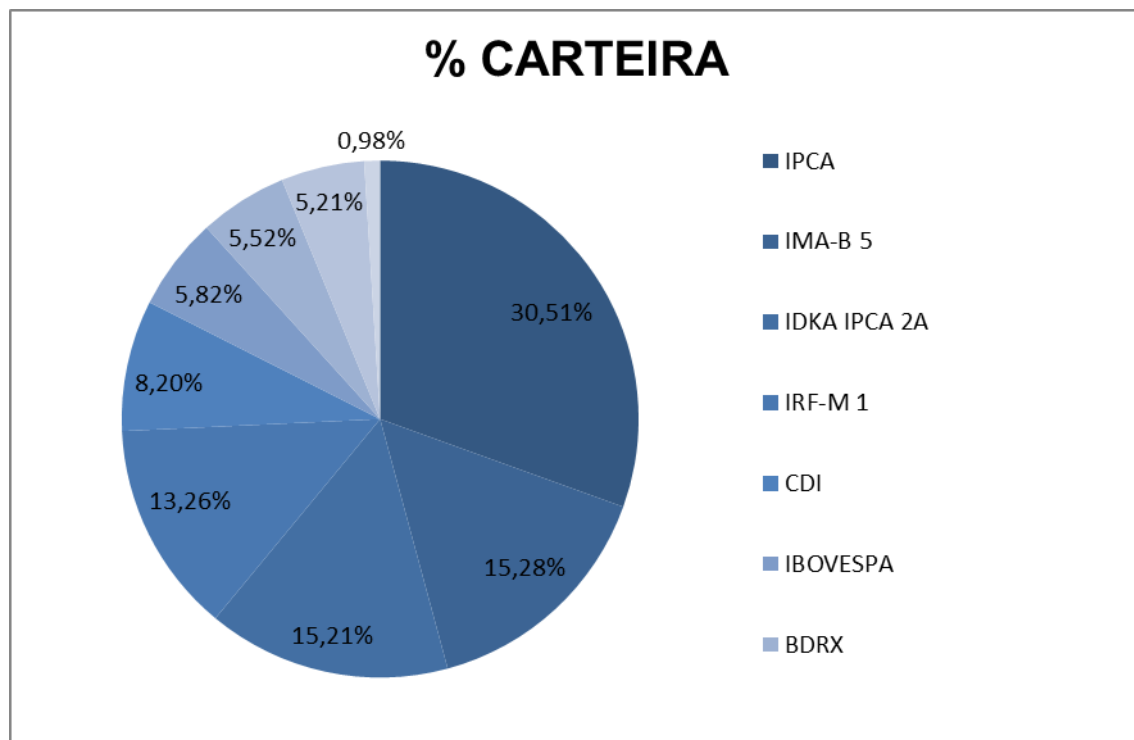
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024										
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total			
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub</b>		<b>58,67%</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$17.415.874,20</b>	✓	✓	✓
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	6,55%	100,00%	50,00%	100,00%	0,02%	R\$1.942.975,55	✓	✓	✓
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	6,71%	100,00%	50,00%	100,00%	0,02%	R\$1.992.691,45	✓	✓	✓
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	15,21%	100,00%	50,00%	100,00%	0,11%	R\$4.514.385,39	✓	✓	✓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	15,28%	100,00%	50,00%	100,00%	0,10%	R\$4.534.643,82	✓	✓	✓
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	14,93%	100,00%	50,00%	100,00%	0,10%	R\$4.431.177,99	✓	✓	✓
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>15,58%</b>	<b>65,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$4.625.849,33</b>	✓	✓	✓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,58%	65,00%	65,00%	20,00%	0,08%	R\$4.625.849,33	✓	✓	✓
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>6,81%</b>	<b>35,00%</b>	<b>25,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$2.019.909,38</b>	✓	✓	✓
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	IBOVESPA	1,54%	35,00%	25,00%	20,00%	0,06%	R\$456.447,98	✓	✓	✓
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,17%	35,00%	25,00%	20,00%	0,05%	R\$346.423,82	✓	✓	✓
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,80%	35,00%	25,00%	20,00%	0,08%	R\$535.150,59	✓	✓	✓
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,31%	35,00%	25,00%	20,00%	0,07%	R\$390.110,79	✓	✓	✓
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	0,98%	35,00%	25,00%	20,00%	0,05%	R\$291.776,20	✓	✓	✓
<b>Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>10,74%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$3.187.018,14</b>	✓	✓	✓
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	5,21%	10,00%	10,00%	20,00%	0,10%	R\$1.547.172,84	✓	✓	✓
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	5,52%	10,00%	10,00%	20,00%	0,06%	R\$1.639.845,30	✓	✓	✓
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>8,20%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$2.433.778,81</b>	✓	✓	✓
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	2,54%	10,00%	10,00%	20,00%	0,73%	R\$755.059,69	✓	✓	✓
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,48%	10,00%	10,00%	20,00%	0,39%	R\$735.208,20	✓	✓	✓
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	3,18%	10,00%	10,00%	20,00%	0,05%	R\$943.510,92	✓	✓	✓
<b>Total:</b>							<b>R\$29.682.429,86</b>			



### 9.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/09/2024	Participação
IPCA	R\$9.057.027,32	30,51%
IMA-B 5	R\$4.534.643,82	15,28%
IDKA IPCA 2A	R\$4.514.385,39	15,21%
IRF-M 1	R\$3.935.667,00	13,26%
CDI	R\$2.433.778,81	8,20%
IBOVESPA	R\$1.728.133,18	5,82%
BDRX	R\$1.639.845,30	5,52%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.547.172,84	5,21%
SMLL	R\$291.776,20	0,98%
	<b>R\$29.682.429,86</b>	<b>100,00%</b>

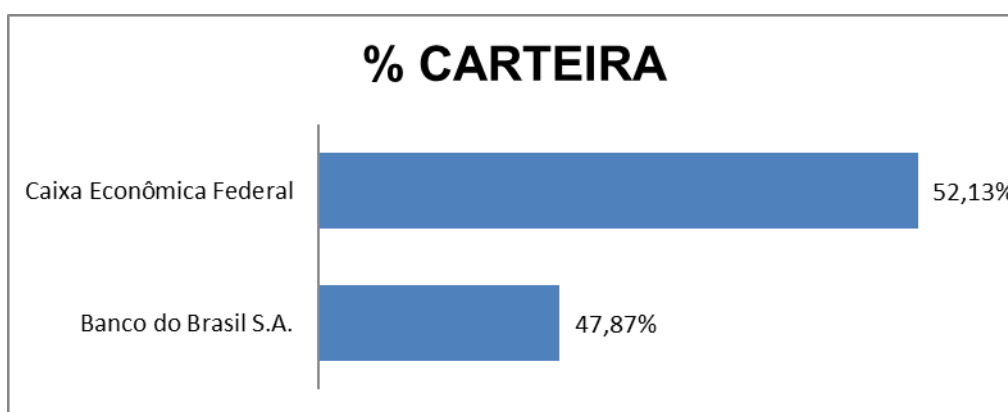




#### 9.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$14.208.573,03	47,87%
Caixa Econômica Federal	R\$15.473.856,83	52,13%



## 10. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

### 10.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de 0,29% e fechou o mês com o saldo de R\$ 21.215.262,26 (vinte e um milhões e duzentos e quinze mil e duzentos e sessenta e dois reais e vinte e seis 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 Tit. Pub		100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$21.215.262,26
BB Vert 2027 II	IPCA+5%	100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	2,41% ✓	R\$21.215.262,26
<b>Total:</b>							<b>R\$21.215.262,26</b>

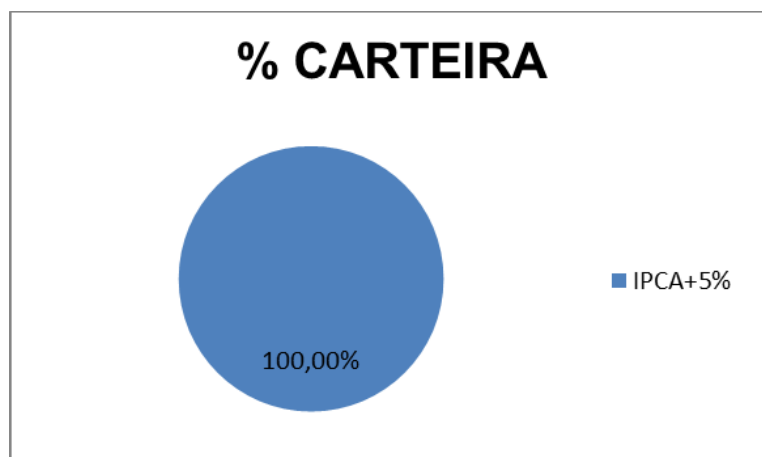




10.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

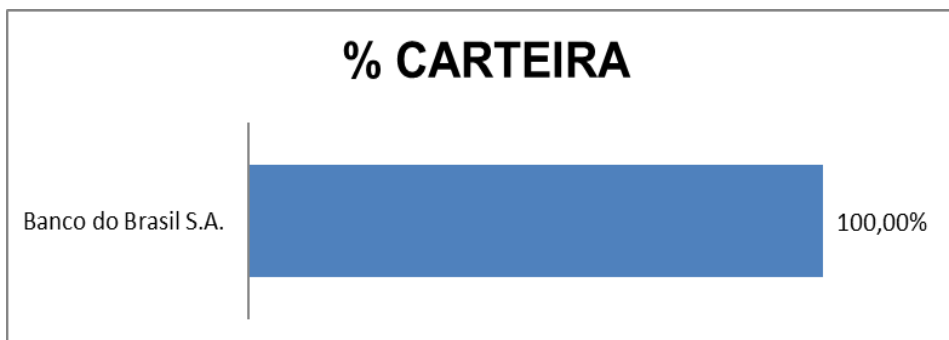
Indicador	Saldo em 30/09/2024	Participação
IPCA+5%	R\$21.215.262,26	100,00%
	<b>R\$21.215.262,26</b>	<b>100,00%</b>



10.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$21.215.262,26	100,00%





## 11. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023

### 11.1. RENTABILIDADE

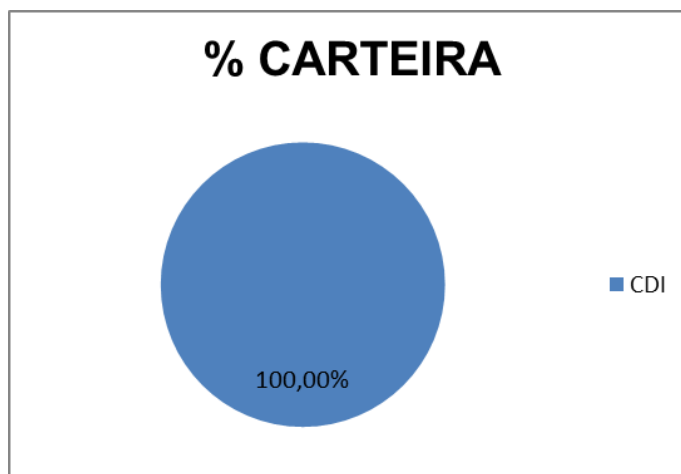
A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um resultado de 0,29% e fechou o mês com o saldo de R\$ 36.126.601,03 (trinta e seis milhões e cento e vinte e seis mil e seiscentos e um reais e três centavos).

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

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024									
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total		
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$36.126.601,03		
BB Vert 2027 II	IPCA+5%	100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	4,11% ✓	R\$36.126.601,03		
<b>Total:</b>							<b>R\$36.126.601,03</b>		

### 11.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

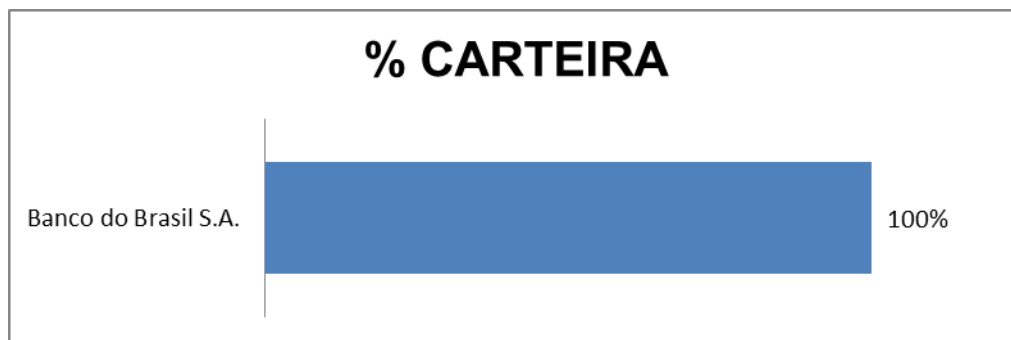
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 30/09/2024	Participação
IPCA+5%	R\$36.126.601,03	100,00%
	<b>R\$36.126.601,03</b>	<b>100,00%</b>





#### 11.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$36.126.601,03	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 -0,11% e fechou o mês com o saldo de R\$ 41.657.607,57 (quarenta e um milhões e seiscentos e cinquenta e sete mil e seiscentos e sete reais e cinquenta e sete centavos).

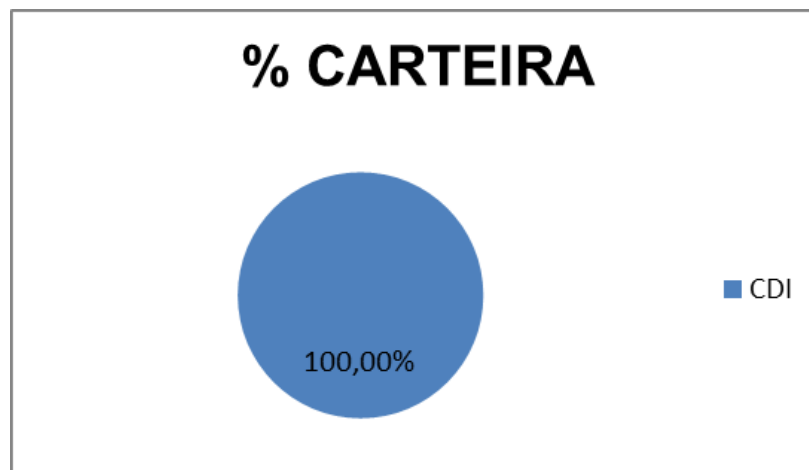
#### 12.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024											
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução		% Limite PAI 2024		% Limite dos Recursos do RPPS		% Participação no PL do Fundo		Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		100,00%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$41.657.607,57
BB Prev Vert 2029	IPCA+5%	100,00%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	17,08%	✓	R\$41.657.607,57
<b>Total: R\$41.657.607,57</b>											



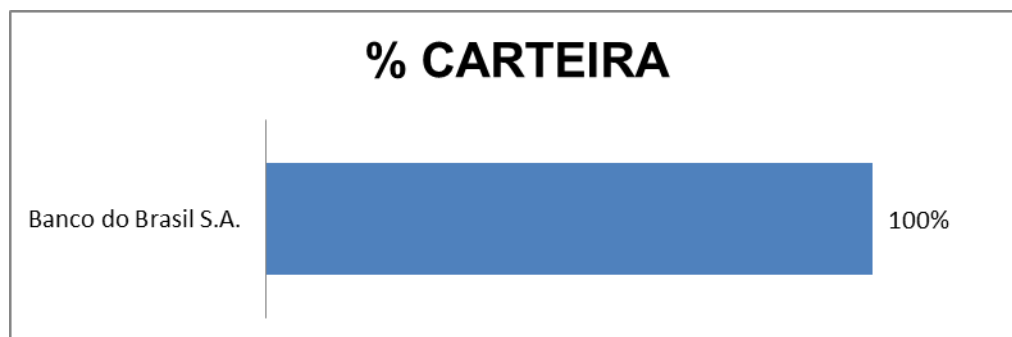
### 12.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 30/09/2024	Participação
IPCA+5%	R\$41.657.607,57	100,00%
	<b>R\$41.657.607,57</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\$41.657.607,57	100%





### 13. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES

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

CUSTOS DOS FUNDOS		
Fundo de Investimento	Taxa de Administração	Taxa de Performance
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	1,00%	20% do que excede 100% do Ibovespa
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1,00%	10% do que excede 100% do S&P 500
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	1,00%	10% do que excede 100% do MSCI ACWI
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	2,00%	0,00%
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	0,50%	0,00%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	1,00%	0,00%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	1,00%	0,00%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	2,00%	0,00%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	0,08%	0,00%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	0,08%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	2,00%	20% do que excede 100% do Ibovespa
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	1,00%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	0,20%	0,00%
BB Vert 2027 II	0,07%	0,00%
BB Prev Vert 2029	0,07%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	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 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

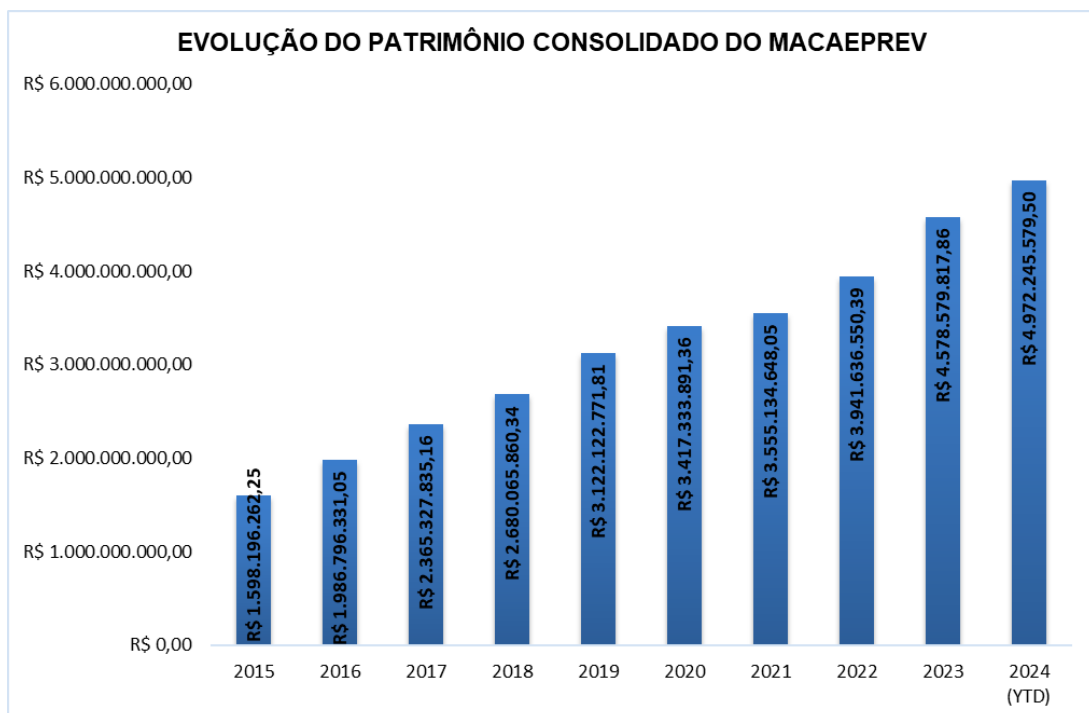
<b>CUSTOS SELIC</b>		
<b>Ativos</b>	<b>Patrimônio (R\$)</b>	<b>SELIC</b>
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	R\$ 2.413.180.717,77	R\$ 6.754,41





## 14. CONCLUSÃO

O Macaeprev encerrou o mês de setembro de 2024 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 4.972.245.579,50 (quatro bilhões e novecentos e sessenta e dois milhões e cento noventa e sete mil e quarenta e nove reais e cinco centavos). O gráfico a seguir apresenta a evolução patrimonial do Macaeprev a cada final de exercício.



Macaé, 23 de outubro de 2024.

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



## PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e três dias do mês de outubro 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 **setembro** de 2024;

Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos que segue na íntegra na ata do dia de hoje: **23 de outubro de 2024**.

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

COMITÊ DE INVESTIMENTOS:

  
Alfredo Tanos Filho

  
Erenildo Motta da Silva Júnior

  
José Eduardo da Silva Guinâncio

  
Patric Alves de Vasconcellos

  
Claudio de Freitas Duarte

  
Fábio de Carvalho de Moraes Drumond

  
Miriam Amaral Queiroz

  
Viviane da Silva Lourenço Campos



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

**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**




**SETEMBRO DE 2024**

**TERMO DE APROVAÇÃO CONSELHO FISCAL**

Ao dia **21/01/2025**, 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 **SETEMBRO DE 2024**. Considerando todas as informações constantes no presente relatório, **APROVAMOS** o relatório de investimentos referente à **SETEMBRO DE 2024**.

*Macaé, 21 de janeiro de 2025.*

**CONSELHO FISCAL**

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