



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



1 **ATA n.º 43/2024 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 20/09/2024** – Ata de Reunião
2 Extraordinária do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Social do Município
3 de Macaé – MACAEPREV, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, sediado à Rua
4 Tenente Rui Lopes Ribeiro, duzentos e noventa e três, Centro, Macaé, Rio de Janeiro,
5 realizada às dezessete horas do dia vinte de setembro de dois mil e vinte e quatro, estando
6 presentes os membros, **Alfredo Tanos Filho, Claudio de Freitas Duarte, Erenildo Motta da**
7 **Silva Júnior e José Eduardo da Silva Guinâncio**, instituídos através da portaria de nomeação
8 n.º 289/2021, os membros, **Miriam Amaral Queiroz e Patric Alves de Vasconcellos**
9 instituídos através da portaria n.º 306/2022, o membro **Viviane da Silva Lourenço Campos**
10 instituída através da portaria n.º 1.707/2022 e o membro **Fábio Carvalho de Moraes**
11 **Drumond** instituído através da portaria n.º 0685/2023. Iniciada a reunião, realizada de forma
12 on-line, através da plataforma Google Meets, sendo tratados os seguintes assuntos: **I –**
13 **SUPERQUARTA**: O Comitê de Mercado Aberto do Federal Reserve, o Fomc, decidiu cortar
14 o juro básico dos Estados Unidos em 0,50 ponto porcentual, de 5,25% a 5,50% para 4,75% a
15 5,00%, o primeiro corte desde o início da pandemia de coronavírus, em 2020. A decisão não
16 foi unânime, com um voto, da dirigente do Fomc, Michelle Bowman, votando por um corte
17 menor, de 0,25 ponto porcentual. O Fomc também divulgou novas projeções de seus
18 dirigentes para a economia, o chamado “dot plots”, reduzindo as projeções para os juros no
19 fim dos próximos anos, assim como para a inflação e atividade, e elevando a estimativa de
20 taxa de desemprego. Em relação às projeções feitas na reunião de junho, o Fomc mudou a
21 estimativa mediana para a taxa básica no fim deste ano de 5,1% para 4,4%. Para o fim de
22 2025, a estimativa passou de 4,1% para 3,4%, para 2026, de 3,1% para 2,9% e para 2027, o
23 Fed passou a projetar 2,9%. No longo prazo, a taxa estimada subiu de 2,8% para 2,9%. Para a
24 inflação do gasto do consumo pessoal, o PCE, referencial das metas do banco central
25 americano, o Fed alterou a projeção deste ano de 2,6% para 2,3%. Para 2025, a projeção do
26 PCE passou de 2,3% para 2,1% e para 2026, foi mantida em 2,0%, assim como para 2027. A
27 estimativa para o núcleo do PCE deste ano passou de 2,8% para 2,6%, para 2025, de 2,3%
28 para 2,2% e ficou estável em 2,0% para 2026 e para 2027. A estimativa para o crescimento do
29 PIB americano passou de 2,1% para 2,0% para este ano e foi mantida em 2,0% para 2025,
30 2026 e fixada no mesmo porcentual para 2027. A taxa de desemprego estimada para este ano



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



31 passou de 4,0% para 4,4%, de 4,2% para 4,4% para 2025 e de 4,1% para 4,3% para 2026. Do
32 total de 19 dirigentes do Fed, a maioria, 9, agora vê o juro básico entre 4,25% e 4,50% no fim
33 deste ano. Sete acham que o juro fecha 2024 entre 4,5% e 4,75%, dois entre 4,75% e 5,00% e
34 apenas um vê o juro entre 4,00% e 4,25%. Para o ano que vem, a maioria, ou 14 diretores,
35 veem o juro entre 3,25% e 3,5% ou abaixo disso. No Brasil, o Comitê de Política Monetária, o
36 Copom, decidiu subir a taxa básica de juros de 10,50% para 10,75%, a primeira alta dos juros
37 no governo do presidente Luiz Inácio Lula da Silva, e indicou novas altas, afirmando que o
38 “ritmo de ajustes futuros na taxa de juros e a magnitude total do ciclo ora iniciado serão
39 ditados pelo firme compromisso de convergência da inflação à meta”. A decisão foi unânime.
40 O Comitê citou o crescimento acima do esperado da economia e reavaliou o hiato do produto
41 de neutro para o campo positivo. Citou ainda o mercado de trabalho aquecido, a inflação
42 medida pelo IPCA cheio assim como as medidas subjacentes acima da meta e as expectativas
43 de inflação mais longas desancoradas e a alta do dólar como motivos para subir os juros. O
44 Copom também mudou as projeções de inflação para o chamado horizonte relevante, de seis
45 trimestres à frente, que coincide com o primeiro trimestre de 2026, de 3,4% em julho para
46 3,5% agora e citou uma “assimetria altista” em seu balanço de riscos para a inflação. Sem
47 prejuízo de seu objetivo fundamental de assegurar a estabilidade de preços, essa decisão
48 também implica suavização das flutuações do nível de atividade econômica e fomento do
49 pleno emprego. O Comitê monitora com atenção como os desenvolvimentos recentes da
50 política fiscal impactam a política monetária e os ativos financeiros. A percepção dos agentes
51 econômicos sobre o cenário fiscal, junto com outros fatores, tem impactado os preços de
52 ativos e as expectativas dos agentes. O Comitê reafirma que uma política fiscal crível e
53 comprometida com a sustentabilidade da dívida contribui para a ancoragem das expectativas
54 de inflação e para a redução dos prêmios de risco dos ativos financeiros, consequentemente
55 impactando a política monetária. O ambiente externo permanece desafiador, em função do
56 momento de inflexão do ciclo econômico nos Estados Unidos, o que suscita maiores dúvidas
57 sobre os ritmos da desaceleração, da desinflação e, consequentemente, sobre a postura do Fed.
58 O Comitê avalia que o cenário externo, também marcado por menor sincronia nos ciclos de
59 política monetária entre os países, segue exigindo cautela por parte de países emergentes. Em
60 relação ao cenário doméstico, o conjunto dos indicadores de atividade econômica e do

2

[Handwritten signatures and initials]



61 mercado de trabalho tem apresentado dinamismo maior do que o esperado, o que levou a uma
62 reavaliação do hiato para o campo positivo: **II - INCORPORAÇÃO DO BB AÇÕES**
63 **RETORNO TOTAL PELO BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO:** Em continuidade ao assunto
64 discutido na Ata nº 36/2024, de 12 de agosto de 2024, informo que foi aprovada pela
65 assembleia de cotistas a incorporação do fundo BB Ações Retorno Total FIC FI, CNPJ
66 09.005.805/0001-00 pelo fundo BB Ações Ibovespa Ativo FIC FI, CNPJ 00.822.059/0001-65,
67 conforme resultado a seguir. Cabe ressaltar que a incorporação será realizada em 24 de
68 outubro de 2024.



Resultado Consulta Formal

Prezado(a) investidor(a),

A BB ASSET, prezando pela sua experiência como cliente, comunica o resultado do processo de consulta formal aos cotistas do fundo **BB AÇÕES RETORNO TOTAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO**, CNPJ: 09.005.805/0001-00, encerrado às 17 horas do dia 30 de agosto de 2024.

RESULTADO: Foram aprovados os seguintes itens:

- Incorporação do **BB AÇÕES RETORNO TOTAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO** pelo **BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO**, CNPJ. 00.822.059/0001-65;
- Alteração do Artigo 2º que trata do Objetivo do fundo, para adequação ao objetivo do Fundo Incorporador;
- Alteração do Artigo 3º que trata do público-alvo, para adequação ao público-alvo do Fundo Incorporador;
- Alteração da Política de Investimento, para adequação à Política de Investimento do Fundo Incorporador;
- Alteração dos Fatores de Risco, no Artigo 13, para adequação aos Fatores de Risco do Fundo Incorporador;
- Renumeração de artigos e parágrafos.

A minuta do novo regulamento está disponível para consulta no endereço eletrônico www.bb.com.br/investimentos e em sua agência de relacionamento. Informamos que o novo regulamento estará vigente a partir do dia **15 de outubro de 2024**.

A incorporação será realizada em **24 de outubro de 2024**.

Para mais informações acesse www.bbasset.com.br

Rio de Janeiro, 02 de setembro de 2024.

BB Asset Management
Administradora





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



**ATA DO PROCESSO DE CONSULTA FORMAL AOS COTISTAS DO
BB Ações Retorno Total Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento
CNPJ: 09.005.805/0001-00**

Dia, hora e local: Dia 30 de Agosto de 2024, às 17 horas, na sede da BB GESTÃO DE RECURSOS DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A., administradora do BB Ações Retorno Total Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento, localizada na Praça XV de Novembro nº 20 - 2º andar, Rio de Janeiro (RJ).

Processo de consulta: Consulta formal à totalidade de investidores do fundo, perfazendo 22.046 (vinte e dois mil quarenta e seis) cotistas, representando 614.285.592,273106 (seiscentos e quatorze milhões duzentos e oitenta e cinco mil quinhentos e noventa e dois com duzentos e setenta e três mil cento e seis milionésimo(s)) cotas, e de acordo com as instruções vigentes e o regulamento do fundo, por meio de manifestações recebidas até às 17 horas do dia 30/08/2024.

Composição da mesa diretora: Assumiu a presidência dos trabalhos o(a) Sr(a). ADNEY MARQUES PINHEIRO e como secretário(a) o(a) Sr(a). BRUNA BARBOSA DE MENDONCA TORRES ficando assim constituída a mesa diretora dos trabalhos.

Consulta: Aprovar os itens da consulta, conforme abaixo:

1 - Incorporação

Incorporação pelo BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FICFI (FI) , CNPJ. 00.822.059/0001-65; Alteração do Art 2º que trata do Objetivo do fundo, para adequação ao objetivo do FI; Alteração do Art 3º que trata do público-alvo, para adequação ao público-alvo do FI; Alteração da Política de Investimento, para adequação à Política de Investimento do FI; Alteração dos Fatores de Risco, no Art 13, para adequação aos Fatores de Risco do FI; Renumeração de artigos e parágrafos.

Deliberação: Encerrado o prazo para manifestação, findo às 17 horas desta data, foram contabilizadas 46 (quarenta e seis) manifestações à consulta, representando 3.449.488,505114 (três milhões quatrocentos e quarenta e nove mil quatrocentos e oitenta e oito com quinhentos e cinco mil cento e quatorze milionésimo(s)) cotas, conforme apuração abaixo:

1 - Incorporação

3.187.112,853975 (três milhões cento e oitenta e sete mil cento e doze com oitocentos e cinquenta e três mil novecentos e setenta e cinco milionésimo(s)) cotas/votos APROVAM a consulta;

262.375,651139 (duzentos e sessenta e dois mil trezentos e setenta e cinco com seiscentos e cinquenta e um mil cento e trinta e nove milionésimo(s)) cotas/votos NÃO APROVAM a consulta;

610.836.103,767992 (seiscentos e dez milhões oitocentos e trinta e seis mil cento e três com setecentos e sessenta e sete mil novecentos e noventa e dois milionésimo(s)) de cotas/votos dos cotistas SEM MANIFESTAÇÃO;

70
71
72



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



BBDTVM

Resultado: Foram aprovadas as ordens do dia, do processo de consulta formal, conforme deliberação acima.

1 - Incorporação

Incorporação pelo BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FICFI (FI) , CNPJ. 00.822.059/0001-65; Alteração do Art 2º que trata do Objetivo do fundo, para adequação ao objetivo do FI; Alteração do Art 3º que trata do público-alvo, para adequação ao público-alvo do FI; Alteração da Política de Investimento, para adequação à Política de Investimento do FI; Alteração dos Fatores de Risco, no Art 13, para adequação aos Fatores de Risco do FI; Renumeração de artigos e parágrafos.

A vigência do novo regulamento com as alterações ora aprovadas será em 15/10/2024.

Encerramento: Nada mais havendo a tratar, o(a) Sr(a). Presidente encerrou os trabalhos de apuração da Consulta, lavrando-se a presente ata ora assinada.

Rio de Janeiro, 30 de Agosto de 2024

ADNEY MARQUES PINHEIRO
Presidente

BRUNA BARBOSA DE MENDONCA TORRES
Secretário(a)

73
74
75

Página 2 de 2



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



76 **III - ACOMPANHAMENTO DAS COTAS DOS FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL: A**
77 seguir, apresento o relatório de acompanhamento dos fundos de renda variável,
78 principalmente para verificar quais fundos estão em situação de cota negativa (relação entre a
79 cota do momento de sua compra pelo Macaeprev e o seu valor atual).

ACOMPANHAMENTO DAS COTAS DOS FUNDOS - AÇÕES BRASIL									
Fundo	Benchmark	Posição em 31/08/2024	Rentabilidade Mês Atual	Saldo por Aplicação	Aplicações		Resgates		Liquidez
					Data	Valor	Data	Valor	
BB Ações Ibovespa Ativo	Ibovespa	R\$ 17.974.462,55	5,70%	R\$ 974.462,55	17/01/2020	R\$ 35.000.000,00	20/01/2020	R\$ 18.000.000,00	D+3
		R\$ 4.347.923,03		R\$ 847.923,03	25/04/2023	R\$ 3.500.000,00			
		Total		R\$ 22.322.385,58	Total	R\$ 1.822.385,58	Total	R\$ 38.500.000,00	
BB Ações Bolsa Brasileira	Ibovespa	R\$ 19.690.085,09	6,50%	R\$ 1.690.085,09	23/01/2020	R\$ 18.000.000,00			D+2
		R\$ 6.807.978,35		R\$ 1.807.978,35	24/03/2023	R\$ 5.000.000,00			
		R\$ 6.478.355,81		R\$ 1.478.355,81	24/04/2023	R\$ 5.000.000,00			
Total	R\$ 32.976.419,25	Total	R\$ 4.976.419,25	Total	R\$ 28.000.000,00	Total			
BB Ações Retorno Total	Ibovespa	R\$ 4.381.560,17	5,47%	-R\$ 988.439,83	20/02/2020	R\$ 5.370.000,00			D+3
		R\$ 7.637.487,87		-R\$ 2.362.512,13	12/07/2021	R\$ 10.000.000,00			
		R\$ 3.690.920,49		-R\$ 434.079,51	21/09/2021	R\$ 4.125.000,00			
		R\$ 3.501.716,76		R\$ 501.716,76	15/07/2022	R\$ 3.000.000,00			
		R\$ 6.077.934,81		R\$ 1.077.934,81	27/03/2023	R\$ 5.000.000,00			
		R\$ 6.023.722,29		R\$ 1.023.722,29	25/04/2023	R\$ 5.000.000,00			
		R\$ 6.460.810,91		R\$ 460.810,91	23/06/2023	R\$ 6.000.000,00			
		R\$ 6.493.109,00		R\$ 493.109,00	06/07/2023	R\$ 6.000.000,00			
		R\$ 6.607.840,95		R\$ 607.840,95	21/08/2023	R\$ 6.000.000,00			
Total	R\$ 50.875.103,24	Total	R\$ 380.103,24	Total	R\$ 50.495.000,00	Total			
BB Ações Agro	Ibovespa	R\$ 0,00	4,62%	R\$ 238.232,70	09/07/2021	R\$ 10.000.000,00	04/07/2024	R\$ 10.238.232,70	D+2
		R\$ 0,00		R\$ 162.167,71	27/08/2021	R\$ 2.465.500,00	04/07/2024	R\$ 2.627.667,71	
		R\$ 0,00		R\$ 424.006,06	20/09/2021	R\$ 4.125.000,00	04/07/2024	R\$ 4.549.006,06	
		R\$ 925.896,77		R\$ 510.990,30	14/07/2022	R\$ 3.000.000,00	04/07/2024	R\$ 2.585.093,53	
		R\$ 5.945.537,11		R\$ 945.537,11	24/03/2023	R\$ 5.000.000,00			
		R\$ 5.942.861,46		R\$ 942.861,46	24/04/2023	R\$ 5.000.000,00			
		R\$ 6.500.052,52		R\$ 500.052,52	22/06/2023	R\$ 6.000.000,00			
		R\$ 6.394.394,15		R\$ 394.394,15	05/07/2023	R\$ 6.000.000,00			
Total	R\$ 25.708.742,01	Total	R\$ 4.118.242,01	Total	R\$ 41.590.500,00	Total	R\$ 20.000.000,00		
BB Ações Dividendos Midcaps	Ibovespa	R\$ 5.120.511,58	6,80%	R\$ 995.511,58	20/09/2021	R\$ 4.125.000,00			D+3
		R\$ 4.209.010,45		R\$ 1.209.010,45	14/07/2022	R\$ 3.000.000,00			
		R\$ 8.833.419,87		R\$ 2.333.419,87	24/03/2023	R\$ 6.500.000,00			
		R\$ 8.483.737,07		R\$ 1.983.737,07	24/04/2023	R\$ 6.500.000,00			
		R\$ 6.660.749,74		R\$ 660.749,74	22/06/2023	R\$ 6.000.000,00			
		R\$ 6.540.979,54		R\$ 540.979,54	05/07/2023	R\$ 6.000.000,00			
		R\$ 6.727.361,18		R\$ 727.361,18	18/08/2023	R\$ 6.000.000,00			
		R\$ 10.354.287,85		R\$ 354.287,85	26/02/2024	R\$ 10.000.000,00			
Total	R\$ 56.930.057,29	Total	R\$ 8.805.057,29	Total	R\$ 48.125.000,00	Total			
BB Trígono Delphos Income	IDIV	R\$ 4.867.504,96	2,21%	-R\$ 132.495,04	30/10/2023	R\$ 5.000.000,00			D+32
		R\$ 14.897.017,08		-R\$ 102.982,92	27/02/2024	R\$ 15.000.000,00			
		Total		R\$ 19.764.522,04	Total	-R\$ 235.477,96	Total	R\$ 20.000.000,00	
BB Trígono Flagship Small Caps	SMLL	R\$ 20.014.441,01	3,18%	R\$ 14.441,01	27/02/2024	R\$ 20.000.000,00			D+32
		Total		R\$ 20.014.441,01	Total	R\$ 14.441,01	Total	R\$ 20.000.000,00	
Caixa Ações Livre Quantitativo	Ibovespa	R\$ 11.938.481,74	9,54%	R\$ 1.938.481,74	12/07/2021	R\$ 10.000.000,00			D+15
		R\$ 3.111.953,59		R\$ 646.453,59	30/08/2021	R\$ 2.465.500,00			
		R\$ 5.608.132,09		R\$ 1.483.132,09	21/09/2021	R\$ 4.125.000,00			
		R\$ 4.220.290,70		R\$ 1.220.290,70	15/07/2021	R\$ 3.000.000,00			
		R\$ 3.290.961,79		R\$ 790.961,79	27/09/2021	R\$ 2.500.000,00			
		R\$ 7.007.401,75		R\$ 2.007.401,75	27/03/2023	R\$ 5.000.000,00			
		R\$ 6.889.887,69		R\$ 1.889.887,69	25/04/2023	R\$ 5.000.000,00			
		R\$ 6.933.804,85		R\$ 933.804,85	23/06/2023	R\$ 6.000.000,00			
		R\$ 6.994.693,01		R\$ 994.693,01	05/07/2023	R\$ 6.000.000,00			
		R\$ 7.031.339,45		R\$ 1.031.339,45	21/08/2023	R\$ 6.000.000,00			
		Total		R\$ 63.026.946,65	Total	R\$ 12.936.446,65	Total	R\$ 50.090.500,00	



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



ACOMPANHAMENTO DAS COTAS DOS FUNDOS - AÇÕES BRASIL

Fundo	Benchmark	Posição em 31/08/2024	Rentabilidade Mês Atual	Saldo por Aplicação	Aplicações		Resgates		Liquidez
					Data	Valor	Data	Valor	
Caixa Ações Small Caps Ativo	SMLL	4,35%	R\$ 3.740.827,94	-R\$ 1.629.172,06	20/02/2020	R\$ 5.370.000,00			D+4
			R\$ 9.371.431,27	-R\$ 628.568,73	09/03/2020	R\$ 10.000.000,00			
			R\$ 3.306.665,23	R\$ 306.665,23	15/07/2022	R\$ 3.000.000,00			
			R\$ 2.439.393,33	-R\$ 60.606,67	27/09/2022	R\$ 2.500.000,00			
			R\$ 5.831.426,34	R\$ 831.426,34	27/03/2023	R\$ 5.000.000,00			
			R\$ 5.886.025,65	R\$ 886.025,65	25/04/2023	R\$ 5.000.000,00			
			R\$ 5.530.834,68	-R\$ 469.165,32	23/06/2023	R\$ 6.000.000,00			
			R\$ 5.538.324,31	-R\$ 461.675,69	06/07/2023	R\$ 6.000.000,00			
			R\$ 5.697.938,75	-R\$ 302.061,25	21/08/2023	R\$ 6.000.000,00			
			R\$ 4.745.760,68	-R\$ 254.239,32	27/02/2024	R\$ 5.000.000,00			
Total	R\$ 52.088.628,18	Total	-R\$ 1.781.371,82	Total	R\$ 53.870.000,00	Total			
Caixa Ações Multigestor	Ibovespa	4,51%	R\$ 12.303.519,92	-R\$ 196.480,08	24/03/2021	R\$ 12.500.000,00			D+25
			R\$ 4.091.054,29	-R\$ 33.945,71	21/09/2021	R\$ 4.125.000,00			
			R\$ 3.681.811,96	R\$ 681.811,96	15/07/2022	R\$ 3.000.000,00			
			R\$ 2.762.099,51	R\$ 262.099,51	27/09/2022	R\$ 2.500.000,00			
			R\$ 6.280.977,27	R\$ 1.280.977,27	27/03/2023	R\$ 5.000.000,00			
			R\$ 6.178.662,35	R\$ 1.178.662,35	25/04/2023	R\$ 5.000.000,00			
			R\$ 6.389.179,51	R\$ 389.179,51	26/06/2023	R\$ 6.000.000,00			
			R\$ 6.356.414,02	R\$ 356.414,02	06/07/2023	R\$ 6.000.000,00			
			R\$ 6.467.479,92	R\$ 467.479,92	21/08/2023	R\$ 6.000.000,00			
Total	R\$ 54.511.198,74	Total	R\$ 4.386.198,74	Total	R\$ 50.125.000,00	Total			
Caixa Ações Expert Claritas	Ibovespa	4,60%	R\$ 2.906.099,95	R\$ 406.099,95	27/09/2022	R\$ 2.500.000,00			D+25
			R\$ 1.992.145,17	R\$ 492.145,17	27/03/2023	R\$ 1.500.000,00			
			Total	R\$ 4.898.245,12	Total	R\$ 898.245,12	Total	R\$ 4.000.000,00	
Caixa Ações Expert Vinci Valor	Ibovespa	6,10%	R\$ 26.130.989,68	R\$ 1.130.989,68	26/03/2024	R\$ 25.000.000,00			D+23
			Total	R\$ 26.130.989,68	Total	R\$ 1.130.989,68	Total	R\$ 25.000.000,00	
Caixa Ações Expert Vinci Valor Dividendos	IDIV	5,73%	R\$ 48.852.613,62	R\$ 3.852.613,62	26/03/2024	R\$ 45.000.000,00			D+32
			Total	R\$ 48.852.613,62	Total	R\$ 3.852.613,62	Total	R\$ 45.000.000,00	

81

ACOMPANHAMENTO DAS COTAS DOS FUNDOS - AÇÕES BDR

Fundo	Benchmark	Posição em 31/08/2024	Rentabilidade Mês Atual	Saldo por Aplicação	Aplicações		Resgates		Liquidez			
					Data	Valor	Data	Valor				
Caixa Ações Institucional BDR Nivel I	BDRX	0,57%	R\$ 18.452.389,89	R\$ 5.952.389,89	25/03/2021	R\$ 12.500.000,00			D+4			
			R\$ 1.427.985,26	R\$ 477.985,26	27/05/2021	R\$ 950.000,00						
			R\$ 2.873.254,68	R\$ 1.003.254,68	16/06/2021	R\$ 1.870.000,00						
			R\$ 14.335.126,39	R\$ 4.335.126,39	12/07/2021	R\$ 10.000.000,00						
			R\$ 1.324.339,53	R\$ 399.339,53	13/07/2021	R\$ 925.000,00						
			R\$ 1.159.952,91	R\$ 339.952,91	11/08/2021	R\$ 820.000,00						
			R\$ 1.164.456,48	R\$ 338.456,48	13/09/2021	R\$ 826.000,00						
			R\$ 23.554.555,28	R\$ 7.054.555,28	21/09/2021	R\$ 16.500.000,00						
			R\$ 387.080,22	R\$ 112.080,22	30/09/2021	R\$ 275.000,00						
			R\$ 1.231.224,88	R\$ 306.224,88	18/10/2021	R\$ 925.000,00						
			R\$ 526.589,14	R\$ 111.589,14	29/10/2021	R\$ 415.000,00						
			R\$ 1.385.110,08	R\$ 285.110,08	29/11/2021	R\$ 1.100.000,00						
			R\$ 990.089,73	R\$ 202.089,73	09/12/2021	R\$ 788.000,00						
			R\$ 592.796,43	R\$ 167.796,43	31/01/2022	R\$ 425.000,00						
			R\$ 988.826,30	R\$ 288.826,30	10/02/2022	R\$ 700.000,00						
			R\$ 1.245.035,40	R\$ 441.035,40	22/02/2022	R\$ 804.000,00						
			R\$ 1.809.757,66	R\$ 628.757,66	29/03/2022	R\$ 1.181.000,00						
			R\$ 1.925.564,34	R\$ 758.564,34	14/04/2022	R\$ 1.167.000,00						
			Total	R\$ 75.374.134,58	Total	R\$ 23.203.134,58	Total	R\$ 52.171.000,00		Total		

82



ACOMPANHAMENTO DAS COTAS DOS FUNDOS - AÇÕES EXTERIOR

Fundo	Benchmark	Posição em 31/08/2024	Rentabilidade Mês Atual	Saldo por Aplicação	Aplicações		Resgates		Liquidez
					Data	Valor	Data	Valor	
BB Global Select Equity	MSCI World	R\$ 25.698.722,65	2,98%	R\$ 10.698.722,65	19/05/2022	R\$ 15.000.000,00			D+5
		R\$ 14.943.544,01		R\$ 4.943.544,01	25/04/2023	R\$ 10.000.000,00			
		R\$ 14.847.949,98		R\$ 4.847.949,98	31/05/2023	R\$ 10.000.000,00			
		R\$ 12.481.445,67		R\$ 2.481.445,67	27/02/2024	R\$ 10.000.000,00			
	Total	R\$ 67.971.662,31	Total	R\$ 22.971.662,31	Total	R\$ 45.000.000,00	Total		
BB Nordea Stable Equities	MSCI World	R\$ 20.727.435,49	3,81%	R\$ 5.727.435,49	19/05/2022	R\$ 15.000.000,00			D+5
		R\$ 12.588.190,01		R\$ 2.588.190,01	25/04/2023	R\$ 10.000.000,00			
		R\$ 12.938.941,92		R\$ 2.938.941,92	25/07/2023	R\$ 10.000.000,00			
		R\$ 12.161.919,76		R\$ 2.161.919,76	27/02/2024	R\$ 10.000.000,00			
	Total	R\$ 58.416.487,17	Total	R\$ 13.416.487,17	Total	R\$ 45.000.000,00	Total		
BB Nordea Global Climate and Environment	MSCI World	R\$ 8.120.977,16	3,15%	R\$ 2.120.977,16	21/08/2023	R\$ 6.000.000,00			D+5
		R\$ 18.587.052,86		R\$ 3.587.052,86	27/02/2024	R\$ 15.000.000,00			
	Total	R\$ 26.708.030,01	Total	R\$ 5.708.030,01	Total	R\$ 21.000.000,00	Total		
BB Universal Brands BRL	MSCI World	R\$ 7.034.808,01	3,02%	R\$ 1.034.808,01	21/08/2023	R\$ 6.000.000,00			D+6
		R\$ 15.679.485,78		R\$ 679.485,78	27/02/2024	R\$ 15.000.000,00			
	Total	R\$ 22.714.293,79	Total	R\$ 1.714.293,79	Total	R\$ 21.000.000,00	Total		

83

ACOMPANHAMENTO DAS COTAS DOS FUNDOS - CONSOLIDADO

Posição em 31/08/2024	Saldo Consolidado	Total de Aplicações	Total de Resgates
R\$ 729.284.900,27	R\$ 108.317.900,27	R\$ 658.967.000,00	R\$ 38.000.000,00

84

85

86 **IV - CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS:** A tabela abaixo traz todas as compras de

87 Títulos Públicos realizadas com as respectivas taxas e taxa média de aquisição:

88

Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.



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



MÉDIA GERAL				
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2025	R\$ 20.001.922,26	6,0000%	R\$ 1.200.115,336	
NTN-B 2025	R\$ 19.998.871,32	6,0200%	R\$ 1.203.932,053	
NTN-B 2025	R\$ 19.996.526,46	6,0150%	R\$ 1.202.791,067	
NTN-B 2025	R\$ 20.000.481,25	6,0500%	R\$ 1.210.029,116	
NTN-B 2025	R\$ 19.997.440,70	6,0700%	R\$ 1.213.844,650	
NTN-B 2025	R\$ 19.998.218,00	6,2200%	R\$ 1.243.889,160	
NTN-B 2025	R\$ 20.000.543,65	6,2020%	R\$ 1.240.433,717	
NTN-B 2025	R\$ 19.996.183,71	6,2401%	R\$ 1.247.781,860	
NTN-B 2025	R\$ 39.998.426,01	6,2720%	R\$ 2.508.701,279	
NTN-B 2025	R\$ 19.998.805,46	6,3530%	R\$ 1.270.524,111	
NTN-B 2025	R\$ 99.997.324,90	6,0600%	R\$ 6.059.837,889	
NTN-B 2025	R\$ 100.030.387,04	6,0800%	R\$ 6.081.847,532	
	R\$ 420.015.130,76		R\$ 25.683.727,769	6,1150%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2026	R\$ 50.003.250,05	5,9950%	R\$ 2.997.694,840	
NTN-B 2026	R\$ 24.995.869,43	6,0010%	R\$ 1.500.002,124	
NTN-B 2026	R\$ 24.996.098,86	6,1710%	R\$ 1.542.509,261	
NTN-B 2026	R\$ 99.996.346,84	6,3510%	R\$ 6.350.767,988	
	R\$ 199.991.565,18		R\$ 12.390.974,213	6,1957%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2027	R\$ 99.997.911,60	6,1700%	R\$ 6.169.871,146	
NTN-B 2027	R\$ 249.998.113,75	6,3010%	R\$ 15.752.381,147	
	R\$ 349.996.025,35		R\$ 21.922.252,293	6,2636%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2028	R\$ 150.079.829,97	6,2650%	R\$ 9.402.501,348	
	R\$ 150.079.829,97		R\$ 9.402.501,348	6,2650%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2029	R\$ 149.998.497,73	6,6950%	R\$ 10.042.399,423	
	R\$ 149.998.497,73		R\$ 10.042.399,423	6,6950%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2035	R\$ 149.996.238,75	6,6310%	R\$ 9.946.250,592	
	R\$ 149.996.238,75		R\$ 9.946.250,592	6,6310%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2040	R\$ 99.999.549,45	5,9350%	R\$ 5.934.973,260	
	R\$ 99.999.549,45		R\$ 5.934.973,26	5,9350%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2045	R\$ 24.998.098,19	5,9475%	R\$ 1.486.761,890	
NTN-B 2045	R\$ 9.929.278,33	5,7420%	R\$ 570.139,162	
NTN-B 2045	R\$ 49.996.714,56	5,9000%	R\$ 2.949.806,159	
NTN-B 2045	R\$ 49.996.072,39	5,9100%	R\$ 2.954.767,878	
NTN-B 2045	R\$ 100.002.161,98	5,9750%	R\$ 5.975.129,178	
NTN-B 2045	R\$ 34.999.569,45	6,1420%	R\$ 2.149.673,556	
	R\$ 269.921.894,90		R\$ 16.086.277,823	5,9596%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2050	R\$ 9.999.724,96	5,7915%	R\$ 579.134,071	
NTN-B 2050	R\$ 24.999.099,32	5,9800%	R\$ 1.494.946,139	
NTN-B 2050	R\$ 24.998.777,38	6,0570%	R\$ 1.514.175,946	
NTN-B 2050	R\$ 49.997.529,05	6,0200%	R\$ 3.009.851,249	
NTN-B 2050	R\$ 49.999.679,01	6,0200%	R\$ 3.009.980,676	
NTN-B 2050	R\$ 24.996.712,11	6,0210%	R\$ 1.505.052,036	
NTN-B 2050	R\$ 50.001.700,08	5,9030%	R\$ 2.951.600,356	
NTN-B 2050	R\$ 49.994.930,61	5,9060%	R\$ 2.952.700,602	
	R\$ 284.988.152,52		R\$ 17.017.441,075	5,9713%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2055	R\$ 9.999.905,79	5,7960%	R\$ 579.594,540	
NTN-B 2055	R\$ 24.997.181,18	5,9800%	R\$ 1.494.831,435	
NTN-B 2055	R\$ 25.000.154,96	6,0610%	R\$ 1.515.259,392	
NTN-B 2055	R\$ 49.999.044,52	6,0200%	R\$ 3.009.942,480	
NTN-B 2055	R\$ 24.996.905,90	6,0210%	R\$ 1.505.063,704	
NTN-B 2055	R\$ 49.996.451,13	5,9000%	R\$ 2.949.790,617	
	R\$ 184.989.643,48		R\$ 11.054.482,167	5,9757%
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
NTN-B 2060	R\$ 10.002.108,49	5,7960%	R\$ 579.722,208	
NTN-B 2060	R\$ 24.999.107,72	5,9800%	R\$ 1.494.946,642	
NTN-B 2060	R\$ 24.997.336,12	6,0110%	R\$ 1.502.589,874	
NTN-B 2060	R\$ 24.996.548,82	6,0120%	R\$ 1.502.792,515	
	R\$ 84.995.101,15		R\$ 5.080.051,239	5,9769%
MÉDIA GERAL				
Tipo	Valor da Compra	Taxa Comprada	Resultado	Taxa Média
	R\$ 2.344.971.629,24		R\$ 144.561.331,202	6,1647%



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



90 A tabela a seguir traz uma comparação entre a carteira atual de títulos do Macaeprev (base
91 18/09/2024) e a carteira sugerida pelo ALM.

Carteira de Títulos Públicos - Macaeprev (18/09/2024)					
Período	Títulos	Posição na data do Estudo	Posição Atual	Saldo para Alongamento ALM	Gap com o ALM
Até 2024	NTN-B 2024	R\$ 1.029.520,53	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 501.821.700,39
	Fundo de Vértice 2024	R\$ 500.792.179,86	R\$ 0,00		
Até 2025	NTN-B 2025	R\$ 224.821.847,75	R\$ 438.960.223,74	R\$ 0,00	-R\$ 214.138.375,99
Até 2026	NTN-B 2026	R\$ 101.695.654,75	R\$ 204.362.967,85	R\$ 0,00	-R\$ 102.667.313,10
Até 2027	NTN-B 2027	R\$ 98.669.098,95	R\$ 355.841.564,20	R\$ 0,00	-R\$ 257.172.465,25
	Fundo de Vértice 2027	R\$ 0,00	R\$ 57.586.914,22	R\$ 0,00	-R\$ 57.586.914,22
Até 2035	NTN-B 2035	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
Até 2040	NTN-B 2028	R\$ 0,00	R\$ 151.600.848,72	R\$ 590.000.000,00	-R\$ 10.472.224,04
	NTN-B 2029	R\$ 0,00	R\$ 152.888.238,43		
	Fundo de Vértice 2029	R\$ 0,00	R\$ 41.862.257,30		
	NTN-B 2035	R\$ 0,00	R\$ 152.867.988,73		
Até 2040	NTN-B 2040	R\$ 0,00	R\$ 101.252.890,86		
Até 2045	NTN-B 2045	R\$ 34.757.766,14	R\$ 275.070.735,61	R\$ 500.000.000,00	R\$ 259.687.030,53
Até 2050	NTN-B 2050	R\$ 188.866.291,61	R\$ 292.939.529,21	R\$ 160.000.000,00	R\$ 55.926.762,40
Até 2055	NTN-B 2055	R\$ 133.961.869,66	R\$ 190.560.274,74	R\$ 50.000.000,00	-R\$ 6.598.405,08
Até 2060	NTN-B 2060	R\$ 87.059.320,47	R\$ 88.277.300,34	R\$ 0,00	-R\$ 1.217.979,87
Total:		R\$ 1.371.653.549,72	R\$ 2.504.071.733,95	R\$ 1.300.000.000,00	R\$ 167.581.815,77

92

93 **V - ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às dezoito
94 horas e quinze minutos, tendo a ata sido lida e assinada por todos os presentes.

95 COMITÊ DE INVESTIMENTOS:

96
97

98 Alfredo Tanos Filho

Claudio de Freitas Duarte

99

100 Erenildo Motta da Silva Júnior

Fábio de Carvalho de Moraes Drumond

101

102 José Eduardo da Silva Guinâncio

Miriam Amaral Queiroz

103

104 Patric Alves de Vasconcellos

Viviane da Silva Lourenço Campos