



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



1 ATA n.º 44/2024 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 25/09/2024 – Ata de Reunião
2 Ordinária do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Social do Município de
3 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 e cinco de setembro de dois mil e vinte e quatro,
6 estando presentes os membros, *Alfredo Tanos Filho, Claudio de Freitas Duarte, Erenildo*
7 *Motta da Silva Júnior e José Eduardo da Silva Guinâncio*, instituídos através da portaria de
8 nomeação n.º 289/2021, os membros, *Miriam Amaral Queiroz e Patric Alves de*
9 *Vasconcellos* instituídos através da portaria n.º 306/2022, o membro *Viviane da Silva*
10 *Lourenço Campos* instituída através da portaria n.º 1.707/2022 e o membro *Fábio Carvalho*
11 *de Moraes Drumond* instituído através da portaria n.º 0685/2023. Iniciada a reunião,
12 realizada de forma on-line, através da plataforma Google Meets, sendo tratados os seguintes
13 assuntos: **I – APRESENTAÇÃO DO RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS –**
14 **CARTEIRA DE AGOSTO DE 2024: INTRODUÇÃO:** Mantendo elevados níveis de
15 transparência e para manter boa comunicação junto aos servidores e munícipes, o Instituto de
16 Previdência Social do Município de Macaé – Macaeprev apresenta o relatório de
17 investimentos, referente ao mês de agosto de 2024. Neste relatório é possível observar a
18 consolidação de todas as informações relativas ao período de referência, incluindo o cenário
19 econômico, os resultados alcançados em relação às metas estabelecidas, o comportamento dos
20 ativos financeiros que compõe a carteira de investimentos do Macaeprev, inclusive quanto aos
21 indicadores de desempenho e gerenciamento de riscos. **CENÁRIO ECONÔMICO:** O mês
22 de agosto foi uma montanha-russa de emoções. Começamos o mês com os mercados caindo
23 bastante por temor de uma recessão nos Estados Unidos, visto que os dados de atividade e
24 mercado de trabalho começaram a arrefecer em um nível preocupante. Outro fator que deixou
25 o mercado sob tensão foi o desmonte do carry trade no mercado japonês, um movimento onde
26 o aumento da taxa de juros casado com a valorização da moeda (iene) provocou uma fuga de
27 capitais do país em direção a outros lugares de forma desproporcional, o que levou a bolsa
28 japonesa a estar com um máximo drawdown de 25% no dia 5 de agosto. Porém, no
29 transcorrer do mês alguns dados melhores foram divulgados e aos poucos os mercados foram
30 se recuperando, e até o Japão teve uma recuperação importante. No front geopolítico,



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



31 continua a tensão no Oriente Médio com ataques a lideranças do Hamas em solo iraniano,
32 sem probabilidade de um cessar-fogo e aumentou o risco de uma escalada para um conflito
33 regional envolvendo Israel e Irã. Além disso, a guerra da Ucrânia completa 30 meses, sem
34 perspectivas de avanço nas negociações diplomáticas. Nos EUA, a produção industrial caiu
35 0,6% em julho, após ter registrado alta de 0,3% em junho, informou o Federal Reserve (Fed, o
36 banco central americano). A piora no desempenho foi atribuída a efeitos das paralisações no
37 início do mês especialmente das indústrias petroquímicas, devido ao furacão Beryl. Segundo
38 o Fed, a maioria dos principais grupos industriais registrou perdas em julho. O índice de bens
39 de consumo, por exemplo, recuou 1% em grande parte devido a uma queda de 0,7% no índice
40 de produtos automotivos. A utilização da capacidade caiu de 78,4% em junho para 77,8% em
41 julho, taxa que agora está 1,9 ponto percentual abaixo da média de longo prazo. O Índice de
42 Gerente de Compras (PMI, na sigla em inglês) composto dos Estados Unidos, que reúne
43 dados do setor industrial e, também de serviços, está há 18 meses posicionado em patamar
44 acima de 50,0, o que significa expansão, mas segundo dados da S&P Global registrou queda
45 marginalmente para 54,3 em julho, ante 54,8 em junho. Para Chris Williamson, economista
46 chefe de Negócios da S&P Global Market Intelligence, as pesquisas do PMI trouxeram
47 notícias encorajadoras de uma combinação bem-vinda de crescimento econômico sólido e
48 inflação de preços de venda mais fria em julho. A inflação medida pelo índice CPI em julho
49 variou +0,2% (M/M), ante -0,1% (M/M) em junho. Com o dado de julho, o índice acumulado
50 em 12 meses reduziu de 3,0% para 2,9% (A/A). Já a inflação medida pelo PCE de julho
51 apresentou um crescimento de 0,2%, ante o crescimento de 0,1% (M/M) em junho, com
52 estabilidade da inflação anualizada em 2,5%, acumulado 2,6% em 12 meses. Sobre o
53 mercado de trabalho, a criação de vagas de emprego nos Estados Unidos desacelerou mais do
54 que o esperado em julho. Com isso, a taxa de desemprego aumentou para 4,3%. Os números
55 tendem a ampliar os temores de que o mercado de trabalho esteja se deteriorando rápido
56 demais, elevando os riscos de uma recessão da maior economia do mundo. A economia norte-
57 americana criou 114 mil postos de trabalho fora do setor agrícola no mês de julho, depois de
58 abrir 179 mil vagas em junho (dado revisado para baixo). Os números fazem parte do
59 relatório oficial de emprego nos EUA, o chamado payroll. A ata da última reunião do FOMC,
60 na qual os juros foram mantidos no intervalo de 5,25% a 5,50%, reconheceu progressos em

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



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



61 relação à inflação, mas manteve a avaliação de que a economia segue sólida. Segundo o
62 documento, a atividade nos EUA cresceu em ritmo mais lento do que na segunda metade de
63 2023 e o mercado de trabalho apresentou moderação dos ganhos. No campo da política
64 monetária, a dúvida já não é mais se haverá o primeiro corte dos juros em setembro, mas qual
65 será a magnitude dessa redução. Isso ocorre após recentes manifestações de membros do Fed
66 e dados mais favoráveis de inflação. Na China, a economia continua a enfrentar dificuldades
67 no terceiro trimestre de 2024, com novos dados apontando para uma persistente fraqueza que
68 desafia as metas de crescimento estabelecidas pelo governo. A desaceleração do
69 investimento em ativos fixos para 3,6% nos primeiros sete meses do ano foi um dos principais
70 destaques dos dados divulgados. Apesar de as vendas no varejo terem superado as
71 expectativas devido a um aumento sazonal, elas ainda permanecem muito abaixo dos níveis
72 pré-pandemia. A produção industrial, por sua vez, enfraqueceu levemente, embora continue a
73 superar o consumo. O governo do presidente Xi Jinping tem como meta um crescimento de
74 cerca de 5% em 2024, mas os desafios são evidentes. Economistas pedem uma aceleração nos
75 gastos com infraestrutura e outros programas para reativar a demanda interna, essencial para
76 atingir essa meta. A desaceleração nesse setor é um sinal de alerta para a economia chinesa,
77 indicando que a fraqueza na demanda pode eventualmente afetar outros setores. As
78 preocupações com um declínio prolongado na confiança e nos preços aumentaram após a
79 China relatar a primeira contração nos empréstimos à economia real em quase duas décadas.
80 Na Zona do Euro, a inflação medida pelo CPI de agosto desacelerou de 2,6% para 2,2%
81 (A/A), em linha com as expectativas de mercado (2,5%). Avaliando os principais grupos, os
82 serviços apresentaram taxa mais elevada em agosto (4,2% ante 4,0% em julho), seguidos dos
83 produtos alimentares, álcool e tabaco (2,4%, ante a 2,3%), ao passo que bens industriais não
84 energéticos desaceleraram (0,4%, ante 0,7%). Por outro lado, foi observada significativa
85 queda dos preços de energia (-3,0% ante 1,2%). Nas principais economias do bloco,
86 observou-se desaceleração na Alemanha (2,0% ante 2,6% A/A), na Espanha (2,4% ante 2,9%
87 A/A), na França (2,2% ante 2,7% A/A) e na Itália (1,3% ante 1,6% A/A). A taxa de
88 desemprego na Zona do Euro em junho/24 registrou alta, passando de 6,4% para 6,5%, em
89 linha com as expectativas do mercado. Entre as principais economias do bloco, observou-se
90 manutenção da taxa de desemprego na Alemanha (3,4%) e na França (7,4%). O Produto



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



91 Interno Bruto (PIB) na Zona do Euro cresceu acima das expectativas, registrando 0,30% no
92 segundo trimestre, evidenciando a força do setor de turismo na região, em especial na França
93 e Espanha. O Comitê de Política Monetária (MPC) do Bank of England (BoE) reduziu sua
94 taxa básica em 0,25 pontos percentuais, o primeiro corte desde a pandemia da Covid-19. No
95 comunicado, a autoridade monetária britânica apontou que a inflação dos últimos 12 meses
96 retornou ao patamar de 2,0% em maio e junho e as expectativas de inflação de curto prazo se
97 normalizaram. O comunicado avaliou ainda que, embora o PIB tenha sido mais forte do que o
98 esperado, a orientação restritiva da política monetária continuou a pesar sobre a atividade,
99 produzindo um mercado de trabalho menos apertado e, por consequência, arrefecendo a
100 pressão inflacionária. No Brasil, em agosto, houve predomínio de dados positivos na
101 confiança e o índice de incerteza recuou 2,3% (M/M). Destaque positivo para a confiança de
102 serviços (0,4%, M/M) e do consumidor (0,3%, M/M). Em relação aos dados da atividade
103 econômica, o mercado de trabalho continuou robusto. Destaque para a queda da taxa de
104 desemprego (PNAD/IBGE), de 6,9% para 6,8% em julho. Destaque para a população ocupada
105 (+201 mil). No que tange à taxa de participação, houve estabilidade em 62,1%. Dessa vez, a
106 renda habitual real desacelerou de 5,8% para 4,8% (A/A), e a massa salarial real perdeu ritmo
107 (9,2% para 7,9%, A/A). O saldo de empregos formais de julho foi de 188.021. O desempenho
108 foi reflexo de 2.187.633 admissões e 1.999.612 demissões. Entre os vetores, destaque, mais
109 uma vez, para Serviços (79.167). Em junho, o Índice de Atividade Econômica do Banco
110 Central (IBC-Br) avançou 1,4% (M/M), número acima do padrão histórico e das estimativas
111 de mercado. No trimestre encerrado em junho, houve variação de 1,1% em relação aos três
112 meses anteriores na série com ajuste sazonal. Em junho de 2024 a produção industrial
113 nacional avançou 4,1% (M/M), com ajuste sazonal. O volume de vendas no comércio
114 varejista restrito recuou 1% (M/M). Com esse resultado o comércio varejista está 8,1% acima
115 do nível de fevereiro de 2020 (pré- pandemia) e 1% abaixo de maio de 2024 (auge da série
116 histórica). Em relação ao campo monetário, o Comitê de Política Monetária (Copom),
117 unanimemente, reforçou que não hesitará em elevar a taxa de juros para assegurar a
118 convergência da inflação à meta se julgar apropriado. Em relação ao ambiente doméstico, o
119 Comitê avaliou que o conjunto dos indicadores de atividade econômica e do mercado de
120 trabalho segue apresentando dinamismo maior do que o esperado. De um lado, “todos os



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



121 membros concordaram que há mais riscos para cima na inflação”, além disso “vários
122 membros” enfatizaram que já notam uma assimetria do balanço de riscos. Acerca do processo
123 desinflacionário, o Comitê afirmou que esse arrefeceu e que “os níveis de inflação corrente
124 acima da meta, em contexto de dinamismo da atividade econômica tornam a convergência da
125 inflação à meta mais desafiadora”. O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE)
126 divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) que recuou -0,02%
127 (M/M) em agosto, desacelerando em relação ao avanço de +0,38% (M/M) observado no mês
128 anterior. Foi a menor variação mensal dos últimos 14 meses. Sendo que a variação foi
129 superior a projeção de mercado de -0,15%. Com isso, o índice acumulou alta de +4,24% em
130 12 meses (ante +4,5% em julho), desacelerando assim nessa base comparação. A maior
131 contribuição para a variação do índice contudo, partiu do grupo Educação influenciado pelo
132 aumento dos itens de Leitura. Os preços administrados recuaram -0,12% em agosto ante
133 +1,08% de julho, influenciados principalmente pelo recuo dos preços do item Energia elétrica
134 residencial de -2,77%. Já os preços livres desaceleraram (de +0,14% para +0,02%) se
135 tornando os principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres, produtos industriais
136 e de serviços variaram +0,33% para +0,18% e +0,75% para +0,24% respectivamente,
137 enquanto alimentos variaram de -1,51% para -0,73%. A média dos núcleos desacelerou, tanto
138 na comparação mensal (de +0,43% para +0,25%), quanto quando observada a variação
139 acumulada em 12 meses (de +3,84% para +3,81%). Na margem, tivemos aceleração da
140 medida subjacente de industriais (+0,19%), já o núcleo de serviços perdeu ritmo (de +0,63%
141 para +0,28%). O índice de difusão passou de 46,95% em julho para 55,97% em agosto. O
142 Ibovespa, principal índice da bolsa de valores brasileira, apresentou valorização de 6,54% em
143 relação ao mês anterior, fechando aos 136.004 pontos. No ano, o índice acumula alta de
144 1,36%. Neste contexto, a performance positiva no mês pode ser explicada, em grande parte,
145 pela manutenção de entrada de recursos de investidores estrangeiros, seguindo a tendência do
146 mês anterior. Nesse sentido, em agosto, houve incremento líquido de R\$ 10 bilhões devido ao
147 aumento da expectativa de que o Fed iniciará o ciclo de corte de juros nos EUA na próxima
148 reunião que acontecerá em setembro. Além disso, no cenário local, o principal gatilho para
149 aumento do fluxo doméstico era entendido como sendo a Selic em um dígito, contudo, este
150 patamar só deve ser atingido no 2S26. No entanto, as ações estão sendo negociadas com

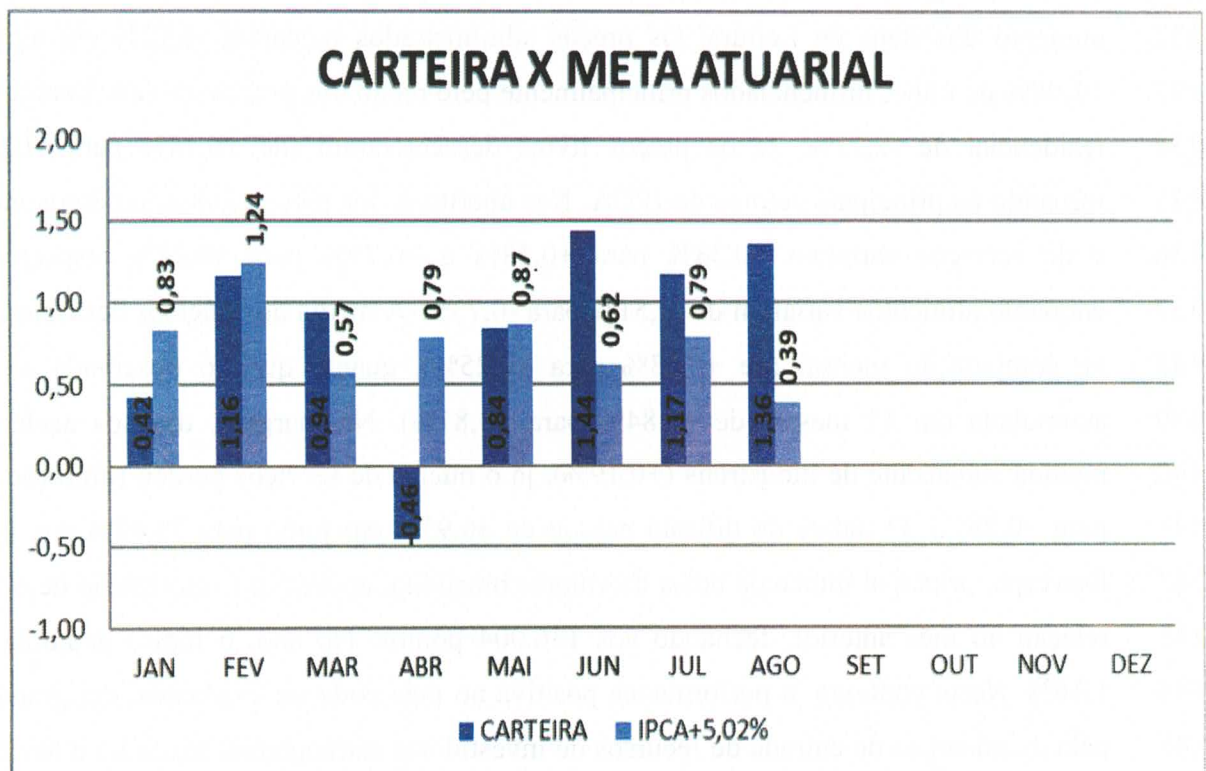


151 múltiplos consideravelmente inferiores à média histórica. **RESULTADO DA CARTEIRA**
152 No mês de agosto, nosso portfólio teve desempenho superior à Meta Atuarial. A Carteira
153 fechou o mês com uma rentabilidade de 1,36%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo
154 IPCA + 5,02%, foi de 0,39%.
155

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					7,07
IPCA+5,02%	0,83	1,24	0,57	0,79	0,87	0,62	0,79	0,39					6,26

156
157
158

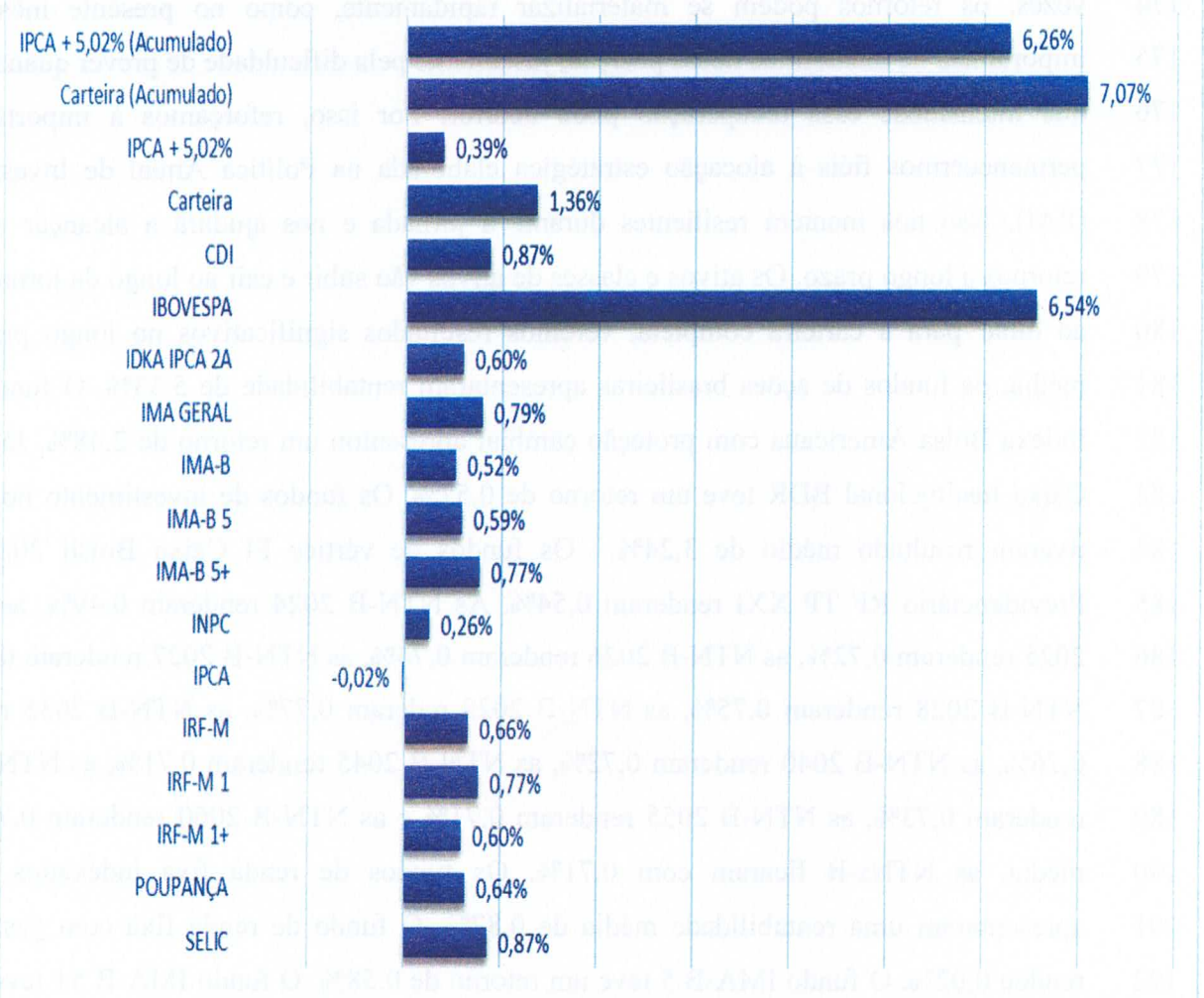


159
160 A seguir, apresento o quadro com o comportamento da Carteira, Meta Atuarial e diversos
161 índices do mercado.

(Handwritten signatures and initials in blue ink)



Rentabilidade dos Indicadores e da Carteira



162

163 No mês de agosto, observamos um comportamento positivo em nossos fundos de
164 investimento. Os investimentos em bolsa doméstica foram os que mais contribuíram para
165 nossa carteira. Dessa forma, as maiores altas na carteira foram do Caixa Brasil Ações Livre
166 com 9,54%, BB Ações Dividendos Midcaps com 6,80% e BB Ações Bolsa Brasileira com
167 6,50%. Esse desempenho positivo deve-se, principalmente, à expectativa do corte de juros nos
168 EUA. Isso foi extremamente benéfico para a classe de ativos e, conseqüentemente, para a
169 nossa carteira. Nesse mês, a bolsa brasileira acompanhou o cenário global. Falas mais
170 comedidas do Campos Neto e de Galípolo, acenando que buscam formas de atingir o centro
171 da meta de juros, geraram um certo alívio. Assim sendo, toda a carteira do Macaeprev fechou



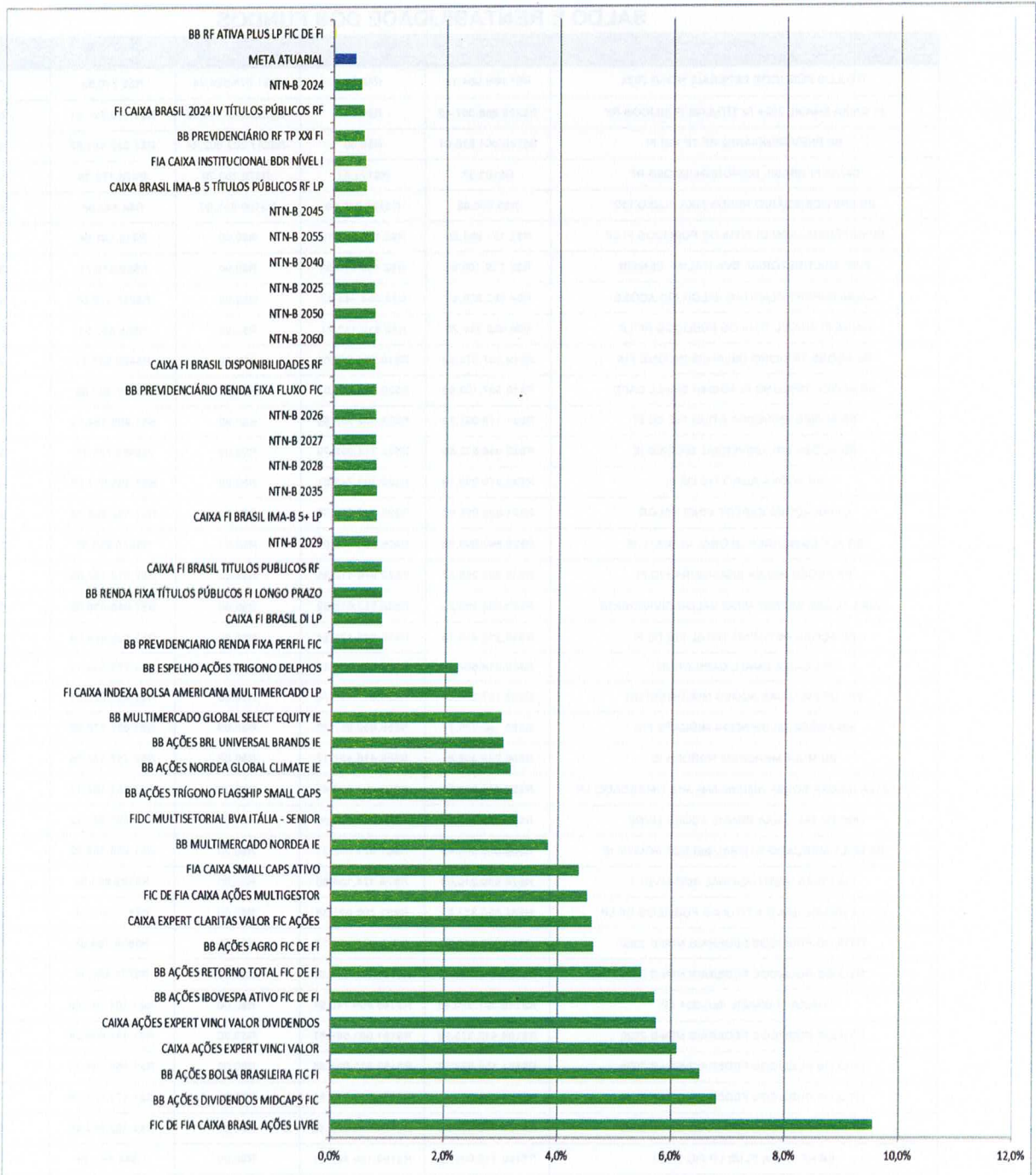
Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Comitê de Investimentos



172 no campo positivo. Dessa forma, como expressado nos relatórios anteriores, entendemos que
173 a taxa de retorno esperada em um prazo maior é bem interessante e que na renda variável, por
174 vezes, os retornos podem se materializar rapidamente, como no presente mês. Daí a
175 importância de mantermos nossa posição, justamente pela dificuldade de prever quando e com
176 que intensidade essa recuperação pode ocorrer. Por isso, reforçamos a importância de
177 permanecermos fiéis à alocação estratégica elaborada na Política Anual de Investimentos
178 (PAI). Isso nos manterá resilientes durante a jornada e nos ajudará a alcançar melhores
179 retornos a longo prazo. Os ativos e classes de ativos vão subir e cair ao longo da jornada, mas,
180 ao olhar para a carteira completa, veremos resultados significativos no longo prazo. Em
181 média, os fundos de ações brasileiras apresentaram rentabilidade de 5,33%. O fundo Caixa
182 Indexa Bolsa Americana com proteção cambial apresentou um retorno de 2,48%. Já o fundo
183 Caixa Institucional BDR teve um retorno de 0,57%. Os fundos de investimento no exterior
184 tiveram resultado médio de 3,24%. Os fundos de vértice FI Caixa Brasil 2024 e BB
185 Previdenciário RF TP XXI renderam 0,54%. As NTN-B 2024 renderam 0,49%, as NTN-B
186 2025 renderam 0,72%, as NTN-B 2026 renderam 0,74%, as NTN-B 2027 renderam 0,74%, as
187 NTN-B 2028 renderam 0,75%, as NTN-B 2029 renderam 0,77%, as NTN-B 2035 renderam
188 0,76%, as NTN-B 2040 renderam 0,72%, as NTN-B 2045 renderam 0,71%, as NTN-B 2050
189 renderam 0,73%, as NTN-B 2055 renderam 0,71% e as NTN-B 2060 renderam 0,73%. Em
190 média, as NTN-B ficaram com 0,71%. Os fundos de renda fixa indexados ao CDI
191 apresentaram uma rentabilidade média de 0,87%. O fundo de renda fixa com gestão ativa
192 rendeu 0,02%. O fundo IMA-B 5 teve um retorno de 0,58%. O fundo IMA-B 5+ teve retorno
193 de 0,76%. O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade positiva de 3,27%. Até
194 31/08/2024 foram resgatados o total de R\$ 10.132.155,67 (dez milhões e cento e trinta e dois
195 mil e cento e cinquenta e cinco reais e sessenta e sete centavos), mais de 100% do capital total
196 investido. O saldo em 31 de agosto estava em R\$ 2.188.485,55 (dois milhões e cento e oitenta
197 e oito mil e quatrocentos e oitenta e cinco reais e cinquenta e cinco centavos). O gráfico a
198 seguir mostra a comparação entre a rentabilidade dos fundos e a Meta Atuarial. Os fundos em
199 verde bateram a Meta Atuarial, os fundos em amarelo apresentaram resultado positivo, porém,
200 abaixo da Meta Atuarial e os fundos em vermelho tiveram resultado negativo.



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



201

202 O rendimento de agosto da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 61.444.177,41 (sessenta e
203 um milhões e quatrocentos e quarenta e quatro mil e cento e setenta e sete reais e quarenta e
204 um centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de agosto em R\$
205 4.588.530.100,77 (quatro bilhões e quinhentos e oitenta e oito milhões e quinhentos e trinta
206 mil e cem reais e setenta e sete centavos).



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



SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS

Fundo de Investimento	Saldo em 31/07/2024	Saldo em 30/08/2024	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2024	R\$1.069.984,12	R\$0,00	-R\$1.075.224,74	R\$5.240,63	0,49%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$219.266.387,48	R\$0,00	-R\$220.442.114,99	R\$1.175.727,51	0,54%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$246.061.620,61	R\$0,00	-R\$247.383.802,44	R\$1.322.181,83	0,54%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$103,33	R\$171,92	-R\$76.103,76	R\$76.172,35	0,73%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$6.850,65	R\$121.849,90	R\$106.555,80	R\$8.443,06	0,74%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	R\$2.131.964,55	R\$2.150.516,19	R\$0,00	R\$18.551,64	0,87%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$2.119.105,84	R\$2.188.485,55	R\$0,00	R\$69.379,71	3,27%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$4.682.966,49	R\$4.898.245,12	R\$0,00	R\$215.278,63	4,60%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$6.462.249,20	R\$6.518.132,71	R\$0,00	R\$55.883,51	0,86%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	R\$19.337.574,93	R\$19.764.522,04	R\$0,00	R\$426.947,11	2,21%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	R\$19.397.103,92	R\$20.014.441,01	R\$0,00	R\$617.337,09	3,18%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$21.118.631,35	R\$22.322.385,58	R\$0,00	R\$1.203.754,23	5,70%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	R\$22.048.572,66	R\$22.714.293,79	R\$0,00	R\$665.721,13	3,02%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$24.573.090,13	R\$25.708.742,01	R\$0,00	R\$1.135.651,88	4,62%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	R\$24.628.095,90	R\$26.130.989,68	R\$0,00	R\$1.502.893,78	6,10%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	R\$25.892.096,65	R\$26.708.030,01	R\$0,00	R\$815.933,36	3,15%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$30.963.266,57	R\$32.976.419,25	R\$0,00	R\$2.013.152,68	6,50%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	R\$46.204.155,29	R\$48.852.613,62	R\$0,00	R\$2.648.458,33	5,73%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$48.235.450,18	R\$50.875.103,24	R\$0,00	R\$2.639.653,06	5,47%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$49.914.687,99	R\$52.088.628,18	R\$0,00	R\$2.173.940,19	4,36%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$52.157.276,14	R\$54.511.198,75	R\$0,00	R\$2.353.922,61	4,51%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$53.302.880,71	R\$56.930.057,29	R\$0,00	R\$3.627.176,58	6,80%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$56.269.336,81	R\$58.416.487,17	R\$0,00	R\$2.147.150,36	3,82%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$57.746.894,71	R\$59.180.996,48	R\$0,00	R\$1.434.101,77	2,48%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$57.536.549,44	R\$63.026.946,66	R\$0,00	R\$5.490.397,22	9,54%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$66.005.309,49	R\$67.971.662,31	R\$0,00	R\$1.966.352,82	2,98%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$74.950.310,80	R\$75.374.134,60	R\$0,00	R\$423.823,80	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$81.230.373,87	R\$81.702.021,38	R\$0,00	R\$471.647,51	0,58%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2060	R\$89.926.947,00	R\$87.987.867,17	R\$0,00	R\$638.783,88	0,73%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2040	R\$103.141.746,12	R\$100.923.940,87	R\$0,00	R\$727.486,35	0,72%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	R\$145.301.379,46	R\$146.405.740,94	R\$0,00	R\$1.104.361,48	0,76%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2028	R\$154.442.375,98	R\$151.083.582,87	R\$0,00	R\$1.131.609,24	0,75%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2035	R\$151.155.823,73	R\$152.319.967,86	R\$0,00	R\$1.164.144,13	0,76%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2029	R\$151.164.553,20	R\$152.335.917,88	R\$0,00	R\$1.171.364,68	0,77%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2055	R\$188.583.064,66	R\$189.935.922,15	R\$0,00	R\$1.352.857,49	0,71%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	R\$199.115.001,02	R\$199.159.492,41	R\$0,00	R\$44.491,39	0,02%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2026	R\$208.183.744,23	R\$203.672.283,20	R\$0,00	R\$1.514.100,87	0,74%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2045	R\$272.226.630,66	R\$274.173.220,79	R\$0,00	R\$1.946.590,13	0,71%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2050	R\$298.412.320,90	R\$291.980.561,76	R\$0,00	R\$2.117.190,20	0,73%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$118.704.841,89	R\$341.075.076,47	R\$220.518.218,75	R\$1.852.015,83	0,87%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2027	R\$352.019.377,75	R\$354.627.025,00	R\$0,00	R\$2.607.647,25	0,74%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2025	R\$434.336.618,32	R\$437.496.178,28	R\$0,00	R\$3.159.559,96	0,72%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$343.743.959,60	R\$624.206.248,68	R\$276.255.188,93	R\$4.207.100,15	0,88%
TOTAL	R\$4.623.771.274,33	R\$4.688.630.100,77	R\$27.902.717,66	R\$61.444.177,41	1,36%



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



208 **DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA**
209 **ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024**
210

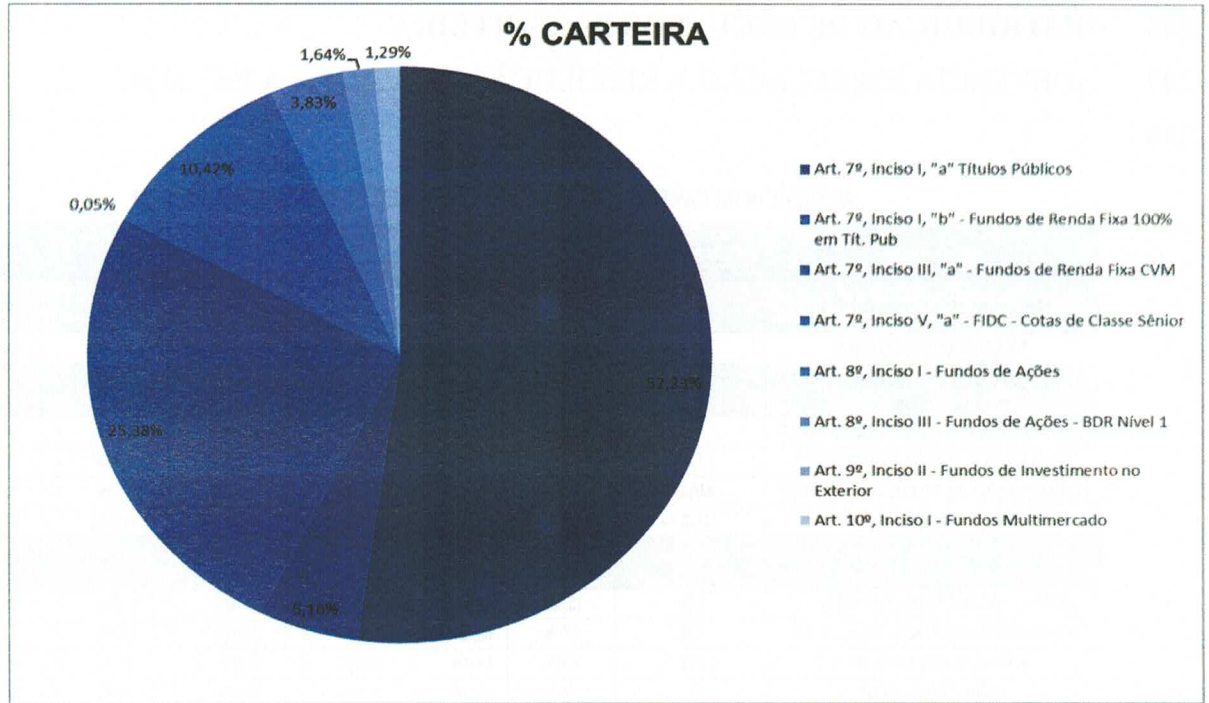
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total
Art. 7º, Inciso I, "a" Títulos Públicos		52,23%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	Não se Aplica	R\$2.396.536.467,83
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	IPCA+	52,23%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	NA	R\$2.396.536.467,83
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		5,16%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$236.776.411,22
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	CDI	0,05%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,01% ✓	R\$2.150.516,19
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	0,14%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,06% ✓	R\$6.518.132,71
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	1,78%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,15% ✓	R\$81.702.021,38
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	IMA-B 5+	3,19%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	11,48% ✓	R\$146.405.740,94
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		25,38%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$1.164.562.839,38
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	13,60%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	3,08% ✓	R\$624.206.248,68
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$121.849,90
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	CDI	4,34%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	4,53% ✓	R\$199.159.492,41
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	7,43%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	1,83% ✓	R\$341.075.076,47
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$171,92
Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior		0,05%	5,00% ✓	0,20% ✓	20,00% ✓	5,00% ✓	R\$2.188.485,55
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,05%	5,00% ✓	0,20% ✓	20,00% ✓	3,64% ✓	R\$2.188.485,55
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		10,42%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$478.100.292,43
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,49%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	15,04% ✗	R\$22.322.385,58
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,72%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	15,54% ✗	R\$32.976.419,25
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,56%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	11,35% ✓	R\$25.708.742,01
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,11%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	6,95% ✓	R\$50.875.103,24
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	1,24%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	6,92% ✓	R\$56.930.057,29
BB AÇÕES TRIGONO DELPHOS INCOME FIA	IDIV	0,43%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	10,64% ✓	R\$19.764.522,04
BB AÇÕES TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	SMLL	0,44%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	36,97% ✓	R\$20.014.441,01
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	IBOVESPA	0,57%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	3,19% ✓	R\$26.130.989,68
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	IDIV	1,06%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	4,46% ✓	R\$48.852.613,62
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,11%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	17,20% ✓	R\$4.898.245,12
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,14%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	8,25% ✓	R\$52.088.628,18
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,19%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	9,82% ✓	R\$54.511.198,75
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,37%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	8,73% ✓	R\$63.026.946,66
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		1,64%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$75.374.134,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,64%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	2,83% ✓	R\$75.374.134,60
Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior		3,83%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$175.810.473,28
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	1,48%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	4,08% ✓	R\$67.971.662,31
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	MSCI WORLD	0,58%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	7,62% ✓	R\$26.708.030,01
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	MSCI WORLD	0,50%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	11,38% ✓	R\$22.714.293,79
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	1,27%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	41,48% ✓	R\$58.416.487,17
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		1,29%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$59.180.996,48
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,29%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	3,05% ✓	R\$59.180.996,48
Total:							R\$4.588.530.100,77

211

[Handwritten signatures and initials]

[Handwritten signatures and initials]



212

213

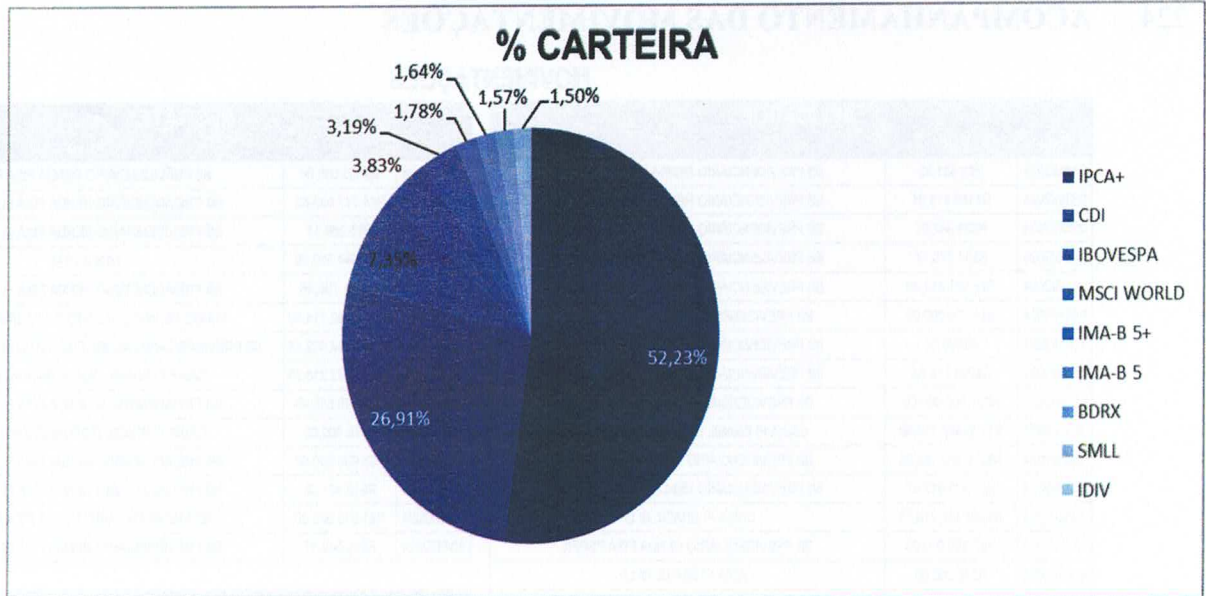
214 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

215

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/08/2024	Participação
IPCA+	R\$2.396.536.467,83	52,23%
CDI	R\$1.234.600.970,31	26,91%
IBOVESPA	R\$337.380.087,58	7,35%
MSCI WORLD	R\$175.810.473,28	3,83%
IMA-B 5+	R\$146.405.740,94	3,19%
IMA-B 5	R\$81.702.021,38	1,78%
BDRX	R\$75.374.134,60	1,64%
SMLL	R\$72.103.069,19	1,57%
IDIV	R\$68.617.135,66	1,50%
Total	R\$4.588.530.100,77	100,00%

216



217

218

219 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

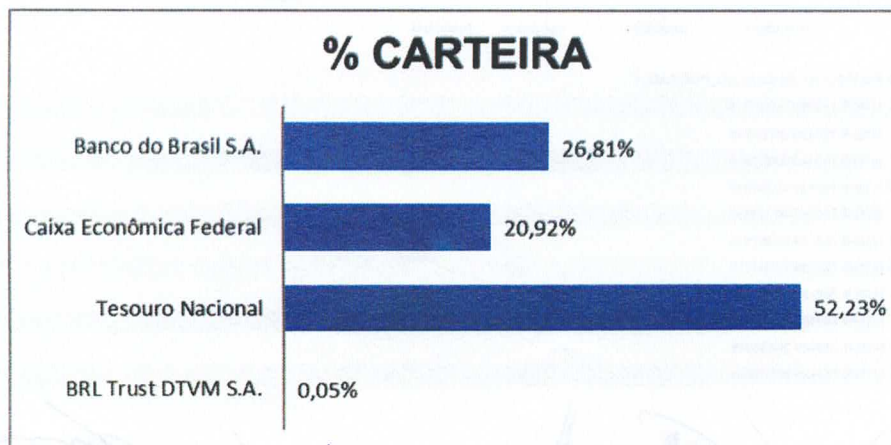
220

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$2.188.485,55	0,05%
Tesouro Nacional	R\$2.396.536.467,83	52,23%
Caixa Econômica Federal	R\$959.764.896,51	20,92%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.230.040.250,88	26,81%

221

222



223



224 ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

MOVIMENTAÇÕES

APLICAÇÕES		
Data	Valor	
01/08/2024	R\$3.531,92	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
02/08/2024	R\$150.816,81	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
05/08/2024	R\$38.942,87	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
06/08/2024	R\$11.778,17	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
08/08/2024	R\$4.581.412,38	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
09/08/2024	R\$4.785.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
12/08/2024	R\$995,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
13/08/2024	R\$294.715,54	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
15/08/2024	R\$25.960.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
16/08/2024	R\$220.442.114,99	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
16/08/2024	R\$239.870.188,93	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
16/08/2024	R\$7.513.613,51	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
19/08/2024	R\$220.442.218,75	CAIXA FI BRASIL DI LP
19/08/2024	R\$7.500.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
20/08/2024	R\$76.000,00	CAIXA FI BRASIL DI LP
20/08/2024	R\$17.212,68	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
21/08/2024	R\$229,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
22/08/2024	R\$6,68	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
23/08/2024	R\$9.667.983,79	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
28/08/2024	R\$109.581,56	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
29/08/2024	R\$1.389,88	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

RESGATES		
Data	Valor	Ativo
02/08/2024	R\$850.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
09/08/2024	R\$4.777.935,62	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
14/08/2024	R\$5.480,11	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
15/08/2024	R\$1.044.350,59	NTN-B 2024
15/08/2024	R\$296.706,46	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/08/2024	R\$220.442.114,99	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024
16/08/2024	R\$247.383.802,44	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS XXI
19/08/2024	R\$220.442.218,75	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
19/08/2024	R\$7.499.538,49	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
20/08/2024	R\$76.000,00	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
28/08/2024	R\$9.630.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
27/08/2024	R\$15.451,35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
30/08/2024	R\$1.010.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
30/08/2024	R\$60.542,17	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

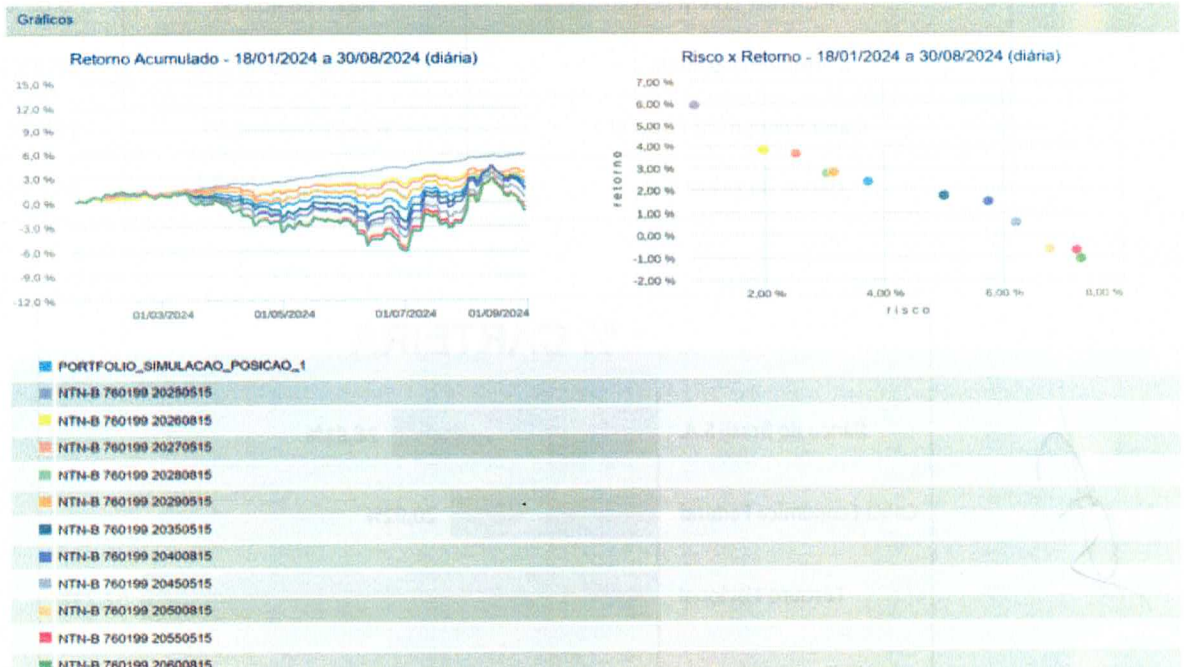
TOTAL DAS AMORTIZAÇÕES	
NTN-BS	R\$24.618.943,06

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$741.467.733,06
Resgates	-R\$713.534.140,97
Saldo	R\$27.933.592,09

225

226 MONITORAMENTO DE RISCOS

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



228

229

[Handwritten signatures and initials]

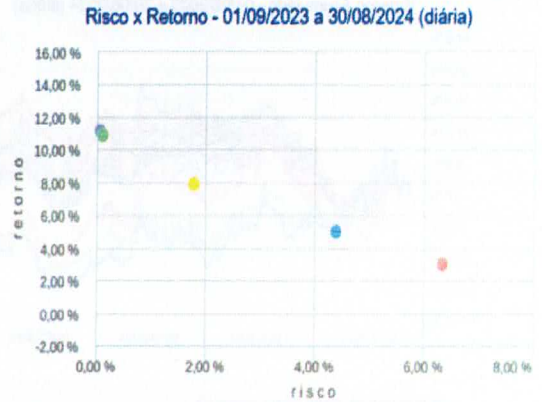


Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Comitê de Investimentos



230 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

231
232

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

Gráficos



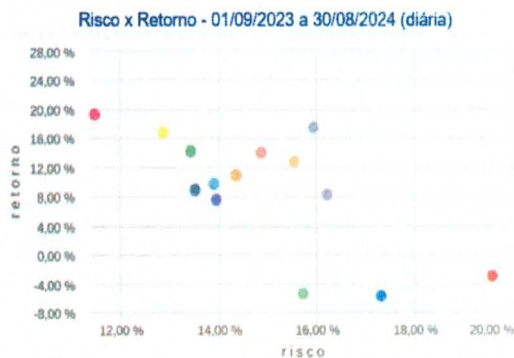
- PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
- BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP
- BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO
- BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP
- CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES
- CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP

234



235 ART. 8º, INCISO I – FUNDOS DE AÇÕES

Gráficos

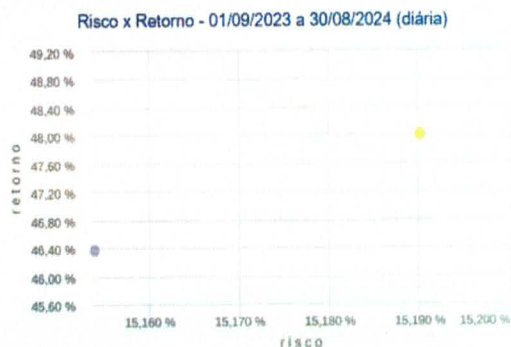


- PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
- BB AGRO FIC AÇÕES
- BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES
- BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES
- BB ESPELHO AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES
- BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES
- BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES
- CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES
- CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES
- CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES
- CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES
- CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES
- CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES
- TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS MASTER FI AÇÕES

236

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

Gráficos



- PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
- CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I
- Global BDRX

238



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



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

Gráficos



- PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
- BB BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES
- BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO
- BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES
- BB NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO

240

241 ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO

Gráficos



- PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
- CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP
- CDI

242

243

[Handwritten signatures and marks]



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



244 ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS E VALUE AT RISK (VAR)

245

ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS

Fundo de Investimento	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	VaR 21du 95%
CDI	0,86%	7,09%	2,58%	5,22%	11,21%	26,28%	
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,87%	7,07%	2,58%	5,21%	11,15%	26,18%	0,03%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,86%	6,87%	2,57%	5,04%	10,90%	25,87%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,89%	7,21%	2,67%	5,33%	11,31%	26,38%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	0,78%	6,39%	2,33%	4,70%	10,11%	23,81%	0,03%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	0,02%	7,57%	1,30%	4,73%	8,79%	21,92%	0,53%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,88%	7,32%	2,69%	5,39%	11,61%	26,96%	0,03%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,77%	6,37%	2,31%	4,68%	10,10%	23,10%	0,03%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	3,27%	0,77%	2,86%	-0,64%	209,53%	172,86%	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	2,48%	21,24%	7,94%	12,80%	30,88%	61,90%	1,73%
IMA-B 5	0,59%	4,88%	1,90%	3,55%	8,14%	21,08%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	0,52%	4,66%	1,80%	3,38%	7,84%	20,50%	0,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,58%	4,74%	1,86%	3,45%	7,92%	20,66%	0,20%
IMA-B	0,51%	1,49%	1,62%	1,39%	5,31%	19,81%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	0,50%	1,33%	1,56%	1,26%	5,08%	19,27%	0,51%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54%	4,35%	2,69%	5,38%	7,77%	13,25%	-
IMA-B 5+	0,77%	-1,21%	1,69%	-0,25%	3,11%	18,58%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	0,76%	-1,30%	1,65%	-0,34%	3,06%	17,99%	0,53%
IPCA + 5%	0,41%	6,27%	1,78%	4,07%	9,47%	20,16%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,92%	7,74%	3,09%	5,79%	11,28%	23,61%	0,02%
IBOVESPA	6,54%	1,35%	11,38%	5,28%	17,50%	24,18%	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	5,70%	-3,02%	10,22%	1,57%	10,79%	14,73%	0,99%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	6,50%	0,89%	11,24%	5,05%	16,66%	22,65%	0,88%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	4,62%	-1,26%	8,09%	3,49%	8,20%	5,45%	1,59%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	5,47%	-4,76%	10,69%	-0,06%	8,83%	1,51%	0,87%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	6,80%	2,46%	10,02%	1,70%	13,82%	26,58%	1,00%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	6,10%	-0,19%	10,95%	3,04%	14,19%	16,80%	1,02%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	4,59%	2,48%	9,39%	4,30%	12,56%	15,43%	1,37%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	4,51%	-2,59%	8,56%	0,88%	7,56%	8,51%	1,21%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	9,54%	2,74%	10,18%	3,26%	17,40%	26,10%	1,13%
IDIV	6,68%	5,00%	10,86%	7,78%	21,93%	34,90%	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	5,73%	5,17%	10,79%	6,59%	19,13%	30,17%	0,90%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	2,20%	-7,07%	6,07%	0,40%	-5,41%	0,00%	1,69%
SMLL	4,47%	-9,69%	5,61%	-4,36%	-2,21%	-4,10%	
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	3,18%	-5,35%	8,54%	0,64%			1,48%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	4,35%	-10,14%	5,38%	-4,17%	-3,06%	-5,30%	1,92%
BDRX	0,65%	21,75%	5,40%	10,89%	28,78%	56,70%	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,56%	41,01%	13,94%	26,91%	46,37%	68,28%	1,86%
MSCI WORLD	2,51%	15,53%	6,01%	8,89%	23,05%	35,87%	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	2,98%	35,37%	13,84%	23,58%	43,79%	60,62%	2,44%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	3,15%	28,88%	11,81%	22,30%	31,99%	31,27%	2,58%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	3,02%	9,72%	7,89%	4,99%	14,45%	35,12%	0,64%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	3,82%	24,95%	15,88%	21,25%	26,23%	33,86%	1,76%
MSCI ACWI	2,40%	14,67%	5,86%	8,67%	21,79%	32,77%	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	2,28%	15,12%	5,60%	9,46%	20,11%	38,26%	1,48%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	2,21%	17,80%	7,02%	9,90%	25,16%	37,13%	
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,40%	31,35%	10,76%	17,87%	36,69%	53,28%	1,86%
S&P 500	2,28%	18,41%	7,02%	9,95%	25,30%	42,81%	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1,74%	19,98%	7,29%	12,11%	28,27%	52,76%	1,38%

246
247



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



248 **RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO**

249 **RENTABILIDADE**

250 A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,84% no mês de agosto,
251 totalizando um saldo de R\$ 245.178.746,36 (duzentos e quarenta e cinco milhões e cento e
252 setenta e oito mil e setecentos e quarenta e seis reais e trinta e seis centavos). **ADERÊNCIA**
253 **EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024**

254

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 Tít. Pub		54,32%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$133.187.750,45
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	IRF-M 1	28,90%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,84%	✓	R\$70.856.267,41
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	0,09%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,00%	✓	R\$229.374,87
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2A	10,37%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,48%	✓	R\$25.418.469,71
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	7,94%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,40%	✓	R\$19.468.743,75
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	IRF-M	7,02%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,49%	✓	R\$17.214.894,71
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		33,48%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$82.079.999,08
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COT	CDI	5,41%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,07%	✓	R\$13.269.730,54
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	CDI	0,18%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,01%	✓	R\$435.276,54
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,00%	✓	R\$1.488,07
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	27,89%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	1,06%	✓	R\$68.373.503,93
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		12,20%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$29.910.996,83
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,20%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	2,39%	✓	R\$29.910.996,83
Total: R\$245.178.746,36											

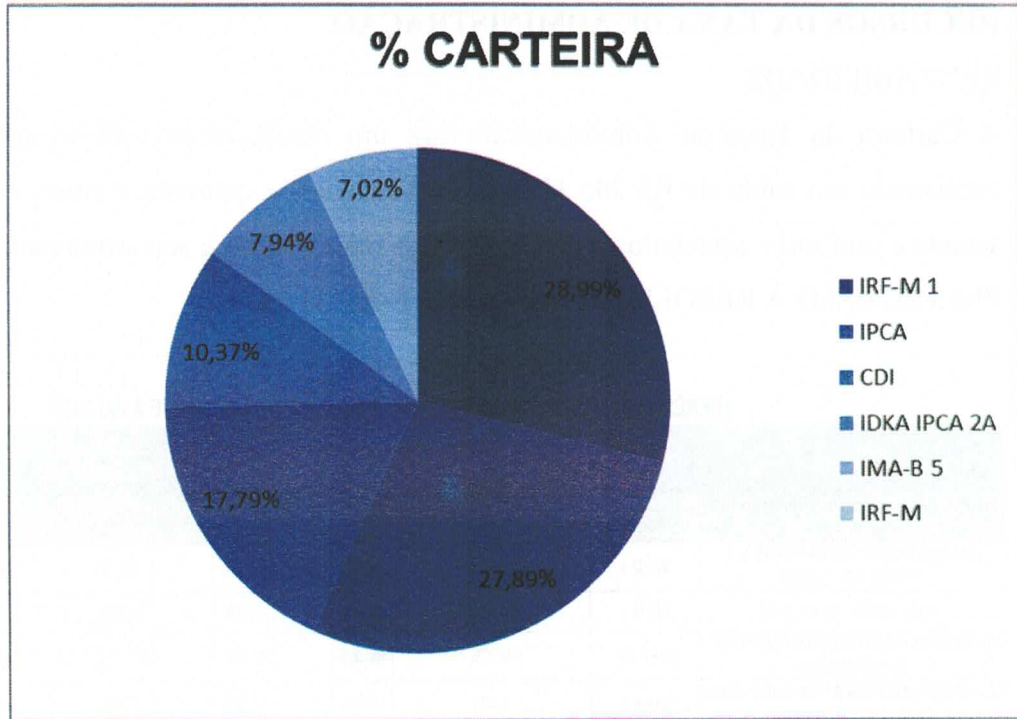
255

256 **DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/08/2024	Participação
IRF-M 1	R\$71.085.642,28	28,99%
IPCA	R\$68.373.503,93	27,89%
CDI	R\$43.617.491,98	17,79%
IDKA IPCA 2A	R\$25.418.469,71	10,37%
IMA-B 5	R\$19.468.743,75	7,94%
IRF-M	R\$17.214.894,71	7,02%
	R\$245.178.746,36	100,00%

257



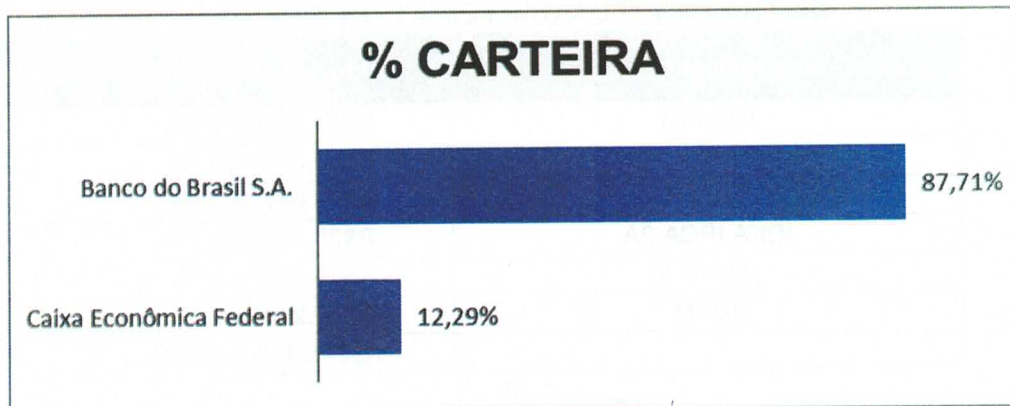
258
259
260
261

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$30.141.859,77	12,29%
Banco do Brasil S.A.	R\$215.036.886,59	87,71%

262
263



264

264

[Handwritten signatures and marks]



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



265 RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

266 RENTABILIDADE

267 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado
268 positivo de 1,17% e fechou o mês com o saldo de R\$ 29.611.916,66 (vinte e nove milhões e
269 seiscentos e onze mil e novecentos e dezesseis reais e sessenta e seis centavos).

270 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 Tít. Pub		58,51%	100,00%	50,00%	100,00%	100,00%	R\$17.326.421,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	6,51%	100,00%	50,00%	100,00%	0,02%	R\$1.927.571,62
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	6,68%	100,00%	50,00%	100,00%	0,02%	R\$1.976.745,88
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	15,18%	100,00%	50,00%	100,00%	0,10%	R\$4.496.553,68
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	15,26%	100,00%	50,00%	100,00%	0,09%	R\$4.517.494,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	14,89%	100,00%	50,00%	100,00%	0,10%	R\$4.408.055,51
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		15,51%	65,00%	65,00%	20,00%	15,00%	R\$4.593.382,93
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,51%	65,00%	65,00%	20,00%	0,07%	R\$4.593.382,93
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		7,06%	35,00%	25,00%	20,00%	15,00%	R\$2.090.894,64
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	IBOVESPA	1,60%	35,00%	25,00%	20,00%	0,06%	R\$473.969,91
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,19%	35,00%	25,00%	20,00%	0,05%	R\$352.539,43
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,86%	35,00%	25,00%	20,00%	0,08%	R\$551.986,59
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,37%	35,00%	25,00%	20,00%	0,07%	R\$406.637,58
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,03%	35,00%	25,00%	20,00%	0,05%	R\$305.761,13
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		10,77%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	R\$3.189.709,94
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	5,22%	10,00%	10,00%	20,00%	0,10%	R\$1.544.528,37
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	5,56%	10,00%	10,00%	20,00%	0,06%	R\$1.645.181,57
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		8,14%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	R\$2.411.507,52
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	2,53%	10,00%	10,00%	20,00%	0,72%	R\$750.648,84
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,50%	10,00%	10,00%	20,00%	0,38%	R\$738.819,94
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	3,11%	10,00%	10,00%	20,00%	0,05%	R\$922.038,74
Total:							R\$29.611.916,66

271

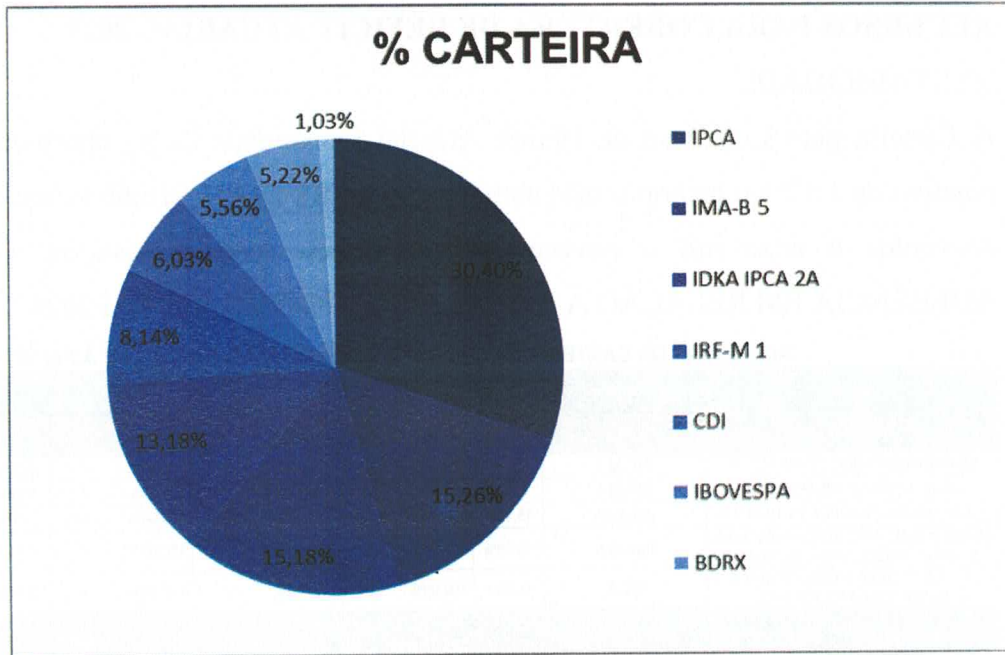
272

273 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/08/2024	Participação
IPCA	R\$9.001.438,44	30,40%
IMA-B 5	R\$4.517.494,94	15,26%
IDKA IPCA 2A	R\$4.496.553,68	15,18%
IRF-M 1	R\$3.904.317,50	13,18%
CDI	R\$2.411.507,52	8,14%
IBOVESPA	R\$1.785.133,51	6,03%
BDRX	R\$1.645.181,57	5,56%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.544.528,37	5,22%
SMLL	R\$305.761,13	1,03%
	R\$29.611.916,66	100,00%

274



275

276

277 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

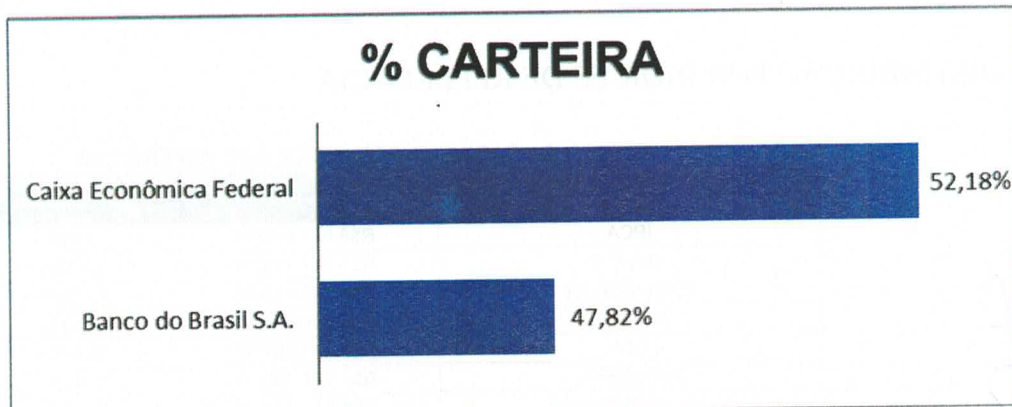
278

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$14.160.136,04	47,82%
Caixa Econômica Federal	R\$15.451.780,62	52,18%

279

280



9

281

282

[Handwritten signatures and marks]



283 **RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022**

284 **RENTABILIDADE**

285 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de
286 0,95% e fechou o mês com o saldo de R\$ 21.153.276,78 (vinte e um milhões e cento e
287 cinquenta e três mil e duzentos e setenta e seis reais e setenta e oito centavos). **ADERÊNCIA**
288 **EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024**

289

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 III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		100,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$21.153.276,78
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	100,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,10% ✓	R\$21.153.276,78
Total:							R\$21.153.276,78

290

291

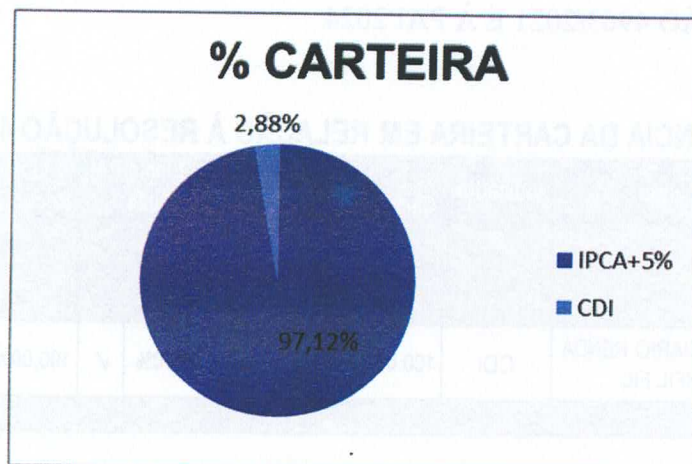
292 **DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/08/2024	Participação
CDI	R\$21.153.276,78	100,00%
	R\$21.153.276,78	100,00%

293

294



295

296

297

298



299 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

300

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$21.153.276,78	100,00%

301

302



303

304

305 **RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023**

306 RENTABILIDADE

307 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um resultado de
308 0,95% e fechou o mês com o saldo de R\$ 36.021.048,50 (trinta e seis milhões e vinte e um
309 mil e quarenta e oito reais e cinquenta centavos). **ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À**
310 **RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024**

311

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 III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$36.021.048,50
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,18% ✓	R\$36.021.048,50
Total:							R\$36.021.048,50

312

313

314

315

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

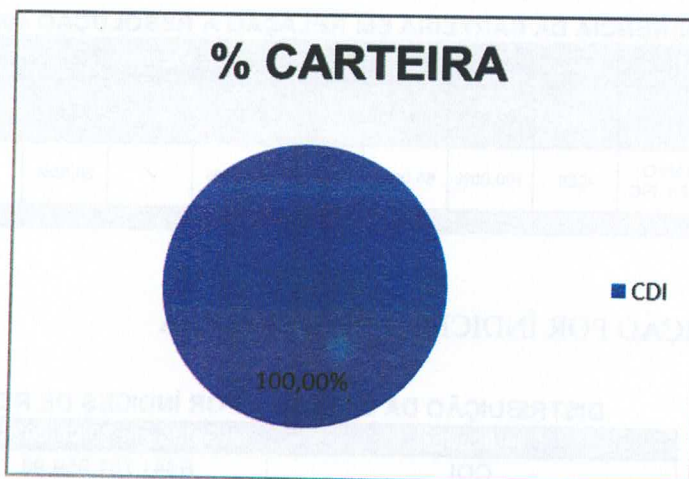


316 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 30/08/2024	Participação
CDI	R\$36.021.048,50	100,00%
	R\$36.021.048,50	100,00%

317

318



319

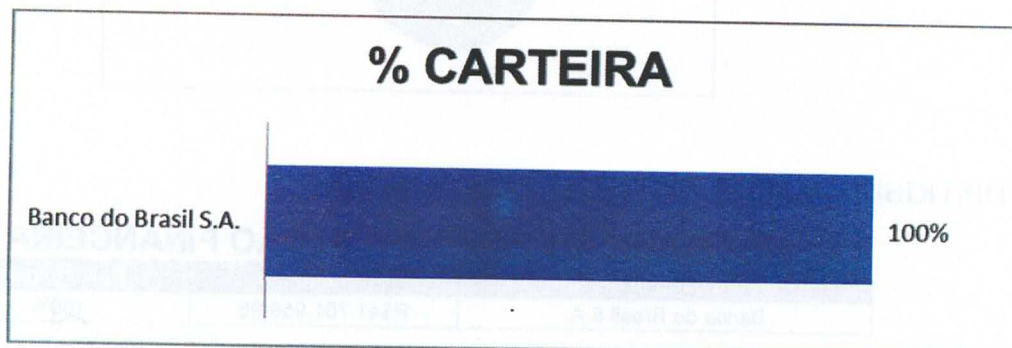
320

321 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$36.021.048,50	100%

322

323



324

325

326

327



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



328 RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2024

329 RENTABILIDADE

330 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2024) apresentou um resultado de
331 0,89% e fechou o mês com o saldo de R\$ 41.701.959,98 (quarenta e um milhões e setecentos
332 e um mil e novecentos e cinquenta e nove reais e noventa e oito centavos). ADERÊNCIA
333 EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		100,00%	100,00%	50,00%	100,00%	100,00%	R\$41.701.959,98
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	100,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,21%	R\$41.701.959,98
Total:							R\$41.701.959,98

334

335

336 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 30/08/2024	Participação
CDI	R\$41.701.959,98	100,00%
	R\$41.701.959,98	100,00%

337



338

339

340 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$41.701.959,98	100%

341



342



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



- 343 CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES
344 TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE
345 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 DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	2,00%	0,00%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	1,00%	0,00%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	1,00%	0,00%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	2,00%	0,00%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	0,08%	0,00%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	0,08%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	2,00%	20% do que excede 100% do Ibovespa
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	1,00%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5+ LP	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,20%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,80%	0,00%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,20%	0,00%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	0,80%	0,00%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,70%	0,00%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1,50%	0,00%
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	0,40%	0,00%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	1,50%	0,00%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	1,25%	0,00%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	2,00%	0,00%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20%	0,00%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,10%	0,00%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	0,20%	0,00%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	0,00%	0,00%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	0,90%	0,00%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	0,30%	0,00%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	2,00%	20% do que excede 100% do SMLL
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	0,60%	0,00%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	2,00%	20% do que excede 100% do IDIV
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	1,72%	0,00%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	1,72%	0,00%

346

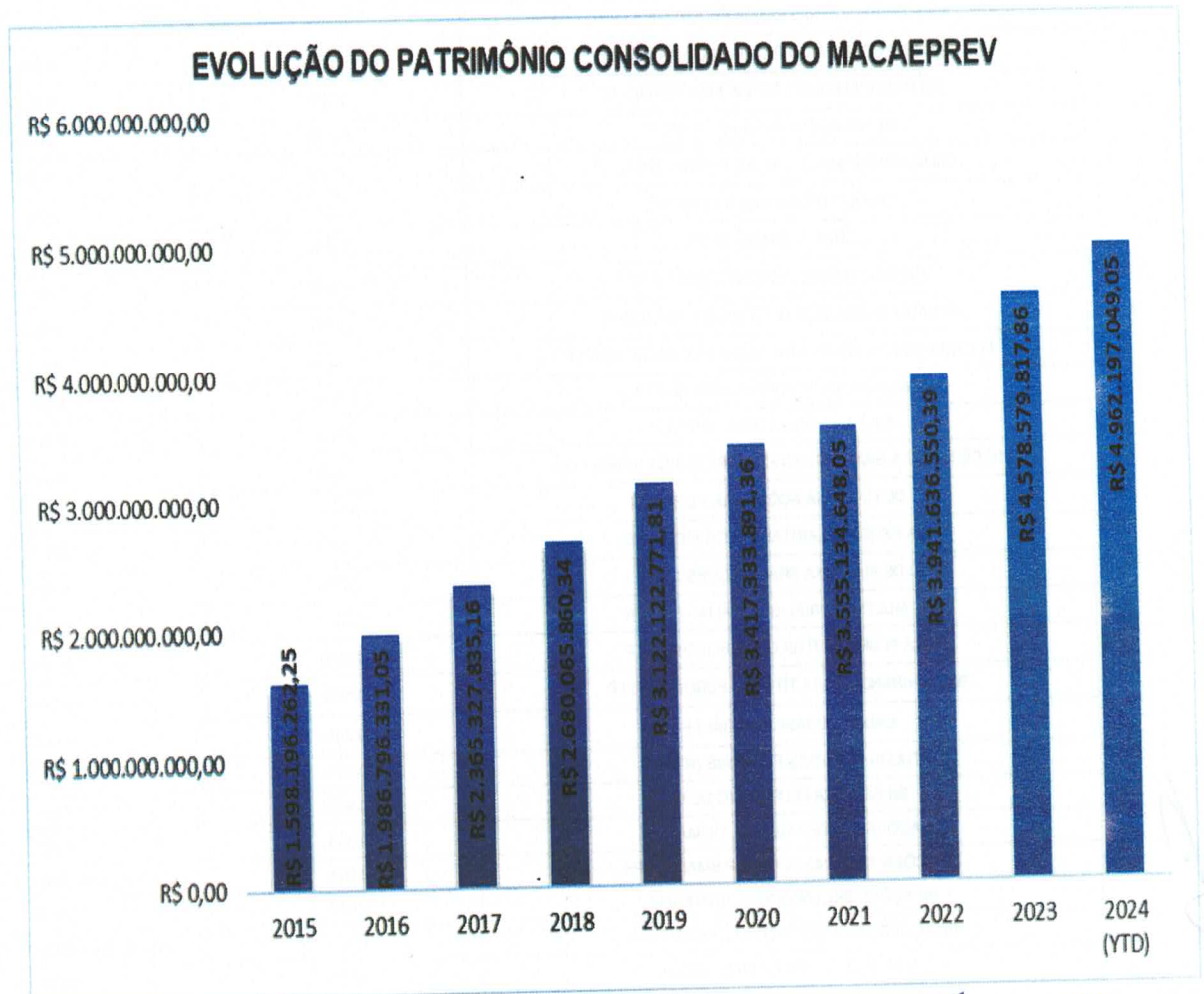


347 CUSTO SELIC PARA OS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS
348

CUSTOS SELIC		
Ativos	Patrimônio (R\$)	SELIC
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	R\$ 2.396.536.467,83	R\$ 6.608,57

349
350
351
352
353
354
355

CONCLUSÃO: O Macaeprev encerrou o mês de agosto de 2024 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 4.962.197.049,05 (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.





356



357 **II – APROVAÇÃO DO RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS AGOSTO DE 2024:**
358 Após a apresentação do relatório, por unanimidade, os membros do Comitê de Investimentos
359 aprovaram o Relatório de Investimentos referente ao mês de agosto de 2024, o qual o termo
360 segue anexo a esta ata. **III – CONVITE APRESENTAÇÃO RELATÓRIO DE**
361 **GOVERNANÇA COPORTARIA 2023 – PRÓ-GESTÃO:** Pelo Presidente do Instituto e
362 membro *Claudio Duarte* foi convidado a todos os membros deste Comitê para a Audiência
363 Pública para apresentação do Relatório de Governança Corporativa de 2023 para
364 cumprimento do nosso PRÓ-GESTÃO que será realizada de forma online no dia 08/10/2024
365 as 15:00 através de link que será distribuído posteriormente. Gostaria de contar com a
366 presença de todos. **IV - ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi
367 encerrada às dezoito horas e vinte minutos, tendo a ata sido lida e assinada por todos os
368 presentes.

369
370 COMITÊ DE INVESTIMENTOS:

371 
372 **Alfredo Tanos Filho**

373 
374 **Erenildo Motta da Silva Júnior**

375 
376 **Jose Eduardo da Silva Guinâncio**

377 
378 **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
Comitê de Investimentos

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e cinco dias do mês de setembro 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 **agosto** de 2024;


Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos que segue na íntegra na ata do dia de hoje: **25 de setembro de 2024**.


Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de **agosto de 2024**, e que foram devidamente fundamentadas e registradas nas atas de reunião do Comitê.

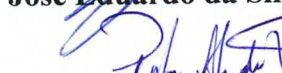
Considerando, por fim, que os investimentos são aderentes a Política Anual de Investimentos (PAI) do Macaeprev para o ano de 2024 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução CMN nº 4.963, **APROVAMOS** o relatório apresentado referente a **AGOSTO de 2024**, o qual segue para aprovação do Conselho Fiscal. É o parecer.

COMITÊ DE INVESTIMENTOS:

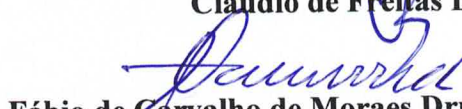

Alfredo Tanos Filho


Erenildo Motta da Silva Júnior


José Eduardo da Silva Guinâncio


Patric Alves de Vasconcelos


Claudio de Freitas Duarte


Fábio de Carvalho de Moraes Drumond


Miriam Amaral Queiroz


Viviane da Silva Lourenço Campos