



1 ATA n.º 28/2024 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 21/06/2024 – 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 um de junho 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, de forma online  
12 através do aplicativo de reunião *Google Meets*, foram discutidos os seguintes assuntos a  
13 seguir: **I - RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS – MAIO DE 2024: INTRODUÇÃO:**  
14 Mantendo elevados níveis de transparência e para manter boa comunicação junto aos  
15 servidores e munícipes, o Instituto de Previdência Social do Município de Macaé –  
16 MACAEPREV apresenta o relatório de investimentos, referente ao mês de maio de 2024.  
17 Neste relatório é possível observar a consolidação de todas as informações relativas ao  
18 período de referência, incluindo o cenário econômico, os resultados alcançados em relação às  
19 metas estabelecidas, o comportamento dos ativos financeiros que compõe a carteira de  
20 investimentos do MACAEPREV, inclusive quanto aos indicadores de desempenho e  
21 gerenciamento de riscos. **CENÁRIO ECONÔMICO:** O mês de maio marcou um período de  
22 recuperação das carteiras de investimentos, depois das dificuldades encontradas em abril. Os  
23 investimentos no exterior continuaram apresentando bons resultados, impulsionados pela  
24 valorização do dólar em relação ao real e pelo desempenho positivo dos índices globais. No  
25 front geopolítico, a repercussão do conflito no oriente médio diminuiu em maio, após o  
26 aumento da tensão entre o Irã e Israel em abril, com a investida iraniana em retaliação ao  
27 ataque israelense ao consulado iraniano na Síria. Além disso, a guerra da Ucrânia completa 28  
28 meses, sem perspectivas de avanço nas negociações diplomáticas. Nos EUA, o mês de maio  
29 trouxe leituras mistas para o cenário de crescimento, com vendas no varejo e o dado agregado  
30 do consumo (PCE) mais fracos do que o esperado para abril, mas um Índice de Gerentes de  
31 Compras (PMI) sugerindo uma retomada do crescimento já em maio. O PMI Composto de  
32 produção dos EUA, que acompanha os setores de manufatura e de serviços, caiu de 52,1 em

1





33 março para 50,9 em abril. Ou seja, um componente mostrando quase uma contração, mas  
34 ainda acima dos 50, o que indica expansão no setor privado. O consumo agregado recuou -  
35 0,05% m/m em abril, abaixo das expectativas (0,1% m/m), sugerindo um início de trimestre  
36 com uma demanda mais tímida. Com os resultados, o consumo americano apresenta um  
37 carregado de 1,3% t/t anualizado para o 2T24, levemente abaixo dos 1,99% verificados no  
38 1T24. Apesar da desaceleração, não significa que a economia norte americana está fraca. A  
39 primeira leitura do Produto Interno Bruto (PIB) no primeiro trimestre mostrou um  
40 crescimento de 1,6%, com expectativa de 2,9%. A inflação medida pelo índice CPI em abril  
41 apresentou crescimento de 0,3% (M/M) ante 0,4% (M/M) em março. Com o dado, o índice  
42 acumulado em 12 meses reduziu de 3,5% para 3,4% (A/A). Já a inflação medida pelo PCE de  
43 abril apresentou crescimento de 0,3% (M/M) pelo terceiro mês consecutivo, com estabilidade  
44 da inflação anualizada em 2,7%. No mês de abril, o *payroll* registrou um aumento de 175 mil  
45 empregos, número abaixo da expectativa de mercado (+238 mil), refletindo uma  
46 desaceleração do setor de serviços, além da forte desaceleração das contratações pelo  
47 governo. Em sua reunião de maio, o *Federal Open Market Committee* (FOMC) decidiu  
48 novamente por manter os juros básicos estáveis no intervalo de 5,25% a 5,50% ao ano, em  
49 linha com o consenso do mercado. A ata do FOMC revela que o comitê se posicionava com  
50 preocupação ante as surpresas inflacionárias no 1T24. A sequência de dados divulgados desde  
51 a reunião de maio mostrou um cenário mais favorável ao mandato do Federal Reserve (Fed),  
52 com acomodação do mercado de trabalho e uma inflação mais benigna em abril. Nesse  
53 sentido, a comunicação recente revela um FOMC “cautelosamente otimista” (como citado  
54 pelo vice-chair Jefferson), entendendo que o progresso na desinflação pode ter voltado,  
55 embora a maioria dos membros ainda precise ver mais dados nessa direção e uma desinflação  
56 mensal adicional para construir a confiança necessária para uma redução da taxa de juros. O  
57 risco de uma retomada do ciclo de alta de juros ficou para trás e os membros do comitê  
58 entendem que a política está restritiva, ainda que demorando mais do que o esperado para  
59 direcionar a inflação novamente para a meta. Na China, por sua vez, o *People's Bank of*  
60 *China* (PBoC) informou que manteve estáveis as suas taxas de empréstimo (*Loan Prime Rate*  
61 - LPR), com a taxa de um ano em 3,45% e a de 5 anos em 3,95%, conforme amplamente  
62 esperado pelo mercado. A economia chinesa continua mostrando uma trajetória mista de  
63 crescimento no curto prazo. A produção industrial avançou 6,7% a/a em abril, acima do  
64 consenso (5,5% a/a), mais uma vez puxada pelos setores automotivo e de eletrônicos. Por

(a)





65 outro lado, os setores industriais ligados ao setor imobiliário, como produção de aço e  
66 cimento, mostraram forte recuo no mês (-7,2% e -8,6% a/a, respectivamente). Por sua vez, as  
67 vendas no varejo cresceram apenas 2,3% a/a, abaixo do esperado (3,7%) e bem abaixo da  
68 meta estabelecida para a economia como um todo, mostrando que a demanda doméstica deve  
69 contribuir menos para os objetivos do governo para o ano. Quanto ao setor imobiliário, os  
70 investimentos no segmento recuaram 9,8% a/a, um pouco pior que a queda de 9,6% esperada,  
71 refletindo as persistentes dificuldades do setor. Na sequência da comunicação do Politburo no  
72 final de abril, o mês de maio voltou a revelar políticas de suporte ao setor imobiliário. O país  
73 eliminou a taxa mínima de hipoteca, reduziu os pagamentos iniciais e instruiu os governos  
74 locais a comprarem o estoque de casas. Para tanto, o novo programa conta com 21 bancos  
75 elegíveis para participar do programa de realocação e emprestar a empresas estatais locais  
76 selecionadas por governos regionais. Para cada empréstimo que os bancos estenderem ao  
77 projeto, o PBOC fornecerá o equivalente a 60% do principal do empréstimo, atingindo US\$  
78 41,5 bilhões. Os fundos de realocação têm um prazo de um ano, a uma taxa de 1,75%, mas  
79 permitem quatro renovações. Por outro lado, as LGFVs, empresas estatais locais envolvidas  
80 com elevada dívida, serão impedidas de comprar imóveis. Os imóveis adquiridos devem ser  
81 usados para habitação pública, seja para venda ou aluguel. Algumas cidades já anunciaram  
82 medidas, com destaque para Xangai e Shenzhen. Por fim, a China segue enfrentando um  
83 ambiente comercial adverso. Os EUA anunciaram a elevação de tarifas para diversos itens  
84 chineses, incluindo veículos elétricos, baterias, células solares, chips, guindastes de cais, e  
85 certos tipos de aço, alumínio, minerais críticos e suprimentos médicos. O aumento tarifário é  
86 significativo, variando de 25% a 100%, enquanto o valor total das importações dos produtos  
87 visados é de cerca de USD 18 bilhões, o que não é um volume relevante para a economia  
88 chinesa, mas fecha um potencial mercado. O grande desafio é a mensagem que isso passa para  
89 outros parceiros comerciais que já estão desconfortáveis com as exportações baratas vindas da  
90 China, como Europa, Japão e Austrália. Na Zona do Euro, a inflação medida pelo do CPI de  
91 abril acelerou para 2,6% (A/A), acima das expectativas de mercado. Olhando para os  
92 principais grupos, destaque para alta da inflação de serviços 4,1% (A/A). A Páscoa antecipada  
93 acabou afetando o setor de serviços relacionados com o turismo em março (viés de alta) e  
94 abril (viés de baixa), mas a surpresa altista do segmento mostra que a dinâmica da inflação  
95 dos serviços permanece mais persistente do que se pensava anteriormente. A inflação de  
96 alimentos marcou uma redução de 2,6% ante 2,8% (A/A). A preliminar do CPI cresceu 0,6%





97 em abril e manteve o patamar de 2,4% em 12 meses. A leitura preliminar do PMI Composto  
98 da Zona do Euro (52,3 pontos) surpreendeu positivamente em sete dos últimos nove meses,  
99 com o resultado de maio voltando a suportar a análise de continuidade da recuperação da  
100 economia ao longo do 2T24. O resultado foi impulsionado pelo aumento na produção  
101 manufatureira (47,4 pontos), apesar da desaceleração na França, com Alemanha e a periferia  
102 do bloco como os principais responsáveis por essa melhora. Já o setor de serviços (53,3  
103 pontos) segue como o principal motor de crescimento do bloco neste ano, além de mostrar  
104 uma desaceleração de preços que sugere uma desinflação à frente da inflação do setor, sendo  
105 um vento favorável ao Banco Central Europeu (BCE). O Comitê de Política Monetária (MPC)  
106 do BoE (*Bank of England*, sigla em inglês) manteve sua taxa básica de juros em 5,25% a.a.,  
107 sendo esse o maior nível de juros desde 2008. Nessa reunião, dos seus nove membros, sete  
108 votaram pela manutenção e dois foram favoráveis a um corte de 0,25 p.p. Desde a sua última  
109 reunião, o MPC avalia que as trajetórias implícitas para as taxas de juros, utilizadas nas suas  
110 projeções de inflação, se elevaram e passaram de 3,25% para 3,75% ao final do horizonte de  
111 análise. A ata da última reunião do BCE, na qual a taxa de depósitos foi mantida em 4,00%  
112 a.a., seguiu trazendo uma avaliação favorável para o cenário prospectivo de inflação,  
113 indicando que está caminhando em direção a 2,0%, possivelmente no ritmo esperado.  
114 Segundo o documento, os níveis atuais das taxas de juros diretoras estavam contribuindo  
115 substancialmente para o processo contínuo de desinflação. Os membros do *Governing*  
116 *Council* do BCE já formaram um consenso sobre a probabilidade de um corte na taxa de juros  
117 na reunião do início de junho. No entanto, há divergências significativas quanto às ações  
118 futuras além de junho. Enquanto alguns membros veem o corte como o início de uma fase de  
119 redução de taxas, inclusive já vocalizando a possibilidade de outro ajuste em julho, a maior  
120 parte dos membros ainda enfatiza a necessidade de cautela e não se compromete com uma  
121 trajetória específica para os próximos meses, destacando a importância de manter uma postura  
122 flexível e adaptável às condições econômicas. No Brasil, a confiança teve predomínio  
123 negativo, interrompendo a sequência de predomínio positivo visto desde março de 2024.  
124 Entre os setores, destaque para a piora da confiança do consumidor (-4,3% M/M) e do  
125 comércio (-4,2% M/M). O índice de incerteza da economia de maio também indicou  
126 deterioração do cenário, ao subir 6,0% (M/M). Em relação aos dados da atividade econômica,  
127 houve melhora, com destaque para o emprego formal, indicando continuidade da robustez do  
128 mercado de trabalho. Nesse sentido, vale destacar a geração líquida de vagas formais





129 (CAGED) de abril (240.033), impulsionado, mais uma vez, pelo setor de serviços (138.309).  
130 O Índice de Atividade Econômica do Banco Central (IBC-Br) recuou -0,3% (M/M), após,  
131 praticamente, uma sequência de seis meses de números não negativos. Entre os vetores,  
132 destaque para a deterioração do varejo ampliado e os efeitos defasados da política monetária  
133 contracionista. Por outro lado, a arrecadação federal manteve o ritmo forte dos últimos meses,  
134 atingindo o total de R\$ 228,9 bilhões em abril. Esse valor representa um avanço de 8,3% em  
135 relação ao mesmo período de 2023. Os principais fatores para esse desempenho foram o  
136 retorno da tributação sobre o PIS/Cofins nos combustíveis e a tributação dos fundos  
137 exclusivos. Apesar do aumento na arrecadação nos últimos meses, não será suficiente para  
138 que o país alcance um déficit primário de 0% em 2024. Em relação ao campo monetário, o  
139 Banco Central do Brasil (BCB) deliberou, em votação dividida, pelo corte de 0,25 pp, levando  
140 a taxa básica de juro (Selic) de 10,75% para 10,50% aa. A votação dividida, com um placar de  
141 5 a 4, evidenciou um racha dentro do próprio Banco Central. Os cinco membros indicados  
142 pelo governo anterior votaram a favor de uma redução em um ritmo mais moderado, enquanto  
143 os membros indicados pelo governo atual defenderam a manutenção do ritmo de corte de  
144 juros. Essa decisão trouxe incertezas para o mercado, pois sugere que, a partir do próximo  
145 ano, com a maioria dos membros indicada pelo governo atual, as decisões de política  
146 monetária podem ser influenciadas pelos interesses políticos, em detrimento de critérios  
147 técnicos. No geral, no comunicado pós Copom, foi observado um tom bastante duro  
148 (*hawkish*), com a autoridade monetária citando o cenário externo adverso, incerteza elevada  
149 sobre o início de flexibilização monetária americana e mercado de trabalho robusto no mundo  
150 e no Brasil. As projeções de inflação no cenário de referência foram revisadas de 3,5% para  
151 3,8% em 2024 e de 3,2% para 3,3% em 2025. O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística  
152 (IBGE) divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) que avançou  
153 +0,46% (M/M) em maio, acelerando em relação ao avanço de +0,38% (M/M) observado no  
154 mês anterior. A variação foi em linha com a projeção de mercado. Com isso, o índice  
155 acumulou alta de +3,93% em 12 meses (ante +3,69% em abril). A maior contribuição para a  
156 variação do índice contudo, partiu do grupo Alimentação e bebidas influenciado pelo aumento  
157 dos itens de Alimentação no domicílio com destaque para Tubérculos, raízes e legumes. Os  
158 preços administrados avançaram +0,55% em maio ante +0,74% de abril, influenciados  
159 principalmente pelo avanço dos preços do item Taxa de água e esgoto (+1,62% ante +0,09%  
160 na leitura anterior). Já os preços livres aceleraram (+0,42%) ainda se mantendo como os

5





161 principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres, produtos industriais e serviços  
162 aceleraram de +0,21% para +0,29% e de +0,05% para +0,4% respectivamente. Por outro lado,  
163 alimentos desaceleraram de +0,81% para +0,66%. A média dos núcleos acelerou, tanto na  
164 comparação mensal (+0,39%), quanto quando observada a variação acumulada em 12 meses  
165 (+3,56%). Na margem, tivemos aceleração tanto da medida subjacente de industriais  
166 (+0,29%), quanto do núcleo de serviços (+0,41%). O índice de difusão passou de 57,03% em  
167 abril para 57,29% em maio. O Ibovespa, principal índice da bolsa de valores brasileira, em  
168 maio, apresentou desvalorização de -3,04% em relação ao mês anterior, fechando aos 122.098  
169 pontos. No ano, a queda acumulada é de -9,00%. O desempenho do mês é explicado,  
170 sobretudo, pela eventual necessidade de manutenção da política monetária em nível  
171 contracionista (*high for longer*) nos EUA derivado da resiliência da inflação, mercado de  
172 trabalho robusto e atividade ainda em ritmo positivo. Além disso, tivemos as tensões ligadas  
173 ao triste evento das enchentes no Rio Grande do Sul, que podem agravar alguns problemas,  
174 como os das contas públicas do governo e de inflação. No âmbito corporativo, também houve  
175 instabilidades devido à troca de presidência na Petrobras, o que derrubou as ações da empresa  
176 em cerca de 8%. Como a Petrobras detém um peso de cerca de 13% no IBOVESPA, essa  
177 queda prejudicou o resultado geral do índice. Ainda no curto prazo o cenário deve seguir  
178 volátil e desfavorável à alocação em *equities* até que se tenha uma maior certeza acerca do  
179 início de cortes de juros pelo Fed. A política monetária norte-americana segue tendo grande  
180 influência no desempenho da bolsa brasileira e tem se mostrado o principal fator que dita o  
181 apetite a risco de emergentes. Espera-se que o fluxo estrangeiro para o Brasil aumente a partir  
182 de uma maior definição do início de cortes pelo FOMC. Internamente, é esperado que o fluxo  
183 doméstico aumente a partir de uma Selic mais próxima a um dígito, expectativa que foi  
184 prorrogada para o segundo semestre de 2025. **RESULTADO DA CARTEIRA:** No mês de  
185 maio, nosso portfólio teve desempenho inferior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com  
186 uma rentabilidade de 0,84%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 5,02%, foi  
187 de 0,87%.

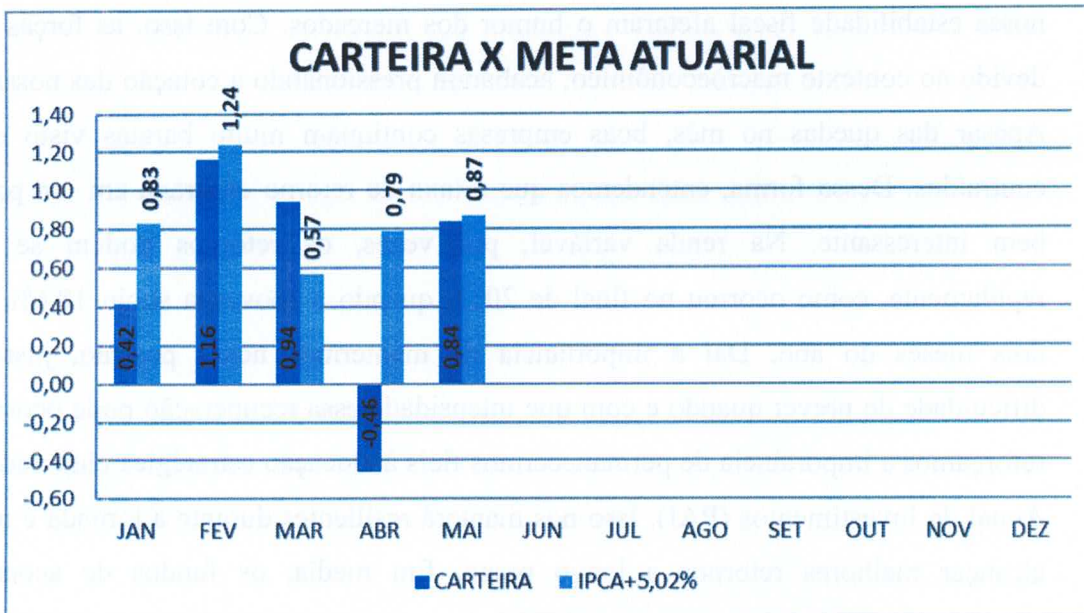
### HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

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								2,93
IPCA+5,02%	0,83	1,24	0,57	0,79	0,87								4,37

188

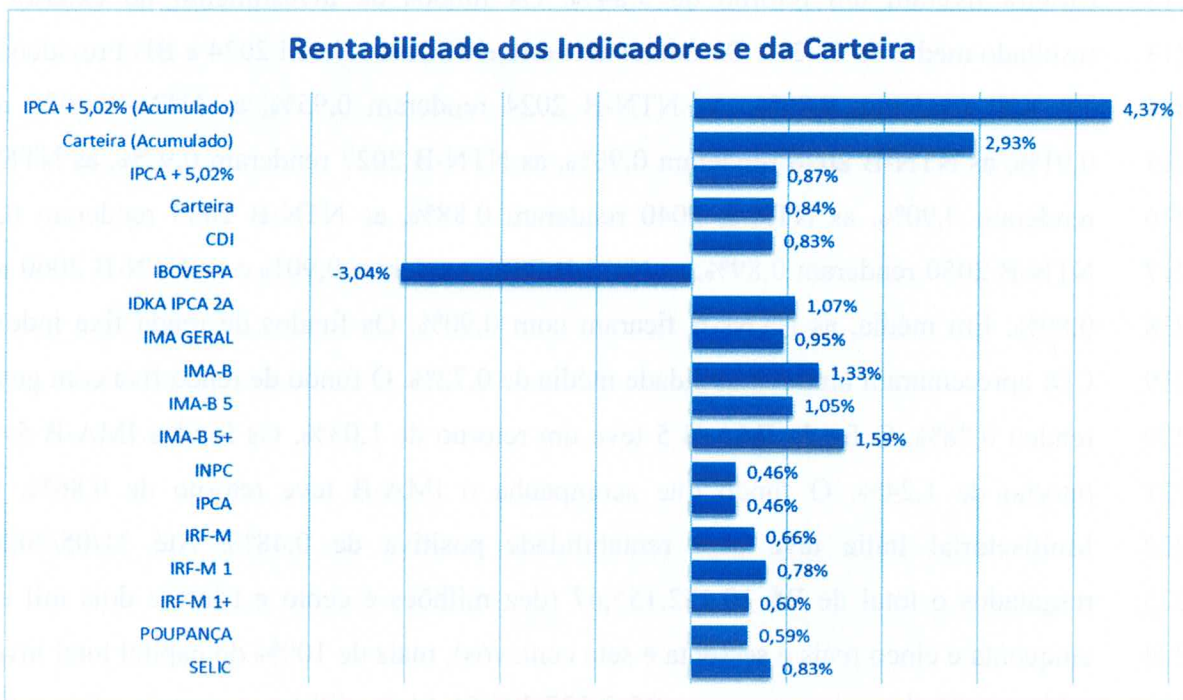


189



190

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



193

194 No mês de maio, observamos um comportamento positivo em nossos fundos de investimento.

195 Os investimentos no exterior foram os que mais contribuíram para nossa carteira. Dessa

196 forma, as maiores altas na carteira foram do Caixa Institucional BDR Nível I com 6,78% e

197 BB Ações Globais Institucional BDR Nível I com 6,26%. Na contramão do cenário global, a

*[Handwritten signatures and initials]*





198 bolsa brasileira continua sofrendo com os entraves internos. Alguns dados relacionados à  
199 nossa estabilidade fiscal afetaram o humor dos mercados. Com isso, as forças vendedoras,  
200 devido ao contexto macroeconômico, acabaram pressionando a cotação das nossas empresas.  
201 Apesar das quedas no mês, boas empresas continuam muito baratas visto os múltiplos  
202 contraídos. Dessa forma, entendemos que a taxa de retorno esperada em um prazo maior é  
203 bem interessante. Na renda variável, por vezes, os retornos podem se materializar  
204 rapidamente, como ocorreu no final de 2023, quando o Ibovespa subiu 18,6% nos últimos  
205 dois meses do ano. Daí a importância de mantermos nossa posição, justamente pela  
206 dificuldade de prever quando e com que intensidade essa recuperação pode ocorrer. Por isso,  
207 reforçamos a importância de permanecermos fiéis à alocação estratégica elaborada na Política  
208 Anual de Investimentos (PAI). Isso nos manterá resilientes durante a jornada e nos ajudará a  
209 alcançar melhores retornos a longo prazo. Em média, os fundos de ações brasileiras  
210 apresentaram rentabilidade de -2,85%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com  
211 proteção cambial apresentaram um retorno médio de 5,05%. Já os fundos com BDRs na  
212 carteira tiveram um retorno de 5,84%. Os fundos de investimento no exterior tiveram  
213 resultado médio de 2,73%. Os fundos de vértice FI Caixa Brasil 2024 e BB Previdenciário RF  
214 TP XXI renderam 0,89%. As NTN-B 2024 renderam 0,95%, as NTN-B 2025 renderam  
215 0,91%, as NTN-B 2026 renderam 0,90%, as NTN-B 2027 renderam 0,92%, as NTN-B 2028  
216 renderam 0,90%, as NTN-B 2040 renderam 0,88%, as NTN-B 2045 renderam 0,83%, as  
217 NTN-B 2050 renderam 0,89%, as NTN-B 2055 renderam 0,90% e as NTN-B 2060 renderam  
218 0,89%. Em média, as NTN-B ficaram com 0,90%. Os fundos de renda fixa indexados ao  
219 CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,72%. O fundo de renda fixa com gestão ativa  
220 rendeu 0,88%. O fundo IMA-B 5 teve um retorno de 1,03%. Os fundos IMA-B 5+ tiveram  
221 retorno de 1,24%. O fundo que acompanha o IMA-B teve retorno de 0,86%. O FIDC  
222 Multisetorial Itália teve uma rentabilidade positiva de 0,48%. Até 31/05/2024 foram  
223 resgatados o total de R\$ 10.132.155,67 (dez milhões e cento e trinta e dois mil e cento e  
224 cinquenta e cinco reais e sessenta e sete centavos), mais de 100% do capital total investido. O  
225 saldo em 31 de maio estava em R\$ 2.127.494,56 (dois milhões e cento e vinte e sete mil e  
226 quatrocentos e noventa e quatro reais e cinquenta e seis centavos). O gráfico a seguir mostra a  
227 comparação entre a rentabilidade dos fundos e a Meta Atuarial. Os fundos em verde bateram a  
228 Meta Atuarial, os fundos em amarelo apresentaram resultado positivo, porém, abaixo da Meta  
229 Atuarial e os fundos em vermelho tiveram resultado negativo.

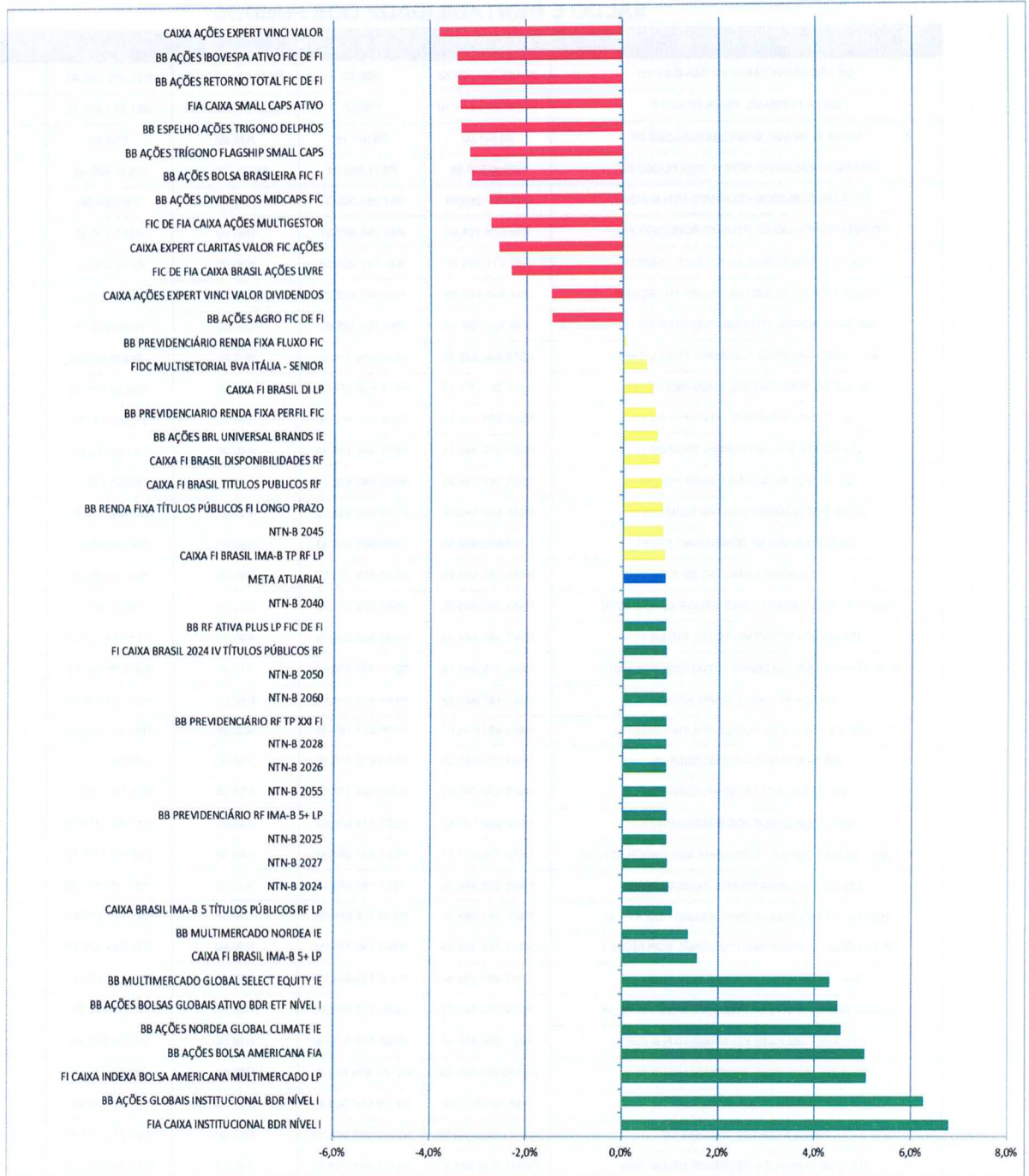
ⓐ

8





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



230

231 O rendimento de maio da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 40.548.607,83 (quarenta  
232 milhões e quinhentos e quarenta e oito mil e seiscentos e sete reais e oitenta e três centavos).

233 O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de maio em R\$ 4.407.767.360,90

234 (quatro bilhões e quatrocentos e sete milhões e setecentos e sessenta e sete mil e trezentos e  
235 sessenta reais e noventa centavos).

236



**SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS**

Fundo de Investimento	Saldo em 30/04/2024	Saldo em 31/05/2024	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	R\$143.302.509,52	R\$0,00	-R\$144.612.348,33	R\$1.309.838,81	0,91%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	R\$208.678.957,10	R\$0,00	-R\$210.480.364,86	R\$1.801.407,76	0,86%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$101,02	R\$101,78	R\$0,00	R\$0,76	0,75%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$840.576,86	R\$11.686,24	-R\$845.180,54	R\$16.289,92	0,04%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2024	R\$1.041.340,64	R\$1.051.309,24	R\$0,00	R\$9.968,60	0,95%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	R\$2.079.174,85	R\$2.096.303,37	R\$0,00	R\$17.128,52	0,82%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$2.117.395,25	R\$2.127.494,56	R\$0,00	R\$10.099,31	0,48%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$4.595.476,89	R\$4.477.462,77	R\$0,00	-R\$118.014,12	-2,57%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$6.304.392,10	R\$6.354.406,83	R\$0,00	R\$50.014,73	0,79%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	R\$19.044.825,39	R\$18.439.175,01	R\$0,00	-R\$605.650,38	-3,18%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	R\$19.281.370,47	R\$18.633.274,03	R\$0,00	-R\$648.096,44	-3,36%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$20.973.753,33	R\$20.252.552,66	R\$0,00	-R\$721.200,67	-3,44%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	R\$20.905.399,75	R\$21.054.163,59	R\$0,00	R\$148.763,84	0,71%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	R\$24.482.719,40	R\$23.550.439,28	R\$0,00	-R\$932.280,12	-3,81%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	R\$22.850.540,34	R\$23.887.334,95	R\$0,00	R\$1.036.794,61	4,54%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$30.600.603,55	R\$29.643.933,33	R\$0,00	-R\$956.670,22	-3,13%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$43.253.150,89	R\$42.615.088,09	R\$0,00	-R\$638.062,80	-1,48%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	R\$44.760.080,86	R\$44.092.203,99	R\$0,00	-R\$667.876,87	-1,49%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$47.593.249,09	R\$45.960.556,79	R\$0,00	-R\$1.632.692,30	-3,43%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$45.175.900,79	R\$47.199.570,63	R\$0,00	R\$2.023.669,84	4,48%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$51.147.851,92	R\$49.425.514,98	R\$0,00	-R\$1.722.336,94	-3,37%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$51.625.616,07	R\$50.212.765,42	R\$0,00	-R\$1.412.850,65	-2,74%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$49.733.657,29	R\$50.412.475,42	R\$0,00	R\$678.818,13	1,36%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$48.502.761,82	R\$50.944.107,29	R\$0,00	R\$2.441.345,67	5,03%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$53.226.110,82	R\$51.744.676,04	R\$0,00	-R\$1.481.434,78	-2,78%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$52.178.977,17	R\$54.823.037,62	R\$0,00	R\$2.644.060,45	5,07%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$58.556.948,33	R\$57.199.055,65	R\$0,00	-R\$1.357.892,68	-2,32%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$57.241.095,87	R\$59.706.665,78	R\$0,00	R\$2.465.569,91	4,31%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$59.728.589,85	R\$63.468.175,60	R\$0,00	R\$3.739.585,75	6,26%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$61.950.024,40	R\$66.149.094,79	R\$0,00	R\$4.199.070,39	6,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$79.396.899,65	R\$80.212.856,42	R\$0,00	R\$815.956,77	1,03%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2060	R\$87.684.619,02	R\$88.469.311,45	R\$0,00	R\$784.692,43	0,89%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2040	R\$100.584.755,54	R\$101.479.976,04	R\$0,00	R\$895.220,50	0,88%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$5.428.511,92	R\$116.607.365,69	R\$110.480.364,86	R\$698.488,91	0,60%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	R\$141.825.244,87	R\$144.035.958,52	R\$0,00	R\$2.210.713,65	1,56%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2028	R\$150.503.534,27	R\$151.871.781,57	R\$0,00	R\$1.368.247,30	0,90%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2055	R\$189.284.219,35	R\$185.527.709,76	R\$0,00	R\$1.668.280,72	0,90%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2026	R\$202.898.958,17	R\$204.740.638,02	R\$0,00	R\$1.841.679,85	0,90%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$212.776.216,41	R\$214.860.220,37	R\$0,00	R\$1.884.003,96	0,89%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	R\$219.420.642,33	R\$221.353.037,86	R\$0,00	R\$1.932.395,53	0,88%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$238.775.546,19	R\$240.890.709,58	R\$0,00	R\$2.115.163,39	0,89%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2045	R\$237.366.736,97	R\$267.828.953,47	R\$34.999.569,45	R\$2.230.094,74	0,83%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2050	R\$290.978.712,54	R\$293.580.272,89	R\$0,00	R\$2.601.560,35	0,89%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2027	R\$353.239.335,81	R\$346.158.955,32	R\$0,00	R\$3.171.537,70	0,92%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$166.550.564,96	R\$417.600.781,43	R\$248.299.914,31	R\$2.750.302,16	0,66%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2025	R\$435.914.894,65	R\$427.216.206,78	R\$0,00	R\$3.882.901,84	0,91%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$4.364.402.544,08</b>	<b>R\$4.407.767.360,90</b>	<b>R\$37.841.954,89</b>	<b>R\$40.548.607,83</b>	<b>0,84%</b>



238 **DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA**

239

240 **ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024**

241

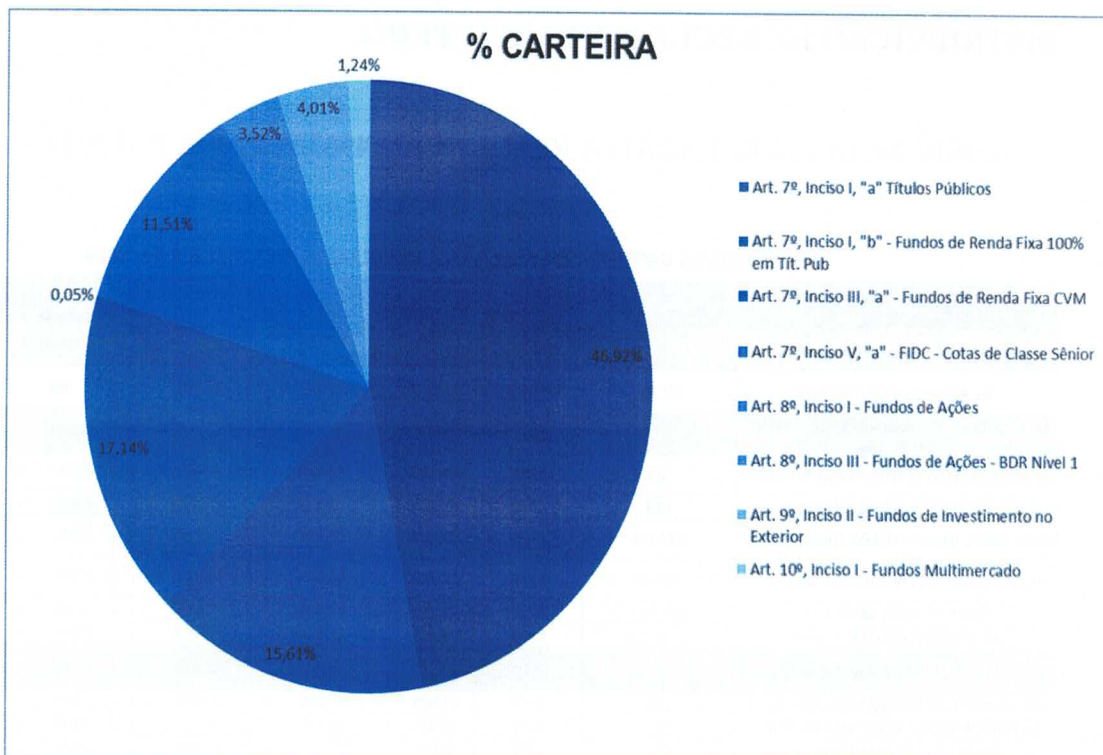
**ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024**

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>46,92%</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>Não se Aplica</b>	<b>R\$2.067.925.114,54</b>
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	IPCA+	46,92%	100,00%	50,00%	100,00%	N/A	R\$2.067.925.114,54
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub</b>		<b>15,61%</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$688.250.456,09</b>
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	CDI	0,05%	100,00%	50,00%	100,00%	0,01%	R\$2.096.303,37
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	0,14%	100,00%	50,00%	100,00%	0,06%	R\$6.354.406,83
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	1,82%	100,00%	50,00%	100,00%	1,05%	R\$80.212.856,42
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	4,87%	100,00%	50,00%	100,00%	5,39%	R\$214.660.220,37
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	IMA-B 5+	3,27%	100,00%	50,00%	100,00%	11,15%	R\$144.035.958,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	5,47%	100,00%	50,00%	100,00%	6,59%	R\$240.890.709,58
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>17,14%</b>	<b>65,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$756.572.973,00</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	9,47%	65,00%	65,00%	20,00%	2,35%	R\$417.600.781,43
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$11.686,24
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	CDI	5,02%	65,00%	65,00%	20,00%	4,60%	R\$221.353.037,86
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	2,65%	65,00%	65,00%	20,00%	0,73%	R\$116.607.365,69
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$101,78
<b>Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior</b>		<b>0,05%</b>	<b>5,00%</b>	<b>0,20%</b>	<b>20,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>R\$2.127.494,56</b>
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,05%	5,00%	0,20%	20,00%	3,64%	R\$2.127.494,56
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>11,51%</b>	<b>35,00%</b>	<b>25,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$507.190.805,33</b>
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,46%	35,00%	25,00%	20,00%	14,37%	R\$20.252.552,66
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,67%	35,00%	25,00%	20,00%	14,75%	R\$29.643.933,33
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,97%	35,00%	25,00%	20,00%	20,83%	R\$42.615.088,09
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	1,16%	35,00%	25,00%	20,00%	3,58%	R\$50.944.107,29
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,04%	35,00%	25,00%	20,00%	6,59%	R\$45.960.556,79
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	1,17%	35,00%	25,00%	20,00%	7,46%	R\$51.744.676,04
BB AÇÕES TRIGONO DELPHOS INCOME FIA	IDIV	0,42%	35,00%	25,00%	20,00%	9,69%	R\$18.633.274,03
BB AÇÕES TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	SMLL	0,42%	35,00%	25,00%	20,00%	32,70%	R\$18.439.175,01
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	IBOVESPA	0,53%	35,00%	25,00%	20,00%	3,31%	R\$23.550.439,28
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	IDIV	1,00%	35,00%	25,00%	20,00%	4,42%	R\$44.092.203,99
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,10%	35,00%	25,00%	20,00%	15,94%	R\$4.477.462,77
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,12%	35,00%	25,00%	20,00%	8,20%	R\$49.425.514,98
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,14%	35,00%	25,00%	20,00%	8,92%	R\$50.212.765,42
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,30%	35,00%	25,00%	20,00%	8,64%	R\$57.199.055,65
<b>Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível I</b>		<b>4,01%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$176.816.841,02</b>
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,44%	10,00%	10,00%	20,00%	4,28%	R\$63.468.175,60
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	1,07%	10,00%	10,00%	20,00%	12,11%	R\$47.199.570,63
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,50%	10,00%	10,00%	20,00%	2,69%	R\$66.149.094,79
<b>Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior</b>		<b>3,52%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$165.060.639,74</b>
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	1,35%	10,00%	10,00%	20,00%	4,18%	R\$59.706.665,78
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	MSCI WORLD	0,54%	10,00%	10,00%	20,00%	6,12%	R\$23.887.334,95
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	MSCI WORLD	0,48%	10,00%	10,00%	20,00%	9,91%	R\$21.054.163,59
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	1,14%	10,00%	10,00%	20,00%	41,60%	R\$50.412.475,42
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>1,24%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$54.823.037,62</b>
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,24%	10,00%	10,00%	20,00%	2,91%	R\$54.823.037,62
<b>Total:</b>							<b>R\$4.407.767.360,90</b>

242

*[Handwritten signatures and initials]*





243

244

245

DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

246

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 31/05/2024	Participação
IPCA+	R\$2.067.925.114,54	46,92%
CDI	R\$820.974.215,38	18,63%
IBOVESPA	R\$325.656.530,03	7,39%
IPCA+5	R\$240.890.709,58	5,47%
IMA-B	R\$214.660.220,37	4,87%
MSCI WORLD	R\$155.060.639,74	3,52%
IMA-B 5+	R\$144.035.958,52	3,27%
IMA-B 5	R\$80.212.856,42	1,82%
SMLL	R\$67.864.689,99	1,54%
BDRX	R\$66.149.094,79	1,50%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$63.468.175,60	1,44%
IDIV	R\$62.725.478,02	1,42%
S&P 500	R\$50.944.107,29	1,16%
MSCI ACWI	R\$47.199.570,63	1,07%
<b>Total</b>	<b>R\$4.407.767.360,90</b>	<b>100,00%</b>

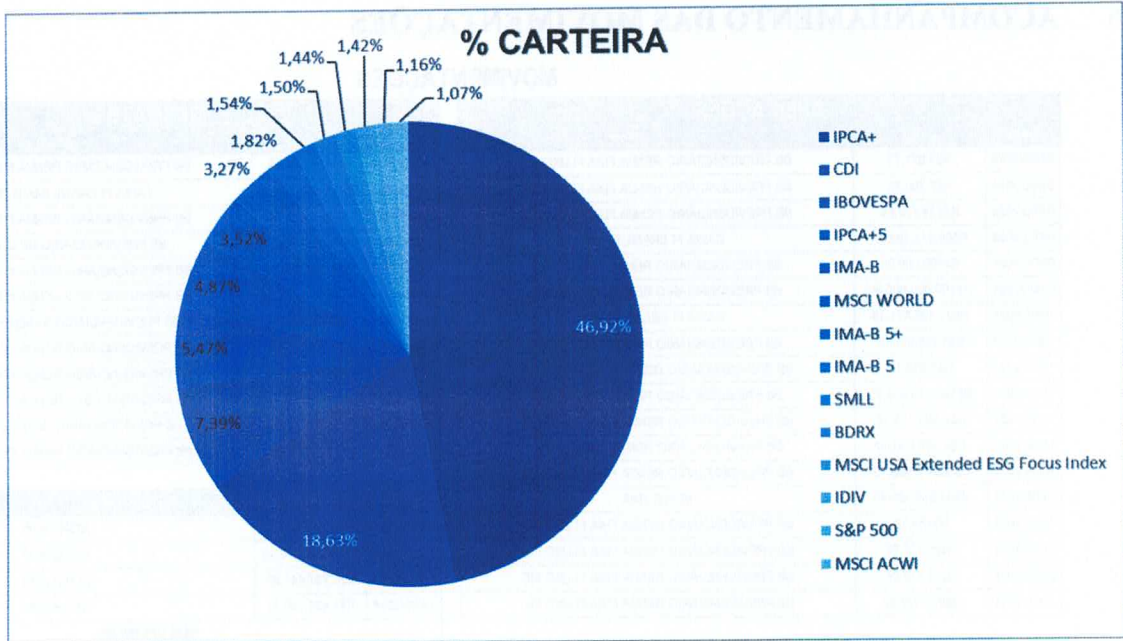
3

247

248

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





249

250

251

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

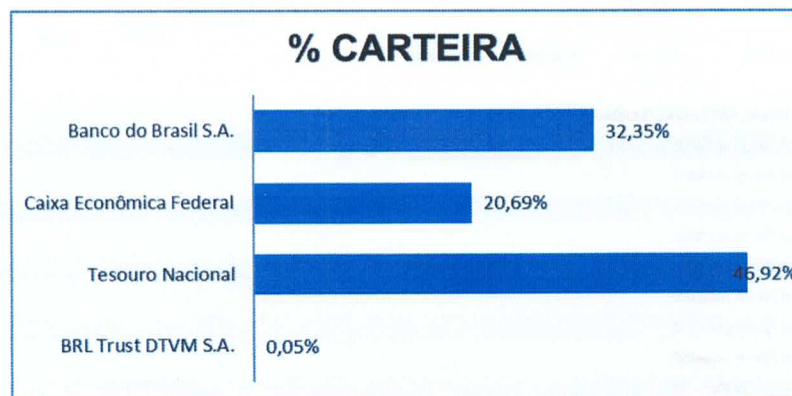
252

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

Instituição Financeira	Saldo	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$2.127.494,56	0,05%
Tesouro Nacional	R\$2.067.925.114,54	46,92%
Caixa Econômica Federal	R\$911.800.484,11	20,69%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.425.914.267,69	32,35%

253

254



255

*[Handwritten signatures and initials]*



256 **ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES**

**MOVIMENTAÇÕES**

APLICAÇÕES		
Data	Valor	
02/05/2024	R\$3.021,73	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
03/05/2024	R\$7.765,85	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
07/05/2024	R\$133.772,06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
09/05/2024	R\$88.913.693,37	CAIXA FI BRASIL DI LP
09/05/2024	R\$300.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
09/05/2024	R\$100.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
10/05/2024	R\$21.566.671,49	CAIXA FI BRASIL DI LP
10/05/2024	R\$4.430.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
10/05/2024	R\$5.530,15	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
13/05/2024	R\$140.319.914,31	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
13/05/2024	R\$4.293.599,18	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
14/05/2024	R\$4.300.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
15/05/2024	R\$35.022.086,10	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/05/2024	R\$34.999.569,45	MTN-B 2045
20/05/2024	R\$459,18	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
21/05/2024	R\$25.332,02	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
23/05/2024	R\$19.112,04	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
29/05/2024	R\$922.227,92	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

RESGATES		
Data	Valor	Ativo
06/05/2024	R\$680.986,23	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
09/05/2024	R\$210.480.364,86	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP
09/05/2024	R\$296.022,74	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
13/05/2024	R\$144.612.348,33	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP
14/05/2024	R\$4.022.296,96	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/05/2024	R\$34.976.751,59	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
24/05/2024	R\$130.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
24/05/2024	R\$365.439,05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
27/05/2024	R\$15.480,72	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
28/05/2024	R\$292,55	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
29/05/2024	R\$920.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
31/05/2024	R\$921.726,81	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

AMORTIZAÇÕES		
Data	Valor	Ativo
15/05/2024	R\$12.581.589,71	NTN-B 2025
15/05/2024	R\$10.251.918,19	NTN-B 2027
15/05/2024	R\$6.767.447,69	NTN-B 2045
15/05/2024	R\$5.424.790,31	NTN-B 2055
R\$35.025.745,90		

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$435.262.754,85
Resgates	-R\$397.421.709,84
Saldo	R\$37.841.045,01

257

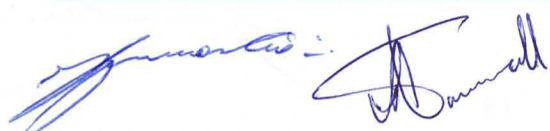
258

259 **MONITORAMENTO DE RISCOS**

260 **ART. 7º, INCISO I, "A" – TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOUREIRO NACIONAL**



261

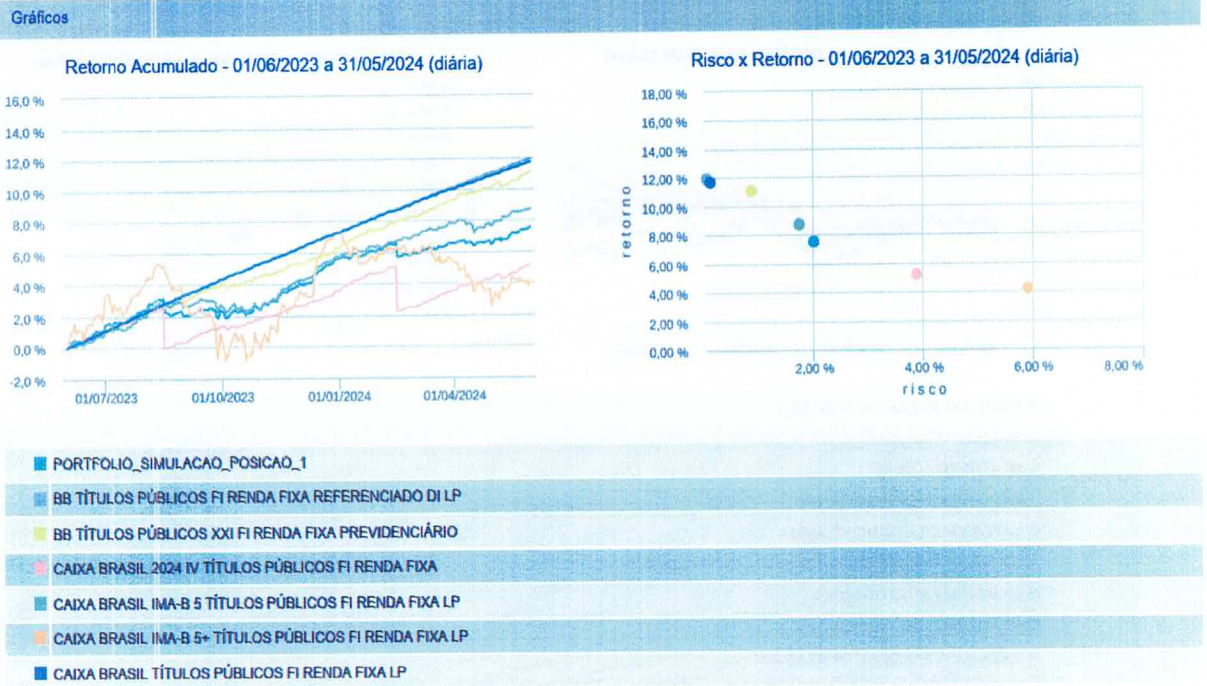







262

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



263

264

265

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

266



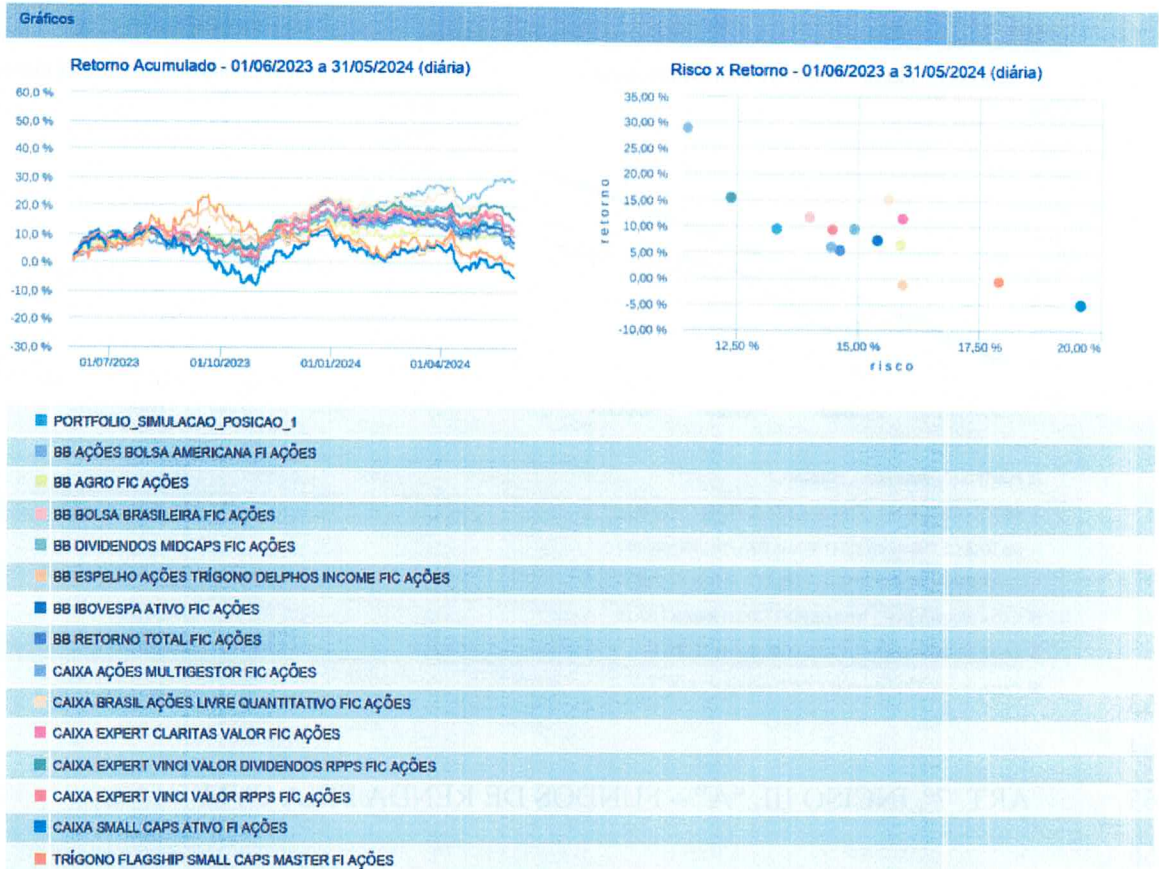
267

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



268

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



269

270

271

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



272

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

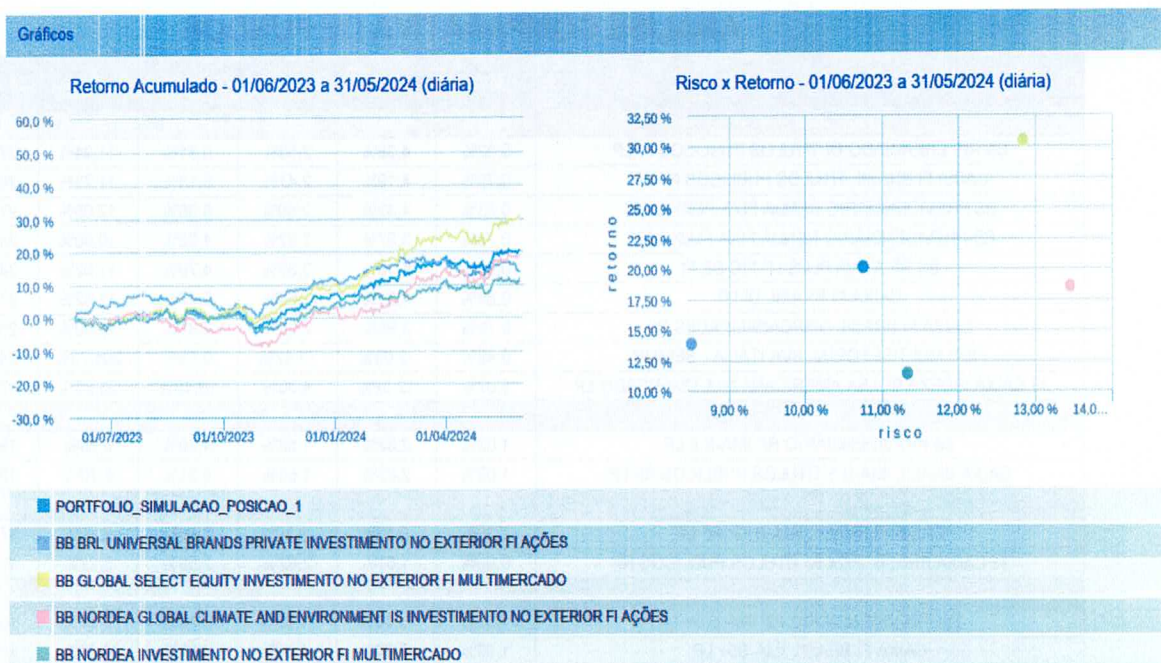




273

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

274



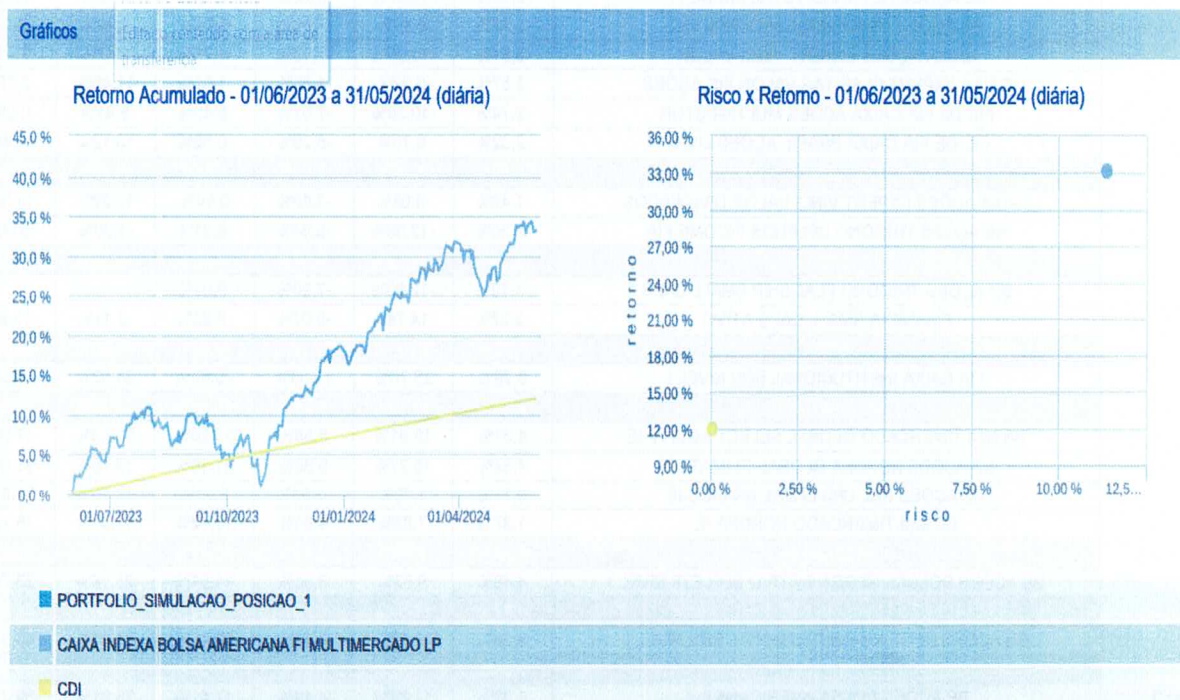
275

276

277

ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO

278



279

280

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



281

ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS E VALUE AT RISK (VAR)

282

ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS

Fundo de Investimento	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	VaR 21du 95%
CDI	0,83%	4,39%	2,57%	5,33%	12,00%	27,10%	
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,82%	4,38%	2,56%	5,31%	11,94%	27,01%	0,01%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,79%	4,19%	2,41%	5,13%	11,73%	26,70%	0,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,83%	4,42%	2,59%	5,36%	12,05%	27,13%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	0,75%	3,97%	2,32%	4,82%	10,90%	24,61%	0,03%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	0,88%	6,18%	3,39%	4,79%	11,02%	24,15%	0,27%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,84%	4,51%	2,62%	5,47%	12,52%	27,70%	0,03%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,75%	3,96%	2,32%	4,81%	10,90%	23,72%	0,03%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	0,48%	-2,03%	-3,42%	0,18%	204,73%	24,82%	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	5,07%	12,32%	4,50%	18,15%	33,23%	47,36%	0,62%
IMA-B 5	1,05%	2,92%	1,62%	4,42%	8,94%	19,23%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	1,03%	2,82%	1,56%	4,30%	8,68%	18,75%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,03%	2,83%	1,56%	4,31%	8,70%	18,94%	0,06%
IMA-B	1,32%	-0,13%	-0,23%	2,61%	6,56%	17,71%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	1,30%	-0,23%	-0,30%	2,49%	6,35%	17,30%	0,21%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,89%	1,61%	2,62%	2,55%	5,22%	6,72%	0,09%
IMA-B 5+	1,59%	-2,85%	-1,90%	0,97%	-4,23%	16,01%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	1,57%	-3,00%	-1,98%	0,82%	3,89%	15,26%	0,36%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	1,56%	-2,90%	-1,95%	0,92%	4,18%	15,43%	0,36%
IPCA + 5%	0,87%	4,68%	2,26%	5,25%	9,26%	18,94%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,89%	4,51%	2,62%	5,48%	11,10%	19,57%	0,09%
IBOVESPA	-3,04%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	-3,44%	-12,02%	-7,84%	-6,72%	7,18%	2,43%	1,19%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	-3,13%	-9,30%	-5,56%	-4,42%	11,83%	8,21%	1,14%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	-1,48%	-8,67%	-4,26%	-4,91%	6,48%	-6,67%	1,30%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	-3,43%	-13,97%	-9,72%	-9,15%	5,29%	-8,25%	1,18%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	-2,78%	-6,87%	-7,56%	0,72%	9,44%	13,03%	1,66%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	-3,81%	-10,05%	-7,13%	-4,78%	9,47%	3,71%	1,29%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	-2,57%	-6,32%	-4,66%	-1,37%	11,48%	2,15%	1,43%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	-2,74%	-10,28%	-7,07%	-5,43%	5,91%	0,52%	1,33%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	-2,32%	-6,76%	-6,29%	-0,55%	15,12%	13,46%	1,73%
IDIV	-0,99%	-5,29%	-2,73%	1,24%	19,55%	18,54%	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	-1,49%	-5,08%	-3,80%	0,54%	15,29%	14,39%	1,18%
BB AÇÕES TRIGONO DELPHOS INCOME FIA	-3,36%	-12,39%	-5,34%	-8,31%	-1,30%	0,00%	1,10%
SMLL	-3,38%	-14,52%	-8,96%	-8,50%	-4,39%	-11,41%	
BB AÇÕES TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	-3,18%	-12,80%	-7,28%	-9,07%			1,24%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-3,37%	-14,74%	-9,07%	-8,83%	-5,11%	-12,61%	1,69%
BDRX	7,32%	25,07%	12,29%	28,62%	37,90%	58,29%	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,78%	23,76%	11,38%	26,96%	35,62%	54,35%	0,65%
MSCI WORLD	4,23%	10,19%	3,24%	13,84%	19,20%	28,30%	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	4,31%	18,91%	8,55%	23,26%	30,43%	47,96%	1,18%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	4,54%	15,27%	9,38%	21,16%	18,48%	21,66%	1,29%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	0,71%	1,70%	-2,68%	5,21%	13,79%	24,61%	0,75%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	1,37%	7,83%	4,64%	11,72%	11,37%	18,23%	1,15%
MSCI ACWI	3,82%	9,66%	3,18%	13,47%	17,77%	25,01%	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	4,48%	9,02%	3,65%	11,51%	21,18%	23,78%	0,68%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	4,62%	12,94%	5,15%	16,12%	23,48%	32,79%	
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,26%	18,59%	6,42%	22,19%	31,61%	43,37%	0,66%
S&P 500	5,34%	11,21%	4,63%	16,57%	27,78%	33,32%	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	5,03%	11,83%	4,49%	17,51%	28,91%	39,21%	0,71%

283

284

*[Handwritten signatures and initials]*

*[Handwritten signatures and initials]*





285 **RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO**

286 **RENTABILIDADE**

287 A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,76% no mês de maio,  
288 totalizando um saldo de R\$ 242.281.035,32 (duzentos e quarenta e dois milhões e duzentos e  
289 oitenta e um mil e trinta e cinco reais e trinta e dois centavos).

290

291 **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>53,89%</b>	<b>100,00%</b>	✓	<b>50,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>R\$130.568.903,24</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	IRF-M 1	28,60%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,82%	✓	R\$69.282.788,91
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	0,09%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,00%	✓	R\$224.211,83
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2A	10,32%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,44%	✓	R\$25.002.592,32
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	7,89%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,37%	✓	R\$19.125.205,54
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	IRF-M	6,99%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,41%	✓	R\$16.934.104,64
<b>Art. 7º, inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>34,09%</b>	<b>65,00%</b>	✓	<b>65,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$82.584.332,76</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COT	CDI	6,37%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,09%	✓	R\$15.444.734,72
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	CDI	0,15%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,01%	✓	R\$356.033,60
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,00%	✓	R\$1.454,38
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	27,56%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	1,01%	✓	R\$66.782.110,06
<b>Art. 10º, inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>12,02%</b>	<b>10,00%</b>	✓	<b>10,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$29.127.799,32</b>
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,02%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	2,15%	✓	R\$29.127.799,32
<b>Total:</b>										<b>R\$242.281.035,32</b>	

292

293

294

**DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 31/05/2024	Participação
IRF-M 1	R\$69.507.000,74	28,69%
IPCA	R\$66.782.110,06	27,56%
CDI	R\$44.930.022,02	18,54%
IDKA IPCA 2A	R\$25.002.592,32	10,32%
IMA-B 5	R\$19.125.205,54	7,89%
IRF-M	R\$16.934.104,64	6,99%
	<b>R\$242.281.035,32</b>	<b>100,00%</b>

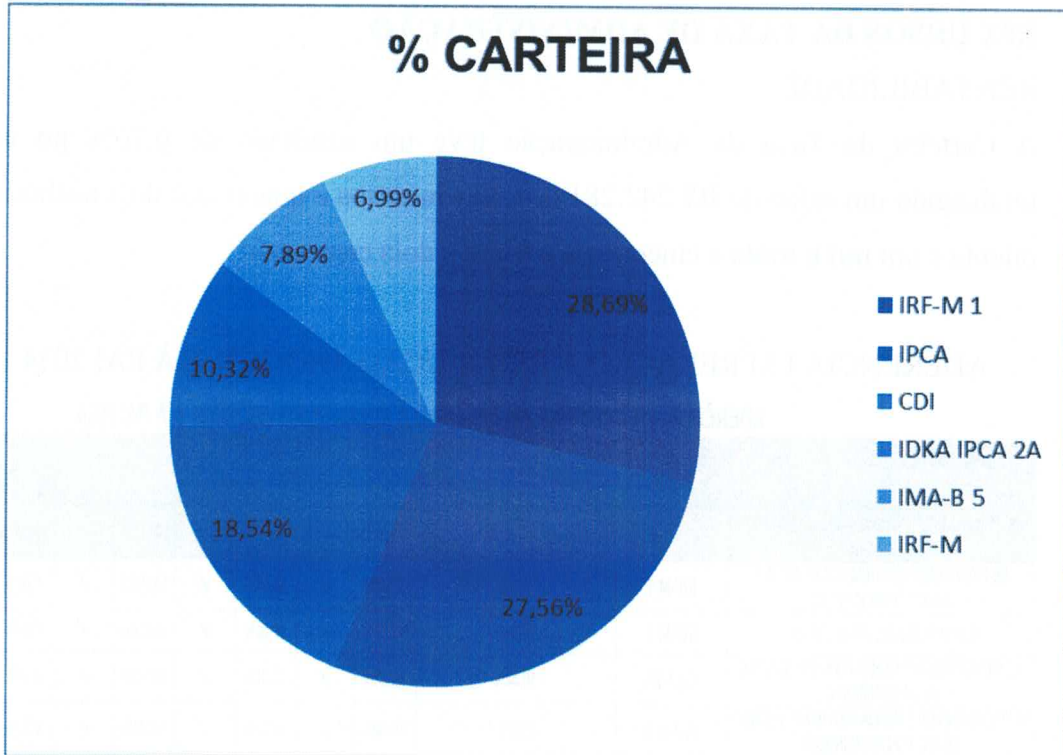
295

296

*[Handwritten signatures and initials]*

19





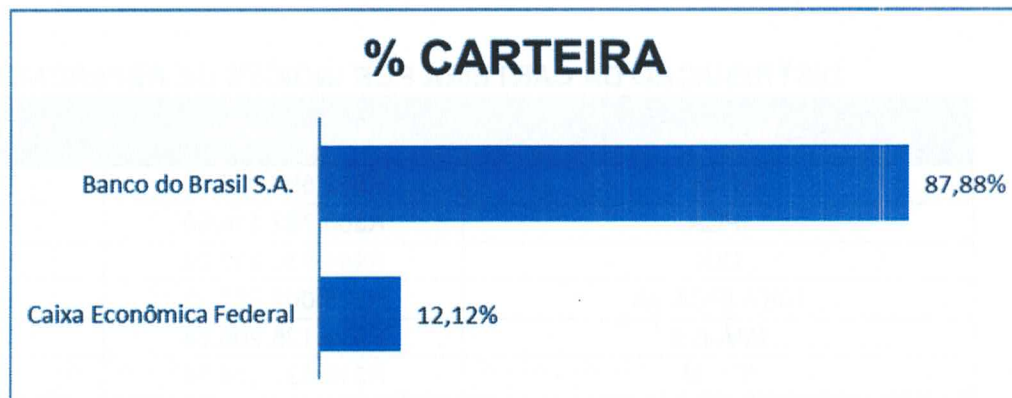
297  
298  
299  
300

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$29.353.465,53	12,12%
Banco do Brasil S.A.	R\$212.927.569,79	87,88%

301  
302



303  
304

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



305 **RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021**

306 **RENTABILIDADE**

307 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado  
308 positivo de 1,22% e fechou o mês com o saldo de R\$ 28.567.073,25 (vinte e oito milhões e  
309 quinhentos e sessenta e sete mil e setenta e três reais e vinte e cinco centavos).

310

311 **ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024**

312

**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>59,56%</b>	<b>100,00%</b>	✓	<b>50,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>100,00%</b>	✓	<b>R\$17.013.285,51</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	6,60%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,02%	✓	R\$1.884.766,76
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	6,76%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,02%	✓	R\$1.932.250,93
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	15,50%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.429.249,67
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	15,53%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.437.780,90
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	15,15%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	0,09%	✓	R\$4.329.237,25
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>15,71%</b>	<b>65,00%</b>	✓	<b>65,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$4.486.471,91</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,71%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,07%	✓	R\$4.486.471,91
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>6,72%</b>	<b>35,00%</b>	✓	<b>25,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$1.918.313,72</b>
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	IBOVESPA	1,52%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$434.182,32
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,11%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$318.484,04
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,75%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,08%	✓	R\$500.946,24
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,31%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,07%	✓	R\$374.572,51
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,02%	35,00%	✓	25,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$290.128,61
<b>Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>9,94%</b>	<b>10,00%</b>	✓	<b>10,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$2.838.365,04</b>
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	4,88%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,09%	✓	R\$1.394.537,24
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	5,05%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,06%	✓	R\$1.443.827,80
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>8,09%</b>	<b>10,00%</b>	✓	<b>10,00%</b>	✓	<b>20,00%</b>	✓	<b>15,00%</b>	✓	<b>R\$2.310.637,07</b>
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	2,56%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,64%	✓	R\$732.226,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,54%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,35%	✓	R\$724.268,36
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,99%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	0,05%	✓	R\$854.141,85
<b>Total: R\$28.567.073,25</b>											

313

314











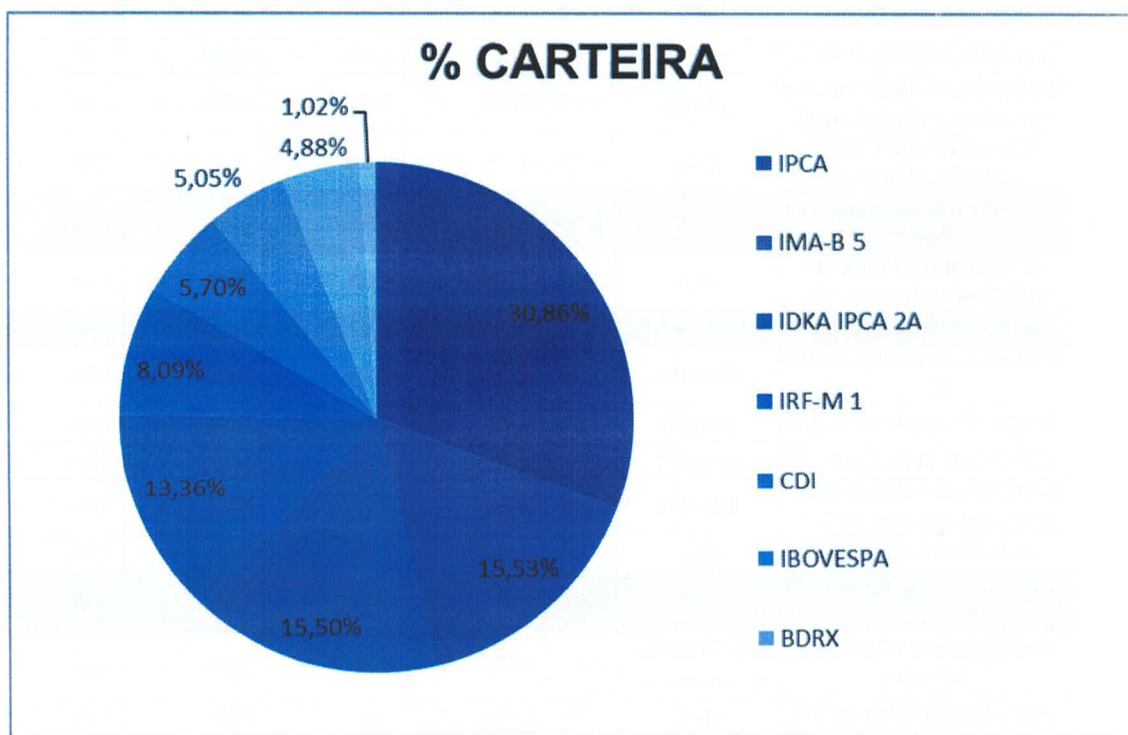
315 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 31/05/2024	Participação
IPCA	R\$8.815.709,16	30,86%
IMA-B 5	R\$4.437.780,90	15,53%
IDKA IPCA 2A	R\$4.429.249,67	15,50%
IRF-M 1	R\$3.817.017,69	13,36%
CDI	R\$2.310.637,07	8,09%
IBOVESPA	R\$1.628.185,11	5,70%
BDRX	R\$1.443.827,80	5,05%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.394.537,24	4,88%
SMLL	R\$290.128,61	1,02%
	<b>R\$28.567.073,25</b>	<b>100,00%</b>

316

317



318

319

320

321

322

323

*[Handwritten signatures and notes in blue ink]*

22





324 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

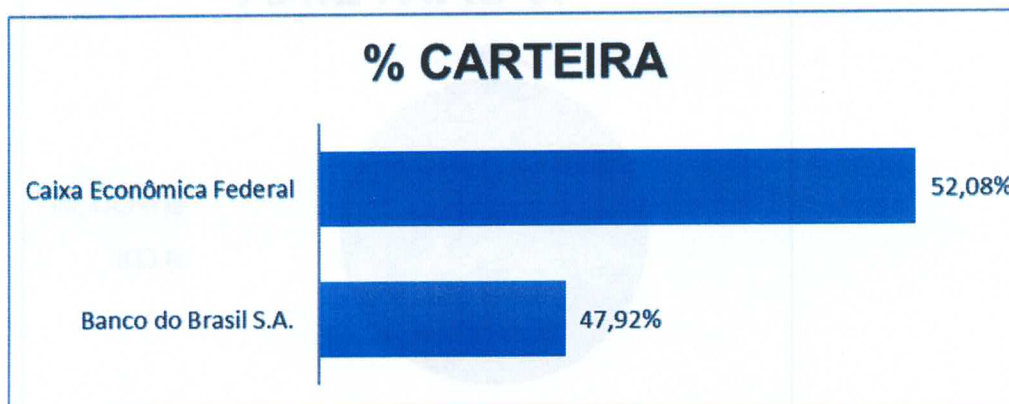
325

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$13.688.450,03	47,92%
Caixa Econômica Federal	R\$14.878.623,22	52,08%

326

327



328

329

### RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

331

### RENTABILIDADE

333 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de  
334 0,89% e fechou o mês com o saldo de R\$ 20.512.927,64 (vinte milhões e quinhentos e doze  
335 mil e novecentos e vinte e sete reais e sessenta e quatro centavos).

336

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

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

Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		97,11%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$19.919.634,48
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA + 5%	97,11%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,63% ✓	R\$19.919.634,48
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		2,89%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$593.293,16
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	2,89%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$593.293,16
<b>Total:</b>							<b>R\$20.512.927,64</b>

338



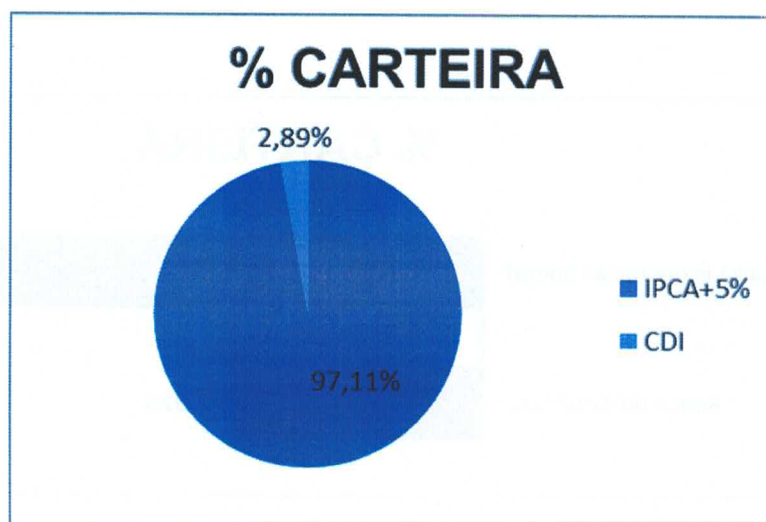
339 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 31/05/2024	Participação
IPCA+5%	R\$19.919.634,48	97,11%
CDI	R\$593.293,16	2,89%
	<b>R\$20.512.927,64</b>	<b>100,00%</b>

340

341



342

343

344 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

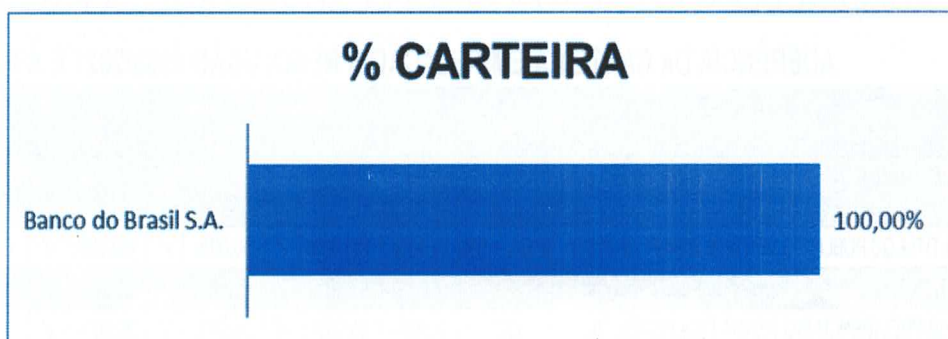
345

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$20.512.927,64	100,00%

346

347



348

348





349 RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023

350

351 RENTABILIDADE

352 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um resultado de  
353 0,89% e fechou o mês com o saldo de R\$ 34.926.133,82 (trinta e quatro milhões e seiscentos  
354 e dezessete mil e duzentos e noventa reais e oitenta e dois centavos).

355

356 ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

357

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

Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$34.926.133,82
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA+5%	100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,10% ✓	R\$34.926.133,82
<b>Total:</b>							<b>R\$34.926.133,82</b>

358

359

360 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

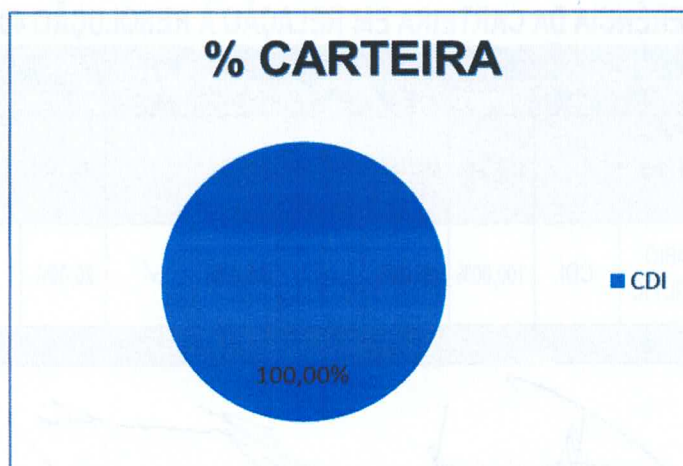
361

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 31/05/2024	Participação
IPCA+5%	R\$34.926.133,82	100,00%
	<b>R\$34.926.133,82</b>	<b>100,00%</b>

362

363



364



365 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

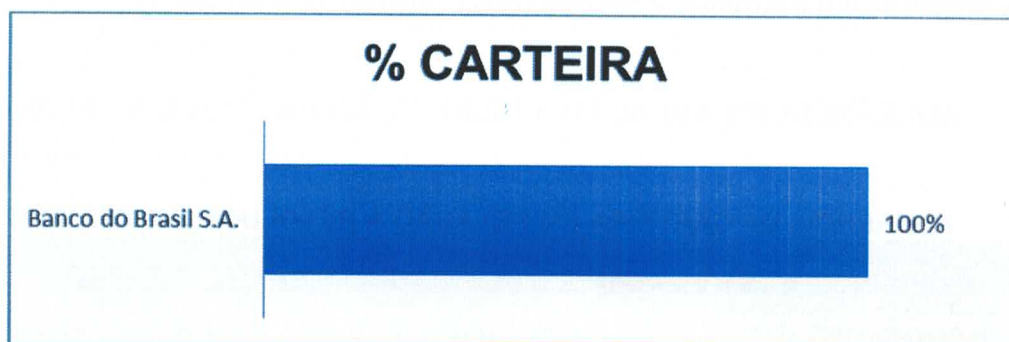
366

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$34.926.133,82	100%

367

368



369

370

371 **RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2024**

372

373 RENTABILIDADE

374 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2024) apresentou um resultado de  
375 0,83% e fechou o mês com o saldo de R\$ 40.614.882,64 (quarenta milhões e seiscentos e  
376 quatorze mil e oitocentos e oitenta e dois reais e sessenta e quatro centavos).

377

378 **ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024**

379

### 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\$40.614.882,64
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	100,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,23% ✓	R\$40.614.882,64
<b>Total:</b>							<b>R\$40.614.882,64</b>

380

381

382



383 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

384

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 31/05/2024	Participação
CDI	R\$40.614.882,64	100,00%
	<b>R\$40.614.882,64</b>	<b>100,00%</b>

385

386



387

388

389 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

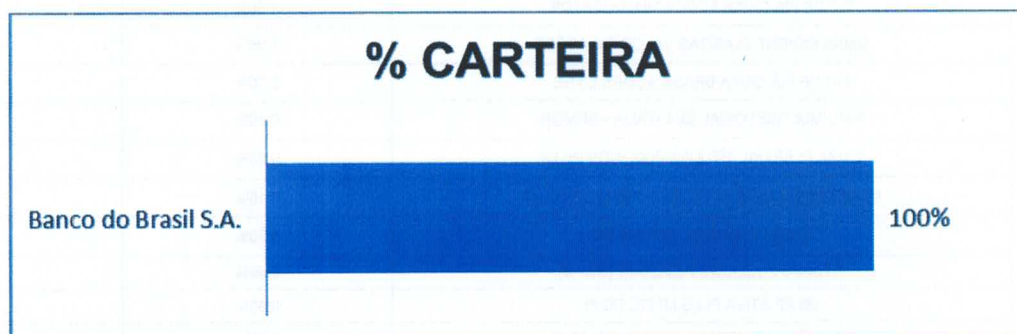
390

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$40.614.882,64	100%

391

392



393

*[Handwritten signatures and initials in blue ink]*





394 CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES

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

397



398 CUSTO SELIC PARA OS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

399

CUSTOS SELIC			
	Ativos	Patrimônio (R\$)	SELIC
	TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	R\$ 2.067.925.114,54	R\$ 4.486,48

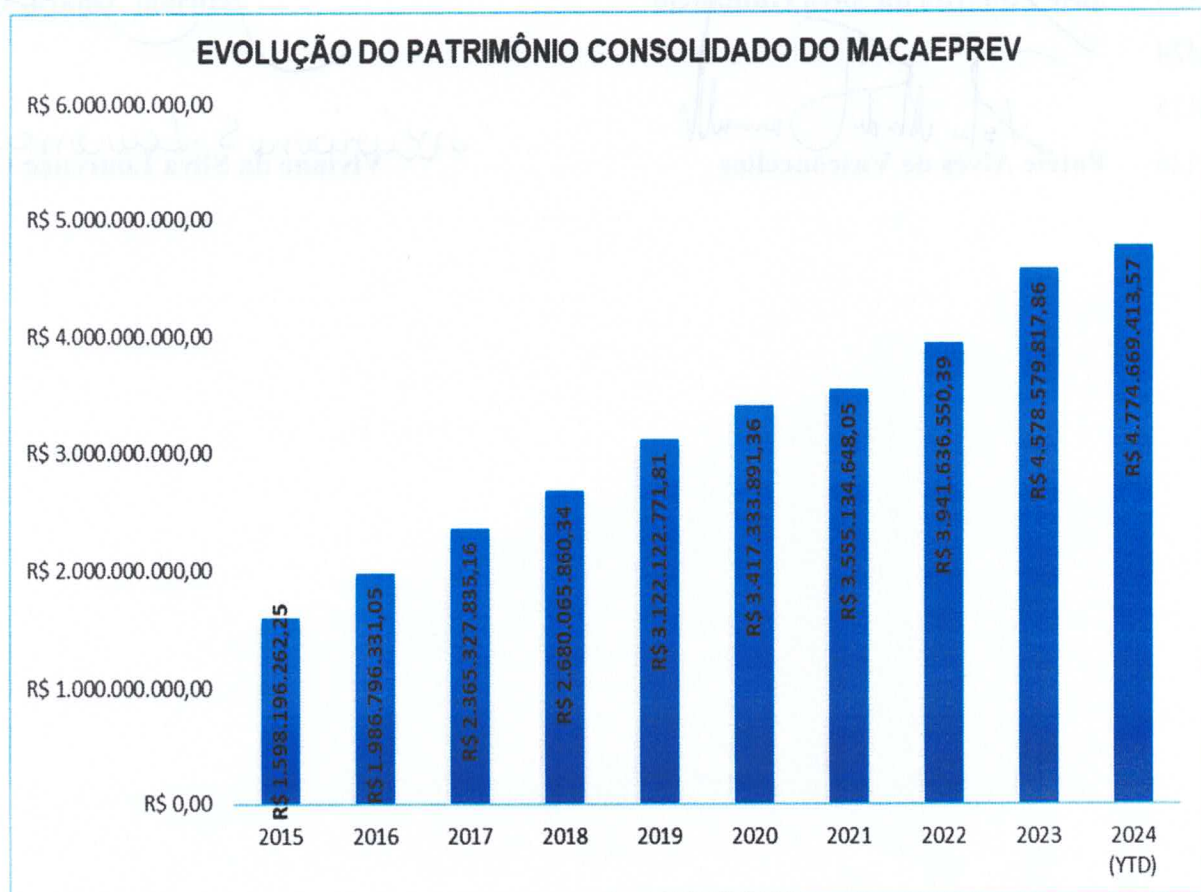
400

401

### 402 CONCLUSÃO

403 O MACAEPREV encerrou o mês de maio de 2024 com o Patrimônio Consolidado de R\$  
404 4.774.669.413,57 (quatro bilhões e setecentos e setenta e quatro milhões e seiscentos e  
405 sessenta e nove mil e quatrocentos e treze reais e cinquenta e setes centavos). O gráfico a  
406 seguir apresenta a evolução patrimonial do MACAEPREV a cada final de exercício.

407



408

409

410

411


*(Handwritten signatures and initials)*





412 **II - ENCERRAMENTO:** Nada havendo mais a tratar, o membro *Patric* informou que a  
413 reunião foi encerrada às dezoito horas e vinte minutos, tendo a ata sido lavrada por mim, lida  
414 e assinada por todos os presentes.

415 COMITÊ DE INVESTIMENTOS:

416   
417 **Alfredo Tanos Filho**

  
418 **Claudio de Freitas Duarte**

419   
420 **Erenildo Motta da Silva Júnior**

  
421 **Fábio de Carvalho de Moraes Drumond**

422   
423 **José Eduardo da Silva Guinâncio**

  
424 **Miriam Amaral Queiroz**

425   
426 **Patric Alves de Vasconcellos**

  
**Viviane da Silva Lourenço Campos**



## PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e um dias do mês de junho 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 **maio** de 2024;

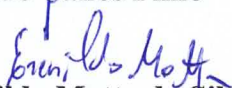
Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos o qual segue na íntegra na ata do dia de hoje: **21 de junho de 2024**.

Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de **maio 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 **MAIO 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