



1 ATA n.º 33/2024 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 24/07/2024 – 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 quatro de julho 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 – JUNHO 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 junho de 2024. Neste
17 relatório é possível observar a consolidação de todas as informações relativas ao período de
18 referência, incluindo o cenário econômico, os resultados alcançados em relação às metas
19 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 junho foi de grandes
22 desafios para os gestores de recursos. Além do cenário fiscal desafiador no Brasil, a acirrada
23 disputa entre o governo e o Banco Central elevou a volatilidade do mercado. Os investimentos
24 no exterior continuaram apresentando bons resultados, impulsionados pela valorização do
25 dólar em relação ao real e pelo desempenho positivo dos índices globais. No front geopolítico,
26 a repercussão do conflito no oriente médio se mantém, desta vez com a apreensão sobre um
27 possível conflito entre Israel e Hezbollah. Além disso, a guerra da Ucrânia completa 29
28 meses, sem perspectivas de avanço nas negociações diplomáticas. Nos EUA, os dados do
29 varejo ficaram abaixo do esperado e os PMIs do setor manufatureiro, que são índices de
30 confiança do setor, desaceleraram em maio. Da mesma forma, o Índice de Sentimento do



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



31 Consumidor, coletado pela Universidade de Michigan, caiu em junho pelo terceiro mês
32 consecutivo, refletindo pessimismo em relação à inflação e à deterioração da renda. O
33 consumo agregado recuou -0,05% m/m em abril, abaixo das expectativas (0,1% m/m),
34 sugerindo um início de trimestre com uma demanda mais tímida. Com os resultados, o
35 consumo americano apresenta um carregó de 1,3% t/t anualizado para o 2T24, levemente
36 abaixo dos 1,99% verificados no 1T24. Apesar da desaceleração, não significa que a
37 economia norte americana está fraca. A primeira leitura do Produto Interno Bruto (PIB) no
38 primeiro trimestre mostrou um crescimento de 1,6%, com expectativa de 2,9%. A inflação
39 medida pelo índice CPI em maio variou 0,0% (M/M), ante o crescimento de 0,3% (M/M) em
40 abril. Com o dado de maio, o índice acumulado em 12 meses reduziu de 3,4% para 3,3%
41 (A/A). Enquanto isso o núcleo do CPI, apresentou crescimento de 0,2% (M/M), após avançar
42 0,3% em abril, e o índice acumulado em 12 meses permanece elevado com inflação de 3,4%
43 (A/A), ante 3,6% (A/A). Já a inflação medida pelo PCE de maio apresentou estabilidade, ante
44 o crescimento de 0,3% (M/M) em abril, com desaceleração da inflação anualizada de 2,7%
45 para 2,6%. O núcleo do PCE apresentou crescimento de 0,1% (M/M), com redução do índice
46 acumulado em 12 meses de 2,8% para 2,6%, em linha com a projeção mediana de mercado. O
47 mercado de trabalho continua a mostrar dados robustos. No mês de maio, foram geradas 272
48 mil vagas, superando as expectativas do mercado, que giravam em torno de 180 mil novas
49 vagas. No entanto, mesmo com esse resultado positivo, a taxa de desemprego teve um leve
50 aumento, subindo de 3,9% para 4,0%. Os salários também apresentaram crescimento de
51 4,00% na comparação interanual. Esse cenário continua a pressionar a política monetária, o
52 que pode levar à manutenção das taxas de juros por um período mais longo. Em sua reunião
53 de junho, o Federal Open Market Committee (FOMC) decidiu novamente por manter os juros
54 básicos estáveis no intervalo de 5,25% a 5,50% a.a. em linha com o consenso de mercado. O
55 comunicado trouxe apenas revisões marginais em relação ao anterior, com o comitê
56 atualizando a avaliação do cenário apenas por meio da indicação de que foi observado um
57 modesto progresso em direção ao objetivo de uma inflação de 2% a.a. O presidente do Fed,
58 Jerome Powell, assumiu uma postura bastante moderada, transparecendo a necessidade de
59 manter a cautela diante de um quadro de atividade ainda forte, mercado de trabalho robusto,
60 um pouco mais equilibrado e de uma inflação que acomoda, mas que segue em patamar



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



61 elevado. Na China, por sua vez, o *People's Bank of China* (PBoC) informou que manteve
62 estáveis as suas taxas de empréstimo (*Loan Prime Rate - LPR*), com a taxa de um ano em
63 3,45% e a de 5 anos em 3,95%, conforme amplamente esperado pelo mercado. Ambas as
64 taxas vêm sendo mantidas desde fevereiro. A manutenção das LPRs era amplamente esperada
65 depois que o PBoC decidiu manter inalterada a taxa da linha de crédito de médio prazo
66 (MLF). A produção industrial na China desacelerou de 6,7% (A/A) em março para 5,6%
67 (A/A) em maio, vindo abaixo do consenso de mercado, que previa uma desaceleração aos
68 6,2% (A/A). Houve crescimento em 33 das 41 principais indústrias. Enquanto as vendas no
69 varejo na China aumentaram, de 2,3% em março para 3,7% (A/A) em maio, número acima
70 das estimativas do mercado (3,0%). As exportações avançaram 7,6% em comparação com o
71 mesmo período do ano anterior, enquanto as importações tiveram um avanço de apenas 1,8%,
72 abaixo das expectativas do mercado. Esse resultado tem sustentado o bom desempenho da
73 indústria. No entanto, o segmento imobiliário ainda apresenta dados frustrantes e desempenho
74 abaixo das expectativas. Na Zona do Euro, a inflação medida pelo CPI de maio acelerou para
75 2,6% (A/A), acima das expectativas de mercado (2,5%). Olhando para os principais grupos,
76 destaque para alta da inflação de serviços 4,1% (A/A), voltando a acelerar e atingindo o maior
77 valor dos últimos 6 meses. Por outro lado, registrando redução, a inflação de alimentos
78 marcou 2,6% ante 2,8% A/A. Olhando para as principais economias do bloco, observou-se
79 aceleração na Alemanha (2,8% A/A), na Espanha (3,8% A/A) e na França (2,7% A/A); em
80 sentido oposto, houve desaceleração na Itália (0,8% A/A). O Comitê de Política Monetária
81 (MPC) do BoE (*Bank of England*, sigla em inglês) manteve sua taxa básica de juros em
82 5,25% a.a. pela sétima reunião consecutiva, sendo esse o maior nível de juros desde 2008. O
83 Banco Central Europeu (BCE) reduziu suas três taxas de juros diretoras em 25 bps, em linha
84 com a expectativa do mercado. Assim, as taxas de juros das operações principais de
85 refinanciamento, de cedência de liquidez e de depósito foram reduzidas para,
86 respectivamente, 4,25%, 4,50% e 3,75% a partir de 12 de junho de 2024. No comunicado, a
87 autoridade monetária justificou que a decisão pelo corte foi tomada com base em uma
88 “avaliação atualizada das perspectivas para a inflação, da dinâmica da inflação subjacente e
89 da força da transmissão da política monetária”, considerando ser apropriado “moderar o nível
90 de restrição após nove meses de taxas constantes”. A preocupação continua sendo o forte



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



91 crescimento dos salários e, conseqüentemente, o aumento dos custos de mão de obra. Além
92 disso, os choques sobre os preços causados pela guerra entre Rússia e Ucrânia ainda não se
93 dissiparam totalmente, e a elevação dos fretes marítimos devido às mudanças de rotas diante
94 da insegurança no Mar Negro. No Brasil, a confiança teve predomínio positivo. Destaque
95 para a confiança do consumidor (-4,3% para 2,1%, M/M). Nos dados da economia real, houve
96 números favoráveis em maio, com destaque para taxa de desemprego, recuando de 7,5% para
97 7,1%. Dentre os meses de maio, essa é a menor taxa desde maio de 2014. Em relação aos
98 dados da atividade econômica. Com ajuste sazonal, a taxa de desemprego recuou de 7,3%
99 para 7,0%. Nesse sentido, vale destacar a geração líquida de vagas formais (CAGED) de maio
100 (131.800). Em abril, a indústria recuou 0,5% (M/M), prejudicado por bens intermediários (-
101 1,2%), que tem o maior peso do setor. Entre os ramos, destaque para indústria extrativa (-
102 3,4%), produtos têxteis (-2,8%) e informática (-2,6%). O Índice de Atividade Econômica do
103 Banco Central (IBC-Br) ficou estável na margem mensal. Entre os vetores, destaque positivo
104 para serviços e destaque negativo para varejo ampliado e indústria. Por outro lado, o resultado
105 primário do governo central de maio foi de R\$ -61 bilhões, com destaque para a despesa
106 primária (14%, A/A). Em relação ao campo monetário, o Banco Central do Brasil (BCB)
107 deliberou, por unanimidade, manter a taxa básica de juro (Selic) em 10,50% a.a. A
108 manutenção foi em linha com o mercado. No ambiente externo, o Comitê avaliou que o
109 cenário se manteve adverso, em função da incerteza elevada sobre a flexibilização monetária
110 nos EUA. No ambiente doméstico, o Copom avaliou que o mercado de trabalho segue com
111 dinamismo maior do que o esperado. As projeções de inflação do Copom no cenário de
112 referência foram revisadas para cima (3,8% para 4,0% em 2024; 3,3% para 3,4% em 2025).
113 Os itens do balanço de riscos para a inflação não se alteraram e o parágrafo sobre a condução
114 da política fiscal teve poucas alterações, trazendo a preocupação com o impacto nos ativos
115 financeiros. No que concerne aos próximos passos, não foi fornecido um guidance. O Instituto
116 Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) divulgou o Índice Nacional de Preços ao
117 Consumidor Amplo (IPCA) que avançou +0,21% (M/M) em junho, desacelerando em relação
118 ao avanço de +0,46% (M/M) observado no mês anterior. Sendo que a variação foi inferior à
119 projeção de mercado de +0,32%. Com isso, o índice acumulou alta de +4,23% em 12 meses
120 (ante +3,93% em maio), acelerando assim nessa base de comparação. Os itens que mais



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



121 contribuíram vieram dos grupos de Alimentação e Bebidas (variação de +0,44% ante projeção
122 de +0,71%) e Saúde e cuidados pessoais (+0,54% ante projeção de +0,7%). A maior
123 contribuição para a variação do índice contudo, partiu do grupo Alimentação e bebidas
124 influenciado pelo aumento dos itens de Alimentação no domicílio com destaque para Leites e
125 derivados. Os preços administrados avançaram +0,33% em junho ante +0,55% de maio,
126 influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Pedágio (+3,35% ante -4,99%
127 na leitura anterior). Já os preços livres desaceleraram (+0,16%) ainda se mantendo como os
128 principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres, produtos industriais, alimentos e
129 serviços desaceleraram de +0,29% para +0,13%, de +0,66% para +0,47% e +0,4% para
130 +0,04%, respectivamente. A média dos núcleos desacelerou na comparação mensal (de
131 +0,39% para +0,23%), enquanto quando observada a variação acumulada em 12 meses
132 acelerou para +3,58%. O Ibovespa, principal índice da bolsa de valores brasileira, em junho,
133 apresentou valorização de 1,48% em relação ao mês anterior, fechando aos 123.906 pontos.
134 No ano, o índice acumula queda de -7,6%, se descolando das principais bolsas do mundo.
135 Neste contexto, a performance desfavorável no ano continua sendo explicada, sobretudo, pela
136 possível necessidade de os Estados Unidos permanecerem com uma política monetária
137 contracionista, o que acaba pressionando os juros dos países emergentes, como o Brasil, e
138 dificultando a performance dos ativos de risco. Além disso, no âmbito doméstico, os agentes
139 do mercado permanecem com dúvidas sobre a sustentabilidade do arcabouço fiscal, bem
140 como de que forma se dará a condução da política monetária do próximo presidente do Banco
141 Central, fazendo com que haja estresse nos juros domésticos, no câmbio e no prêmio de risco
142 do país, impactando negativamente a bolsa. Ainda no curto prazo o cenário deve seguir volátil
143 e desfavorável à alocação em equities até que se tenha uma maior certeza acerca do início de
144 cortes de juros pelo Fed. A política monetária norte-americana segue tendo grande influência
145 no desempenho da bolsa brasileira e tem se mostrado o principal fator que dita o apetite a
146 risco de emergentes. Espera-se que o fluxo estrangeiro para o Brasil aumente a partir de uma
147 maior definição do início de cortes pelo FOMC. Internamente, é esperado que o fluxo
148 doméstico aumente a partir de uma Selic mais próxima a um dígito, expectativa que foi
149 prorrogada para o segundo semestre de 2025. **RESULTADO DA CARTEIRA** - No mês de
150 junho, nosso portfólio teve desempenho superior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês

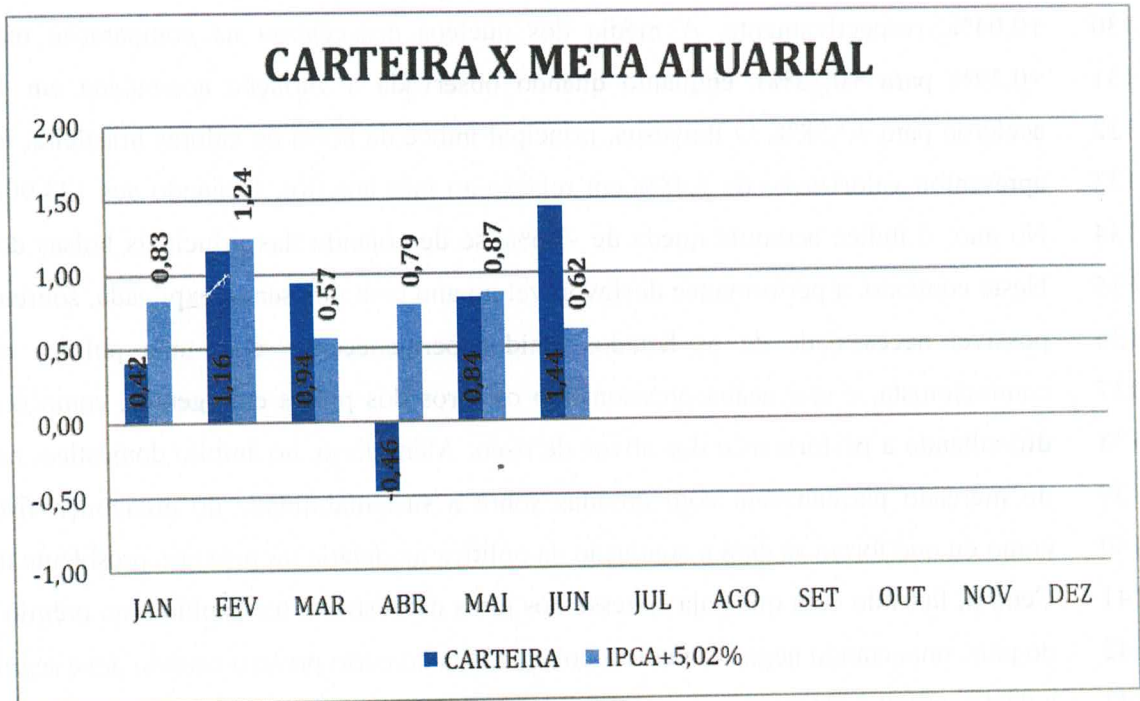


151 com uma rentabilidade de 1,44%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA +
152 5,02%, foi de 0,62%.
153

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							4,41
IPCA+5,02%	0,83	1,24	0,57	0,79	0,87	0,62							5,02

154
155



156
157
158
159
160

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

Handwritten signature

Handwritten mark

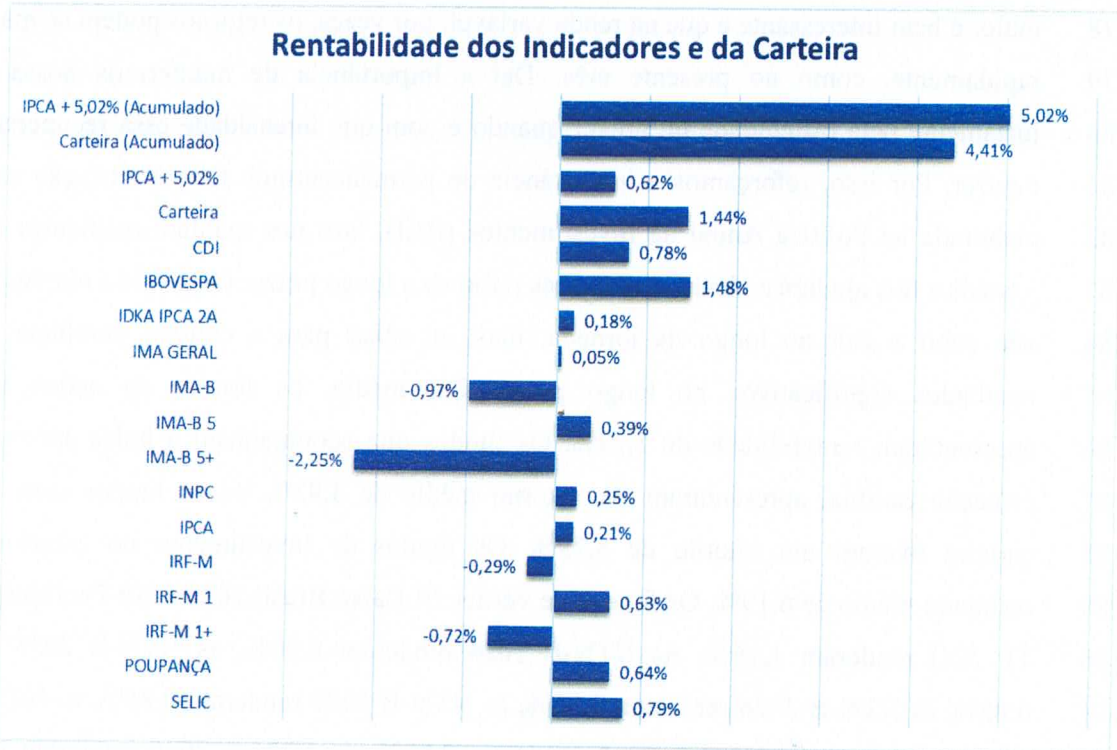
Handwritten signature

Handwritten signature

Handwritten signature

Handwritten signature

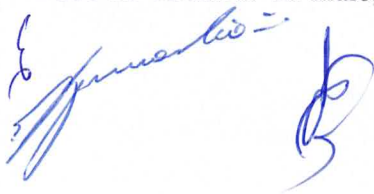
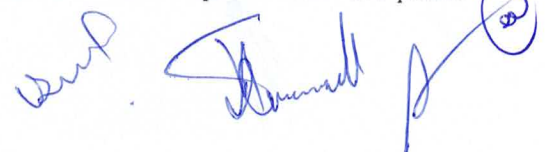
Handwritten signature



161

162

163 No mês de junho, observamos um comportamento positivo em nossos fundos de
 164 investimento. Os investimentos no exterior foram os que mais contribuíram para nossa
 165 carteira. Dessa forma, as maiores altas na carteira foram do Caixa Institucional BDR Nível I
 166 com 12,73%, BB Multimercado Global Select Equity IE com 10,57% e BB Ações Globais
 167 Institucional BDR Nível I com 9,77%. Esse desempenho positivo deve-se, principalmente, à
 168 ótima temporada de resultados corporativos nos EUA e ao boom das empresas de tecnologia,
 169 especialmente ligadas a projetos de inteligência artificial. Isso foi extremamente benéfico para
 170 a classe de ativos e, conseqüentemente, para a nossa carteira. Nesse mês, a bolsa brasileira
 171 acompanhou o cenário global. Falas mais comedidas do Presidente Lula, acenando que o
 172 governo começará a cortar gastos geraram um certo alívio. Dessa forma, quase toda a carteira
 173 do Macaeprev fechou no campo positivo, com apenas três fundos com rendimentos negativos:
 174 Caixa Brasil Ações Livre com -0,11%, Caixa Small Caps Ativo com -0,44% e Caixa FI Brasil
 175 IMA-B 5+ com -2,25%. Com isso, as forças vendedoras, devido ao contexto
 176 macroeconômico, reduziram a pressão nas cotações das nossas empresas. Dessa forma, como
 177 expressado no relatório de maio, entendemos que a taxa de retorno esperada em um prazo



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



178 maior é bem interessante e que na renda variável, por vezes, os retornos podem se materializar
179 rapidamente, como no presente mês. Daí a importância de mantermos nossa posição,
180 justamente pela dificuldade de prever quando e com que intensidade essa recuperação pode
181 ocorrer. Por isso, reforçamos a importância de permanecermos fiéis à alocação estratégica
182 elaborada na Política Anual de Investimentos (PAI). Isso nos manterá resilientes durante a
183 jornada e nos ajudará a alcançar melhores retornos a longo prazo. Os ativos e classes de ativos
184 vão subir e cair ao longo da jornada, mas, ao olhar para a carteira completa, veremos
185 resultados significativos no longo prazo. Em média, os fundos de ações brasileiras
186 apresentaram rentabilidade de 1,22%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com
187 proteção cambial apresentaram um retorno médio de 3,93%. Já os fundos com BDRs na
188 carteira tiveram um retorno de 8,23%. Os fundos de investimento no exterior tiveram
189 resultado médio de 6,19%. Os fundos de vértice FI Caixa Brasil 2024 e BB Previdenciário RF
190 TP XXI renderam 1,16%. As NTN-B 2024 renderam 0,90%, as NTN-B 2025 renderam
191 0,85%, as NTN-B 2026 renderam 0,86%, as NTN-B 2027 renderam 0,86%, as NTN-B 2028
192 renderam 0,86%, as NTN-B 2040 renderam 0,83%, as NTN-B 2045 renderam 0,83%, as
193 NTN-B 2050 renderam 0,84%, as NTN-B 2055 renderam 0,84% e as NTN-B 2060 renderam
194 0,84%. Em média, as NTN-B ficaram com 0,85%. Os fundos de renda fixa indexados ao
195 CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,80%. O fundo de renda fixa com gestão ativa
196 rendeu 1,22%. O fundo IMA-B 5 teve um retorno de 0,37%. O fundo IMA-B 5+ teve retorno
197 de -2,25%. O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade positiva de 0,66%. Até
198 30/06/2024 foram resgatados o total de R\$ 10.132.155,67 (dez milhões e cento e trinta e dois
199 mil e cento e cinquenta e cinco reais e sessenta e sete centavos), mais de 100% do capital total
200 investido. O saldo em 30 de junho estava em R\$ 2.141.614,47 (dois milhões e cento e
201 quarenta e um mil e seiscentos e quatorze reais e quarenta e sete centavos). O gráfico a seguir
202 mostra a comparação entre a rentabilidade dos fundos e a Meta Atuarial. Os fundos em verde
203 bateram a Meta Atuarial, os fundos em amarelo apresentaram resultado positivo, porém,
204 abaixo da Meta Atuarial e os fundos em vermelho tiveram resultado negativo.
205

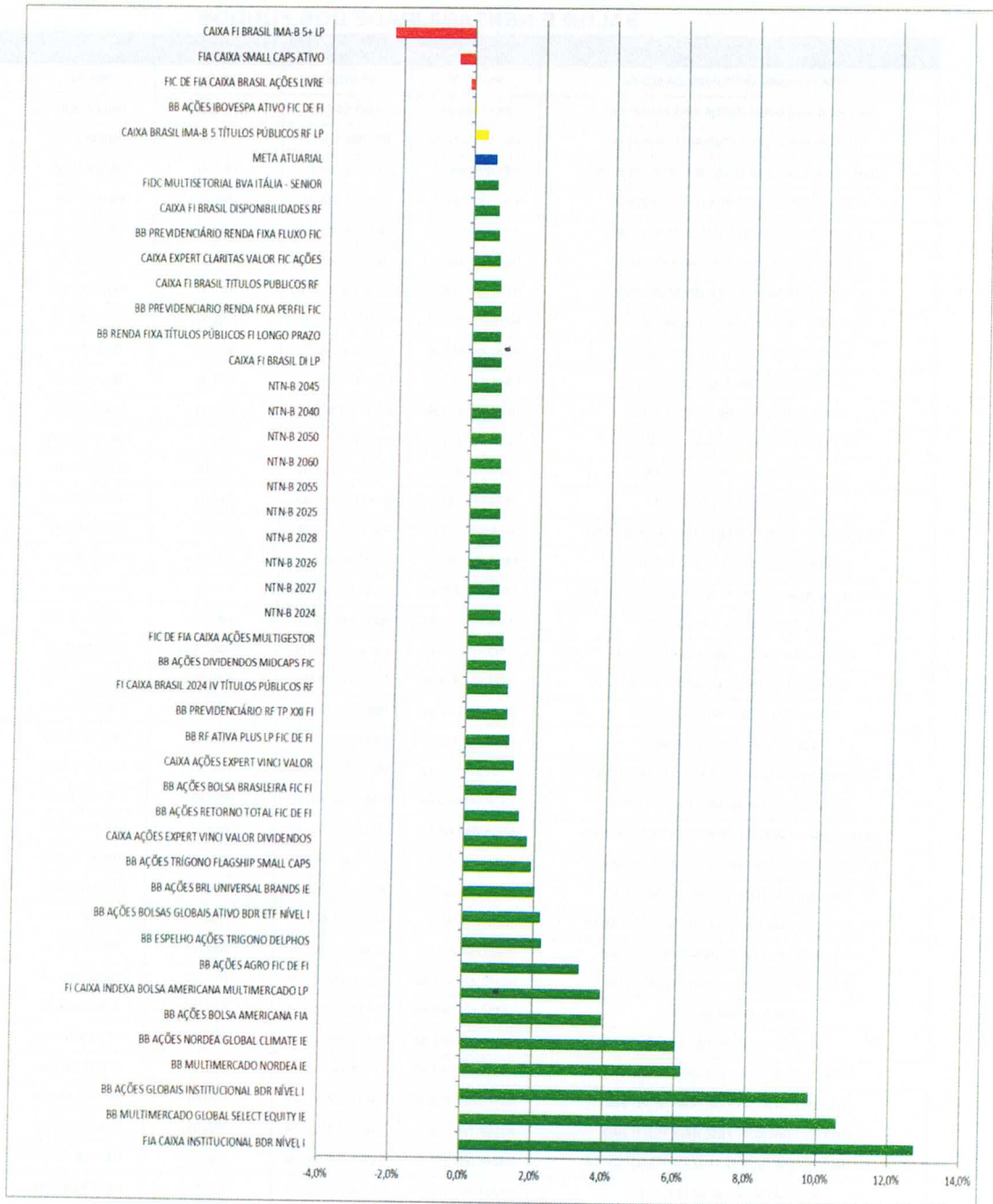
Handwritten signature in blue ink.

Handwritten signature in blue ink.

Handwritten signature in blue ink.

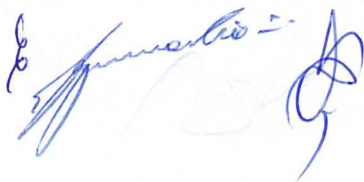
Handwritten signature in blue ink.

Handwritten signature in blue ink.



206
207
208
209
210
211

O rendimento de junho da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 63.446.958,56 (sessenta e três milhões e quatrocentos e quarenta e seis mil e novecentos e cinquenta e oito reais e cinquenta e seis centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de junho em R\$ 4.469.121.176,15 (quatro bilhões e quatrocentos e sessenta e nove milhões e cento e vinte e um mil e cento e setenta e seis reais e quinze centavos).






Pró-Gestão
RPPS

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



SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS

Fundo de Investimento	Saldo em 31/05/2024	Saldo em 30/06/2024	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$101,78	R\$102,50	R\$0,00	R\$0,72	0,71%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$11.686,24	R\$42.061,84	R\$16.856,69	R\$13.518,91	0,72%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2024	R\$1.051.309,24	R\$1.060.870,73	R\$0,00	R\$9.561,49	0,90%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	R\$2.096.303,37	R\$2.112.798,41	R\$0,00	R\$16.495,04	0,79%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$2.127.494,56	R\$2.141.614,47	R\$0,00	R\$14.119,91	0,66%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$4.477.462,77	R\$4.510.382,70	R\$0,00	R\$32.919,93	0,74%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$6.354.406,83	R\$6.403.669,35	R\$0,00	R\$49.262,52	0,78%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	R\$18.439.175,01	R\$18.788.876,02	R\$0,00	R\$349.701,01	1,90%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	R\$18.833.274,03	R\$19.049.301,95	R\$0,00	R\$416.027,92	2,23%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$20.252.552,66	R\$20.258.189,72	R\$0,00	R\$5.637,06	0,03%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	R\$21.054.163,59	R\$21.477.409,36	R\$0,00	R\$423.245,77	2,01%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	R\$23.550.439,28	R\$23.873.969,53	R\$0,00	R\$323.530,25	1,37%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	R\$23.887.334,95	R\$25.323.574,41	R\$0,00	R\$1.436.239,46	6,01%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$29.643.933,33	R\$30.074.637,39	R\$0,00	R\$430.704,06	1,45%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$42.615.088,09	R\$44.020.481,93	R\$0,00	R\$1.405.393,84	3,30%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	R\$44.092.203,99	R\$44.875.464,09	R\$0,00	R\$783.260,10	1,78%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$45.960.556,79	R\$46.665.967,16	R\$0,00	R\$705.410,37	1,53%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$47.199.570,63	R\$48.230.991,74	R\$0,00	R\$1.031.421,11	2,19%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$49.425.514,98	R\$49.206.187,76	R\$0,00	-R\$219.327,22	-0,44%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$50.212.765,42	R\$50.714.323,73	R\$0,00	R\$501.558,31	1,00%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$51.744.676,04	R\$52.310.587,90	R\$0,00	R\$565.911,86	1,09%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$50.944.107,29	R\$52.853.859,67	R\$0,00	R\$2.009.752,38	3,95%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$50.412.475,42	R\$53.529.463,64	R\$0,00	R\$3.116.988,22	6,18%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$54.823.037,62	R\$56.961.370,67	R\$0,00	R\$2.138.333,05	3,90%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$57.199.055,65	R\$57.136.344,41	R\$0,00	-R\$62.711,24	-0,11%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$59.706.665,78	R\$66.015.372,28	R\$0,00	R\$6.308.706,50	10,57%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$63.468.175,60	R\$69.669.670,03	R\$0,00	R\$6.201.494,43	9,77%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$66.149.094,79	R\$74.571.492,51	R\$0,00	R\$8.422.397,72	12,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$80.212.856,42	R\$80.511.538,21	R\$0,00	R\$298.681,79	0,37%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2060	R\$88.469.311,45	R\$89.221.389,60	R\$0,00	R\$752.078,15	0,84%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2040	R\$101.479.976,04	R\$102.337.936,48	R\$0,00	R\$857.960,44	0,83%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$116.607.365,69	R\$117.561.893,32	R\$0,00	R\$954.527,63	0,82%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	R\$144.035.958,52	R\$140.798.982,65	R\$0,00	-R\$3.236.975,87	-2,25%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2028	R\$151.871.781,57	R\$153.194.372,51	R\$0,00	R\$1.322.590,94	0,86%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2055	R\$185.527.709,76	R\$187.104.221,28	R\$0,00	R\$1.576.511,52	0,84%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2026	R\$204.740.638,02	R\$206.513.329,04	R\$0,00	R\$1.772.691,02	0,86%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$214.660.220,37	R\$217.148.956,06	R\$0,00	R\$2.488.735,69	1,16%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	R\$221.353.037,86	R\$224.052.911,32	R\$0,00	R\$2.699.873,46	1,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$240.890.709,58	R\$243.685.097,73	R\$0,00	R\$2.794.388,15	1,16%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2045	R\$267.828.953,47	R\$270.098.364,07	R\$0,00	R\$2.269.410,60	0,83%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2050	R\$293.580.272,89	R\$296.073.678,86	R\$0,00	R\$2.493.405,97	0,84%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2027	R\$346.158.955,32	R\$349.174.118,74	R\$0,00	R\$3.015.163,42	0,86%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$417.600.781,43	R\$418.779.757,80	-R\$2.110.000,00	R\$3.288.976,37	0,79%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2025	R\$427.216.206,78	R\$430.885.592,58	R\$0,00	R\$3.669.385,80	0,85%
TOTAL	R\$4.407.767.360,90	R\$4.469.121.176,15	-R\$2.093.143,31	R\$63.446.958,56	1,44%

212



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



213 DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA
214 ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024
215

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		46,67%	100,00%	50,00%	100,00%	Não se Aplica	R\$2.085.663.873,89
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	IPCA+	46,67%	100,00%	50,00%	100,00%	NA	R\$2.085.663.873,89
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		15,45%	100,00%	50,00%	100,00%	100,00%	R\$690.661.042,41
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	CDI	0,05%	100,00%	50,00%	100,00%	0,01%	R\$2.112.798,41
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	0,14%	100,00%	50,00%	100,00%	0,06%	R\$6.403.669,35
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	1,80%	100,00%	50,00%	100,00%	1,10%	R\$80.511.538,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	4,86%	100,00%	50,00%	100,00%	5,38%	R\$217.148.956,06
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	IMA-B 5+	3,15%	100,00%	50,00%	100,00%	12,30%	R\$140.798.982,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	5,45%	100,00%	50,00%	100,00%	6,59%	R\$243.665.097,73
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		17,02%	65,00%	65,00%	20,00%	15,00%	R\$760.436.728,78
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	9,37%	65,00%	65,00%	20,00%	2,35%	R\$418.779.757,80
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$42.061,84
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	CDI	5,01%	65,00%	65,00%	20,00%	4,68%	R\$224.052.911,32
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	2,63%	65,00%	65,00%	20,00%	0,71%	R\$117.561.893,32
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$102,50
Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior		0,05%	5,00%	0,20%	20,00%	5,00%	R\$2.141.614,47
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,05%	5,00%	0,20%	20,00%	3,64%	R\$2.141.614,47
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		11,51%	35,00%	25,00%	20,00%	15,00%	R\$514.438.573,96
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,45%	35,00%	25,00%	20,00%	14,49%	R\$20.258.189,72
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,67%	35,00%	25,00%	20,00%	14,87%	R\$30.074.637,39
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,98%	35,00%	25,00%	20,00%	22,66%	R\$44.020.481,93
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	1,18%	35,00%	25,00%	20,00%	3,80%	R\$52.953.859,67
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,04%	35,00%	25,00%	20,00%	6,69%	R\$46.665.967,16
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	1,17%	35,00%	25,00%	20,00%	7,23%	R\$52.310.587,90
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	IDIV	0,43%	35,00%	25,00%	20,00%	9,92%	R\$19.049.301,95
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	SMLL	0,42%	35,00%	25,00%	20,00%	33,61%	R\$18.788.876,02
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	IBOVESPA	0,53%	35,00%	25,00%	20,00%	3,19%	R\$23.873.969,53
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	IDIV	1,00%	35,00%	25,00%	20,00%	4,43%	R\$44.875.464,09
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,10%	35,00%	25,00%	20,00%	16,35%	R\$4.510.382,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,10%	35,00%	25,00%	20,00%	8,15%	R\$49.206.187,76
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,13%	35,00%	25,00%	20,00%	9,26%	R\$50.714.323,73
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,28%	35,00%	25,00%	20,00%	8,65%	R\$57.136.344,41
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível I		4,31%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	R\$192.472.154,28
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,56%	10,00%	10,00%	20,00%	4,22%	R\$69.669.670,03
BB AÇÕES BOLSA GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	1,08%	10,00%	10,00%	20,00%	12,04%	R\$48.230.991,74
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,67%	10,00%	10,00%	20,00%	2,72%	R\$74.571.492,51
Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior		3,72%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	R\$168.345.819,69
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	1,48%	10,00%	10,00%	20,00%	4,22%	R\$66.015.372,28
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	MSCI WORLD	0,57%	10,00%	10,00%	20,00%	6,26%	R\$25.323.574,41
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	MSCI WORLD	0,48%	10,00%	10,00%	20,00%	9,92%	R\$21.477.409,36
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	1,20%	10,00%	10,00%	20,00%	41,60%	R\$53.529.463,64
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		1,27%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	R\$56.961.370,67
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,27%	10,00%	10,00%	20,00%	2,89%	R\$56.961.370,67
Total:							R\$4.469.121.176,15

216

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

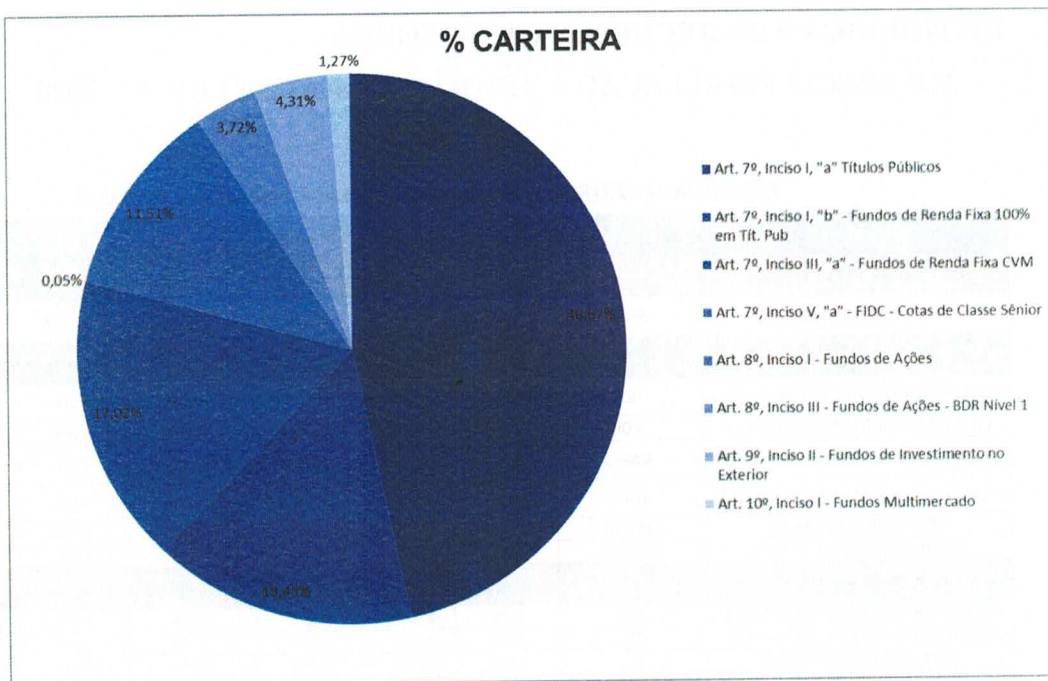
[Handwritten signature]

[Handwritten signature]



Pró-Gestão
RPPS

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



217
218
219
220

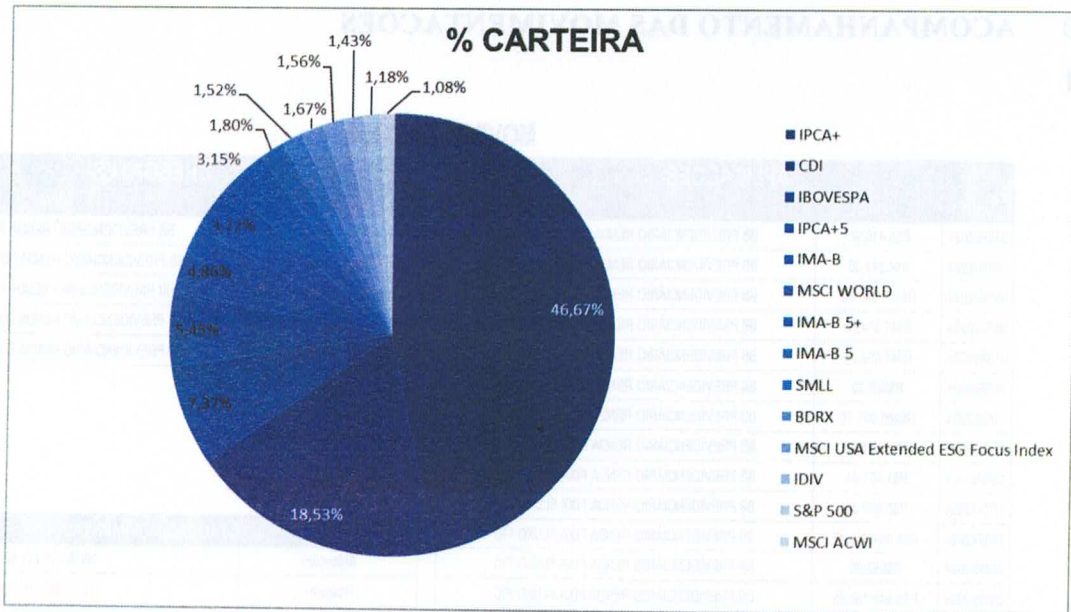
DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 31/05/2024	Participação
IPCA+	R\$2.085.663.873,89	46,67%
CDI	R\$828.056.179,68	18,53%
IBOVESPA	R\$329.564.884,47	7,37%
IPCA+5	R\$243.685.097,73	5,45%
IMA-B	R\$217.148.956,06	4,86%
MSCI WORLD	R\$166.345.819,69	3,72%
IMA-B 5+	R\$140.798.982,65	3,15%
IMA-B 5	R\$80.511.538,21	1,80%
SMLL	R\$67.995.063,78	1,52%
BDRX	R\$74.571.492,51	1,67%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$69.669.670,03	1,56%
IDIV	R\$63.924.766,04	1,43%
S&P 500	R\$52.953.859,67	1,18%
MSCI ACWI	R\$48.230.991,74	1,08%
Total	R\$4.469.121.176,15	100,00%

221
222

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



223

224

225

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

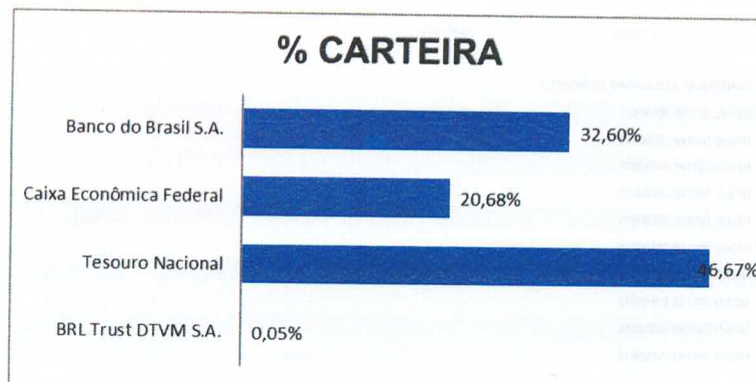
226

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$2.141.614,47	0,05%
Tesouro Nacional	R\$2.085.663.873,89	46,67%
Caixa Econômica Federal	R\$924.274.677,49	20,68%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.457.041.010,30	32,60%

227

228



229



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



230 ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

231

MOVIMENTAÇÕES

APLICAÇÕES		
Data	Valor	
03/06/2024	R\$5.410,96	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
04/06/2024	R\$4.342,05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
05/06/2024	R\$138.641,85	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
06/06/2024	R\$41.374,25	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
07/06/2024	R\$45.652,61	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
10/06/2024	R\$229,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
11/06/2024	R\$288.991,16	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
12/06/2024	R\$46.386,08	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
13/06/2024	R\$1.451,94	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
17/06/2024	R\$5.830,37	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
20/06/2024	R\$4.604.316,28	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
24/06/2024	R\$652,08	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
25/06/2024	R\$9.949.132,45	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
27/06/2024	R\$2.832,24	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

RESGATES		
Data	Valor	Ativo
05/06/2024	R\$810.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
14/06/2024	R\$5.188,06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
26/06/2024	R\$1.300.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
26/06/2024	R\$14.122.342,03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
28/06/2024	R\$990.856,84	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$15.135.243,62
Resgates	-R\$17.228.386,93
Saldo	-R\$2.093.143,31

232

233

234 MONITORAMENTO DE RISCOS

235

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

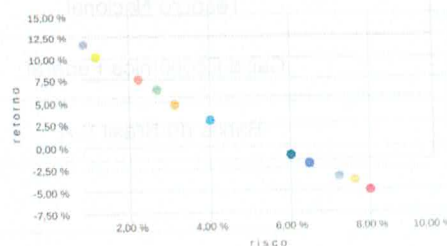
237

Gráficos

Retorno Acumulado - 02/07/2023 a 28/06/2024 (diária)



Risco x Retorno - 02/07/2023 a 28/06/2024 (diária)



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1

- NTN-B 760199 20240815
- NTN-B 760199 20250515
- NTN-B 760199 20260815
- NTN-B 760199 20270515
- NTN-B 760199 20280815
- NTN-B 760199 20400815
- NTN-B 760199 20450515
- NTN-B 760199 20500815
- NTN-B 760199 20550515
- NTN-B 760199 20600815

238



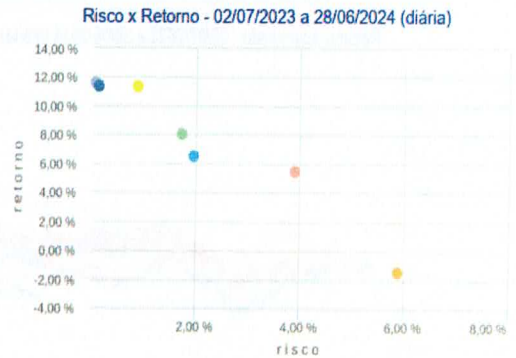
Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência
Comitê de Investimentos



239
240

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

Gráficos

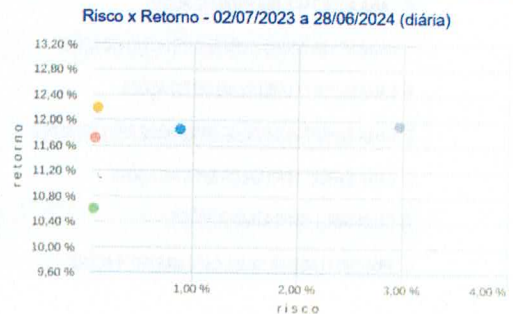


- PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
- BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
- BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
- CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

241
242
243
244

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

245

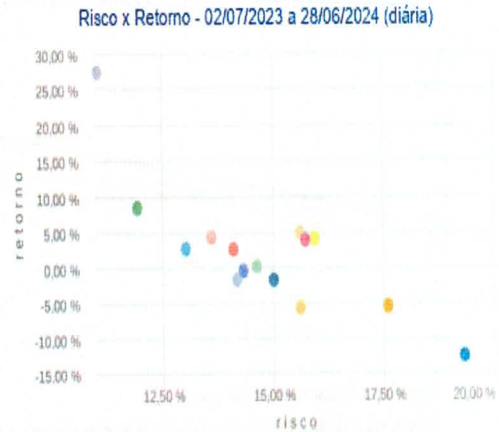
Handwritten signatures and initials at the bottom of the page.

246

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

247

Gráficos



- PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
- BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES
- BB AGRO FIC AÇÕES
- BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES
- BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES
- BB 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

248

249

250

251

252

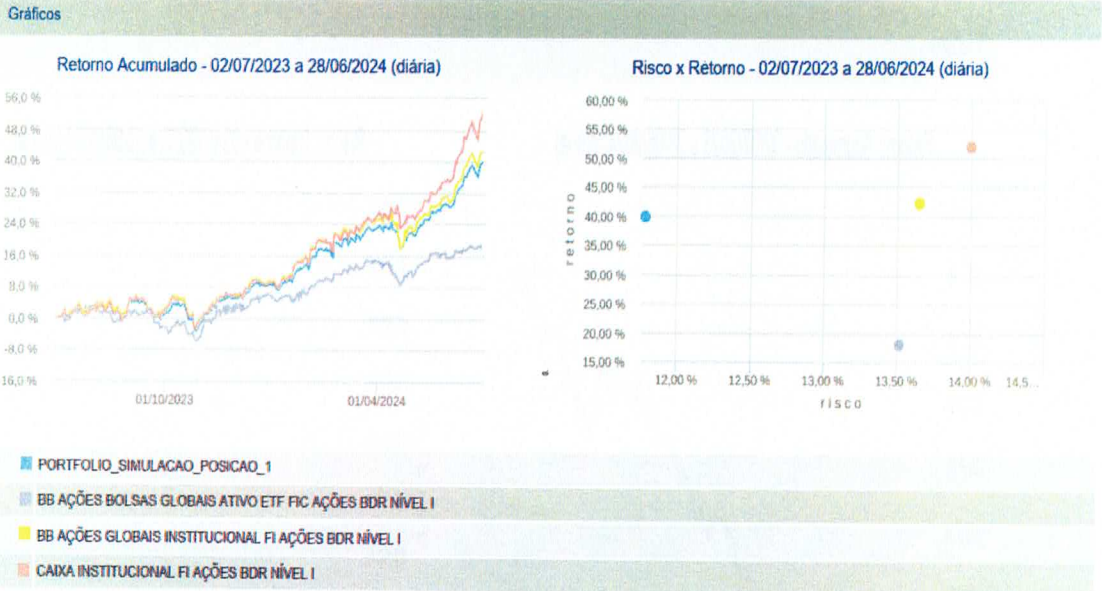
(Handwritten signature)

(Handwritten signature)

(Handwritten signature)

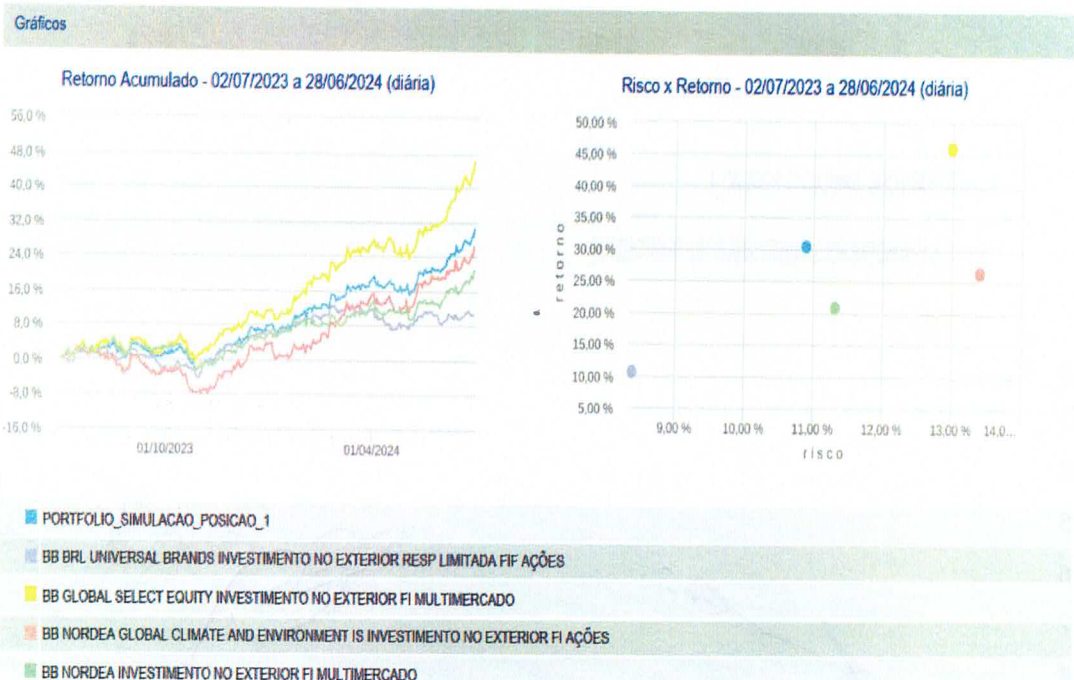
253
254

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



255
256
257
258

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



259




260
261

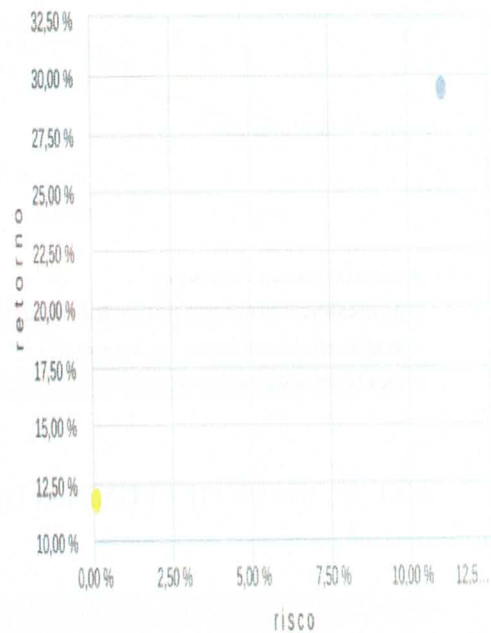
ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO

Gráficos

Retorno Acumulado - 02/07/2023 a 28/06/2024 (diária)



Risco x Retorno - 02/07/2023 a 28/06/2024 (diária)



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

262
263
264
265
266
267
268

Handwritten signature

Handwritten signature

Handwritten signature

Handwritten signature



Pró-Gestão
RPPS

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



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

270

ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS

Fundo de Investimento	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	VaR 21du 95%
CDI	0,78%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,81%	
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,78%	5,19%	2,51%	5,19%	11,33%	26,39%	0,03%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,77%	4,99%	2,38%	4,99%	11,33%	26,39%	0,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,78%	5,24%	2,52%	5,24%	11,70%	26,83%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	0,71%	4,70%	2,27%	4,70%	10,58%	24,34%	0,03%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	1,22%	7,47%	3,83%	7,47%	11,92%	24,18%	0,34%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,81%	5,36%	2,57%	5,36%	12,19%	27,39%	0,03%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,70%	4,69%	2,27%	4,69%	10,59%	23,51%	0,03%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	0,66%	-1,38%	-3,06%	-1,38%	206,83%	25,11%	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	3,90%	16,69%	5,01%	16,69%	29,36%	66,02%	0,42%
IMA-B 5	0,39%	3,32%	1,24%	3,32%	8,22%	19,29%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	0,37%	3,20%	1,17%	3,20%	7,97%	18,81%	0,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,37%	3,21%	1,18%	3,21%	7,99%	18,98%	0,14%
IMA-B	-0,96%	-1,09%	-1,27%	-1,09%	3,06%	17,00%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	-0,99%	-1,22%	-1,34%	-1,22%	2,87%	16,57%	0,44%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,15%	2,78%	2,86%	2,78%	5,45%	7,72%	0,04%
IMA-B 5+	-2,25%	-6,04%	-3,58%	-6,04%	-1,43%	14,67%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	-2,28%	-5,20%	-3,65%	-5,20%	-1,73%	13,88%	0,74%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	-2,24%	-5,07%	-3,61%	-5,07%	-1,41%	14,08%	0,73%
IPCA + 5%	0,60%	4,97%	2,29%	4,97%	9,43%	18,69%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	1,16%	5,72%	2,86%	5,72%	11,34%	20,69%	0,04%
IBOVESPA	1,48%	-9,01%	-5,37%	-4,11%	12,70%	9,65%	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	0,03%	-11,99%	-6,72%	-11,99%	-1,82%	15,53%	1,29%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	1,45%	-7,98%	-3,46%	-7,98%	4,14%	24,07%	1,17%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	3,29%	-5,65%	-3,66%	-5,65%	3,90%	11,32%	1,55%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	1,53%	-12,64%	-6,03%	-12,64%	-0,45%	5,66%	1,18%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	1,09%	-5,84%	-7,70%	-5,84%	0,15%	28,14%	1,52%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	1,37%	-8,82%	-5,44%	-8,81%	2,40%	17,86%	1,23%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	0,74%	-5,63%	-5,40%	-5,63%	3,76%	18,93%	1,50%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	0,99%	-9,38%	-6,70%	-9,38%	-1,76%	13,42%	1,39%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	-0,11%	-6,86%	-7,64%	-6,86%	4,76%	26,67%	1,87%
IDIV	1,99%	-3,40%	0,59%	-3,40%	11,68%	31,09%	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	1,77%	-3,39%	-1,09%	-3,39%	8,55%	27,99%	1,06%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	2,23%	-10,43%	-5,35%	-10,43%	-5,79%	0,00%	1,26%
SMLL	-0,39%	-14,83%	-10,38%	-14,83%	-10,97%	3,99%	
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	1,89%	-11,14%	-6,39%	-11,15%			1,24%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-0,44%	-15,11%	-11,33%	-15,11%	-12,55%	3,93%	1,94%
BDRX	12,79%	41,07%	21,74%	41,07%	58,78%	77,13%	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,73%	39,51%	21,34%	39,51%	52,17%	72,57%	1,19%
MSCI WORLD	1,93%	10,81%	2,18%	10,81%	20,22%	34,06%	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	10,56%	31,46%	15,78%	31,46%	46,24%	65,37%	0,77%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	6,01%	22,20%	10,70%	22,20%	26,36%	31,90%	1,06%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	2,01%	3,74%	-0,96%	3,74%	10,52%	32,49%	0,70%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	6,18%	14,49%	7,43%	14,49%	20,68%	22,23%	0,82%
MSCI ACWI	2,10%	10,32%	2,41%	10,32%	19,02%	30,90%	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	2,18%	11,40%	2,92%	11,40%	18,06%	37,04%	0,58%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	3,37%	13,67%	3,62%	13,67%	24,20%	37,41%	
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9,77%	30,17%	14,25%	30,17%	42,37%	57,22%	1,03%
S&P 500	5,34%	11,21%	4,63%	16,67%	27,78%	33,32%	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	3,94%	16,23%	5,15%	16,23%	27,38%	56,33%	0,48%

271
272

273 RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

274

275 RENTABILIDADE

276

277 A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,36% no mês de junho,
278 totalizando um saldo de R\$ 242.228.375,12 (duzentos e quarenta e dois milhões e duzentos e
279 vinte e oito mil e trezentos e setenta e cinco reais e doze centavos).

280

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

282

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		53,89%	100,00%	✓	50,00%	✓	100,00%	✓	100,00%	✓	R\$130.568.903,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PUBLICOS 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
Art. 7º, inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		34,09%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$82.584.332,76
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
Art. 10º, inciso I - Fundos Multimercado		12,02%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	15,00%	✓	R\$29.127.799,32
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,02%	10,00%	✓	10,00%	✓	20,00%	✓	2,15%	✓	R\$29.127.799,32
Total:											R\$242.281.035,32

283

284

285

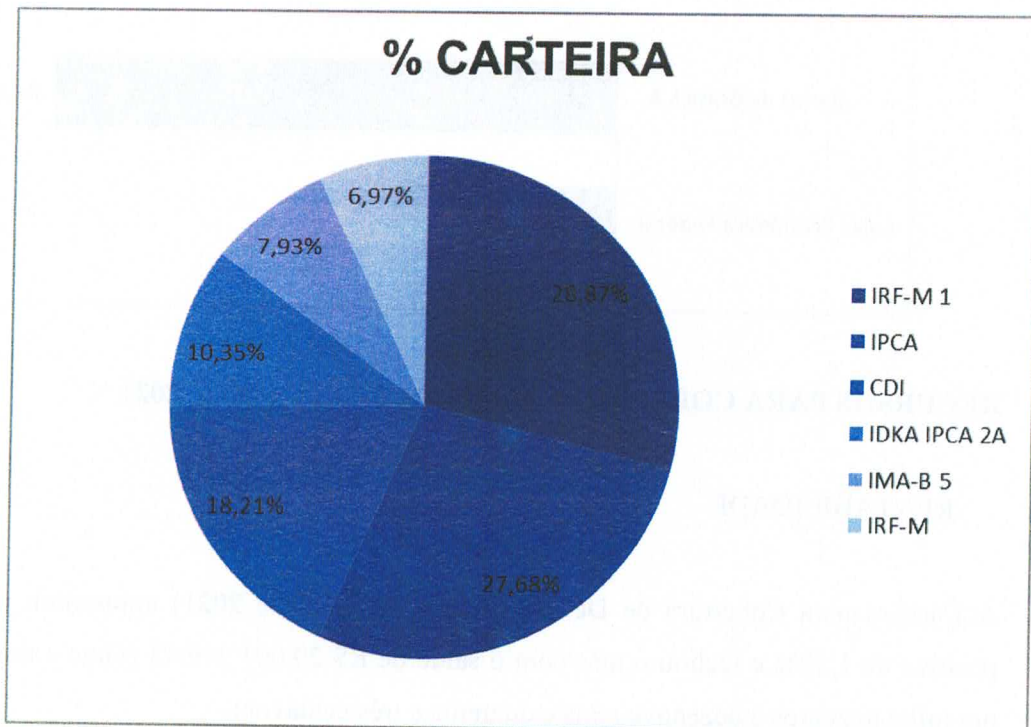
DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
IRF-M 1	R\$69.927.835,89	28,87%
IPCA	R\$67.037.846,58	27,68%
CDI	R\$44.118.793,09	18,21%
IDKA IPCA 2A	R\$25.066.564,91	10,35%
IMA-B 5	R\$19.196.706,21	7,93%
IRF-M	R\$16.880.628,44	6,97%
	R\$242.228.375,12	100,00%

286

287



288

289



290 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

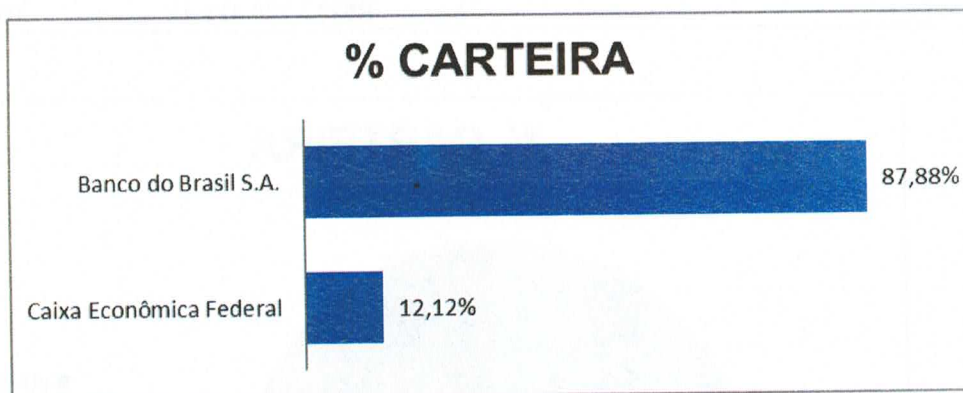
291

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$29.355.751,52	12,12%
Banco do Brasil S.A.	R\$212.872.623,60	87,88%

292

293



294

295

296 RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

297

298 RENTABILIDADE

299

300 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado
301 positivo de 1,52% e fechou o mês com o saldo de R\$ 29.001.319,43 (vinte e nove milhões e
302 um mil e trezentos e dezenove reais e quarenta e três centavos).

303

304

305

306

307

308

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

309

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		59,66%	100,00%	50,00%	100,00%	100,00%	R\$17.013.285,61
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
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		15,71%	65,00%	65,00%	20,00%	15,00%	R\$4.486.471,91
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,71%	65,00%	65,00%	20,00%	0,07%	R\$4.486.471,91
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		6,72%	35,00%	25,00%	20,00%	15,00%	R\$1.916.313,72
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
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível I		9,94%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	R\$2.838.365,04
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
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		8,09%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	R\$2.310.637,07
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
Total:							R\$28.567.973,25

310

311

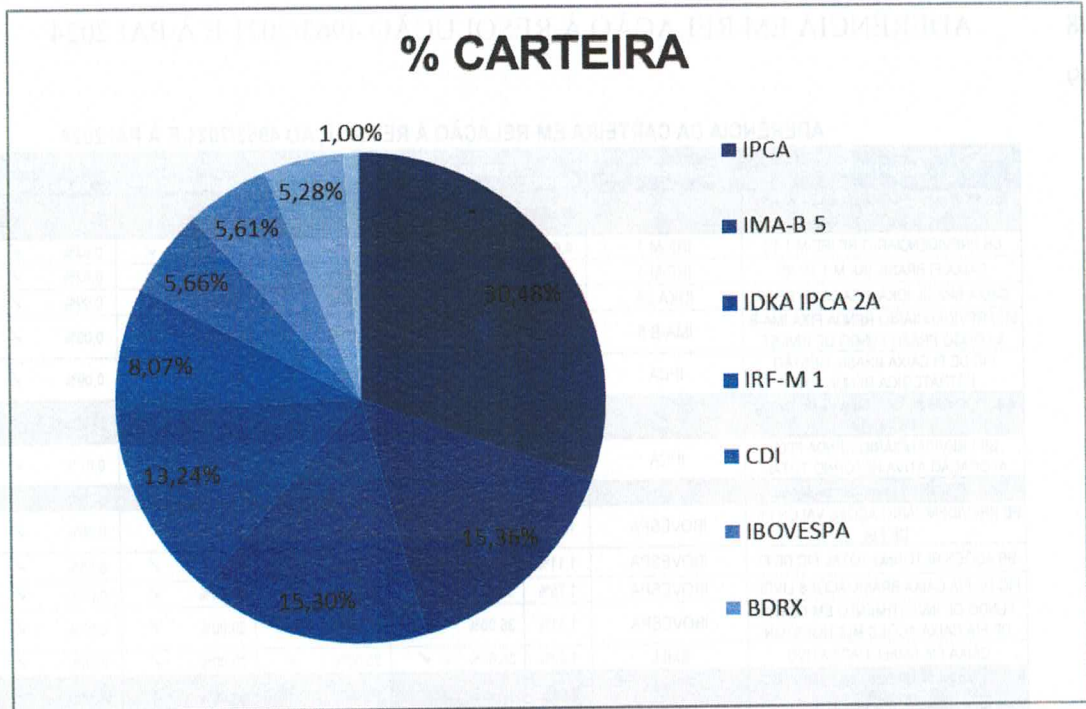
DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
IPCA	R\$8.840.269,06	30,48%
IMA-B 5	R\$4.454.371,80	15,36%
IDKA IPCA 2A	R\$4.437.893,77	15,30%
IRF-M 1	R\$3.840.185,15	13,24%
CDI	R\$2.340.116,29	8,07%
IBOVESPA	R\$1.641.181,91	5,66%
BDRX	R\$1.627.662,40	5,61%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.530.797,89	5,28%
SMLL	R\$288.841,16	1,00%
	R\$29.001.319,43	100,00%

312

313



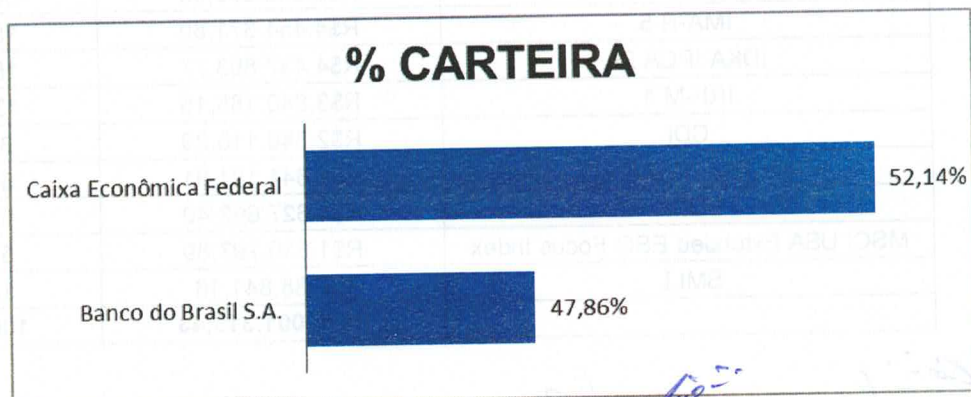
314
315
316
317

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$13.881.220,68	47,86%
Caixa Econômica Federal	R\$15.120.098,75	52,14%

318
319



320

321

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

323

324 **RENTABILIDADE**

325

326 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de
327 1,16% e fechou o mês com o saldo de R\$ 20.750.140,59 (vinte milhões e setecentos e
328 cinquenta mil e cento e quarenta reais e cinquenta e nove centavos).

329

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

331

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		97,12%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$20.152.165,65
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA + 5%	97,12%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,58% ✓	R\$20.152.165,65
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$597.974,94
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$597.974,94
Total:							R\$20.750.140,59

332

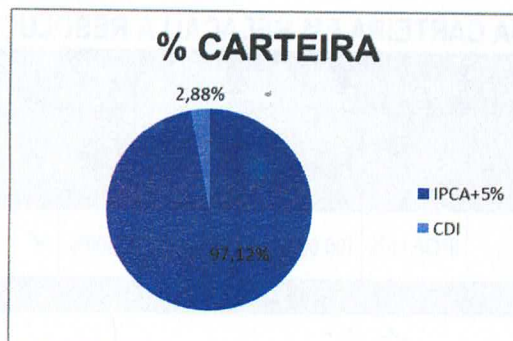
333

334 **DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
IPCA+5%	R\$20.152.165,65	97,12%
CDI	R\$597.974,94	2,88%
	R\$20.750.140,59	100,00%

335



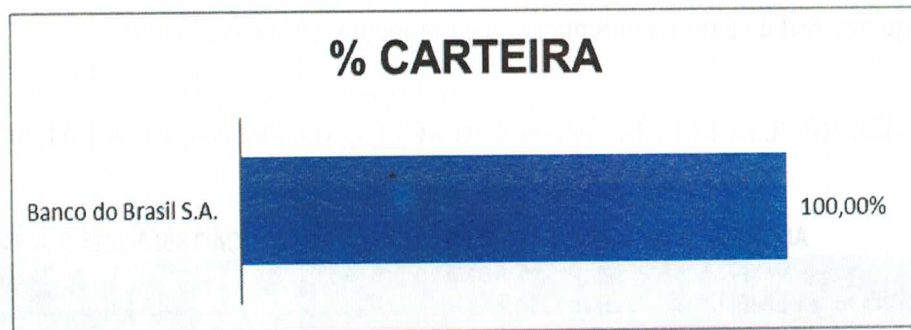
336

337 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA
338

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$20.750.140,59	100,00%

339
340



341
342

RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023

343
344
345

RENTABILIDADE

346 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um
347 resultado de 1,17% e fechou o mês com o saldo de R\$ 35.333.842,83 (trinta e cinco milhões e
348 trezentos e trinta e três mil e oitocentos e quarenta e dois reais e oitenta e três centavos).

349

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

350
351

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\$35.333.842,83
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA+5%	100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,02% ✓	R\$35.333.842,83
Total:							R\$35.333.842,83

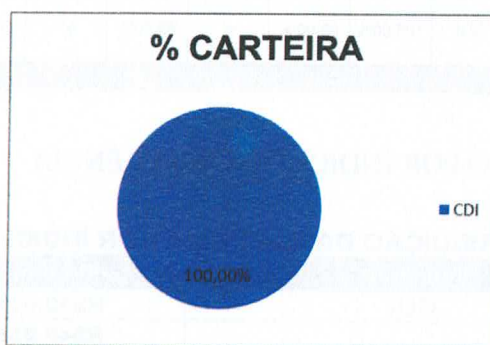
352
353

354 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
IPCA+5%	R\$35.333.842,83	100,00%
	R\$35.333.842,83	100,00%

355

356



357

358

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

359

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$35.333.842,83	100%

360

361



362

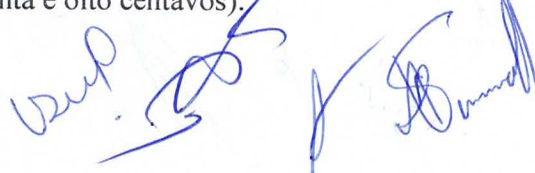
363

364 RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2024

365 RENTABILIDADE

366

367 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2024) apresentou um resultado de
 368 0,79% e fechou o mês com o saldo de R\$ 40.935.382,38 (quarenta milhões e novecentos e
 369 trinta e cinco mil e trezentos e oitenta e dois reais e trinta e oito centavos).


370 ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024
371

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\$40.935.382,38
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	100,00%	65,00%	✓	65,00%	✓	20,00%	✓	0,23%	✓	R\$40.935.382,38
Total: R\$40.935.382,38											

372
373

374 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/06/2024	Participação
CDI	R\$40.935.382,38	100,00%
	R\$40.935.382,38	100,00%

375



376

377 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$40.935.382,38	100%

378

379



380

381 **CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES**
382 **TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE**
383 **INVESTIMENTOS**
384

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

385



386 CUSTO SELIC PARA OS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

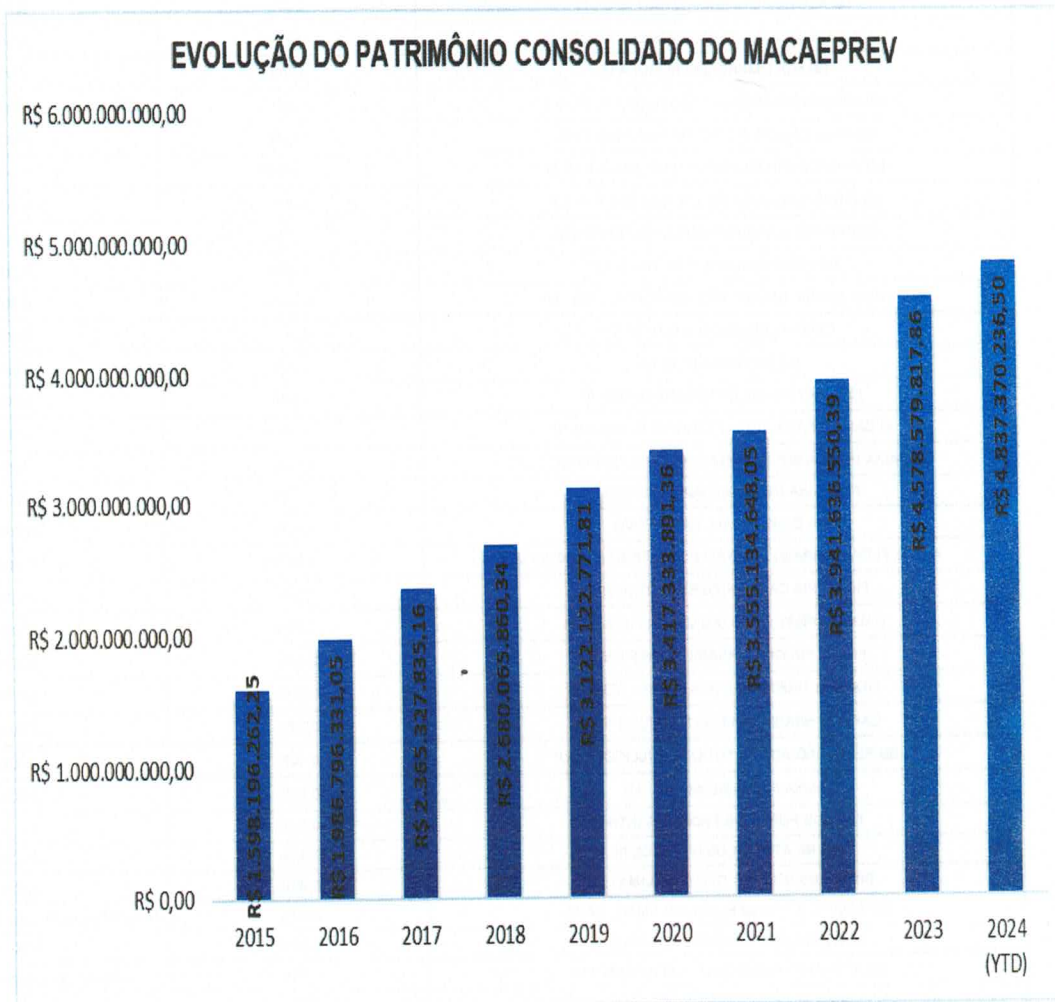
CUSTOS SELIC		
Ativos	Patrimônio (R\$)	SELIC
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	R\$ 2.085.663.873,89	R\$ 5.745,16

387

388

389 **CONCLUSÃO** - O Macaeprev encerrou o mês de junho de 2024 com o Patrimônio
390 Consolidado de R\$ 4.837.370.236,50 (quatro bilhões e oitocentos e trinta e sete milhões e
391 trezentos e setenta mil e duzentos e trinta e seis reais e cinquenta centavos). O gráfico a seguir
392 apresenta a evolução patrimonial do Macaeprev a cada final de exercício.

393



394

395

[Handwritten signatures and initials]

[Handwritten signatures and initials]



396 **II – APROVAÇÃO DO RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS JUNHO DE 2024:** Após a
397 apresentação do relatório, por unanimidade, os membros do Comitê de Investimentos
398 aprovaram o Relatórios de Investimentos referente ao mês de junho de 2024, o qual o termo
399 segue anexo a esta ata. **III – PRÓXIMA REUNIÃO:** Pelo membro e presidente da comissão
400 do cálculo atuarial, Patric, foi lembrado que amanhã, dia 25/07 as 17:00, teremos nossa
401 reunião presencial para apresentação dos resultados da reavaliação atuarial de 2024 – base
402 2023. **IV - ENCERRAMENTO:** Nada havendo mais a tratar, o membro *Patric* informou que
403 a reunião foi encerrada às dezoito horas e vinte e cinco minutos, tendo a ata sido lavrada por
404 mim, lida e assinada por todos os presentes.

405 COMITÊ DE INVESTIMENTOS:

406 
407 Alfredo Tanos Filho



Claudio de Freitas Duarte

408 
409 Erenildo Motta da Silva Júnior


Fábio de Carvalho de Moraes Drumond

411 
412 José Eduardo da Silva Guinâncio


Miriam Amaral Queiroz

413 
414 Patric Alves de Vasconcelos


Viviane da Silva Lourenço Campos



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e quatro dias do mês de julho 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 **junho** de 2024;

Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos o qual segue na íntegra na ata do dia de hoje: **24 de julho de 2024**.

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