



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



**REUNIÃO ORDINÁRIA – ATA DA 33ª REUNIÃO DO CONSELHO FISCAL POR CONVOCAÇÃO DOS MEMBROS DO CONSELHO FISCAL DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE MACAÉ (MACAEPREV) REALIZADA NO DIA 05/09/2024.**

**ATA nº 33/2024 DE 05/09/2024** - Ata de Reunião ordinária do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé, sendo aberta às 17:00 h, convocada por todos os membros, conforme Lei Complementar 119/2009 e art. 5º do Decreto 025/2012. Na presente reunião, reuniram-se na sede do Instituto de Previdência Social, na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, 293, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, inscrito no CNPJ sob o nº 03.567.964/0001-04, presentes os membros: **Hélida Marcia da Costa Mendonça Damasceno, Marcelo Puertas Tavares, Susan Cristina Venturini Ferraz e Ueliton Machado Pinto.** A presente reunião visa a análise e conferência do **PLANO DE CONTAS VALORES LANÇADOS NO CRÉDITO REFERENTE AO MÊS DE JUNHO DE 2024.** Iniciando os trabalhos. Pela conta no plano de contas nº 4.0.0.0.0.00.00.00.00 - **Varição Patrimonial Aumentativa**, verifica-se o valor lançado de R\$ 86.977.159,85. Pela conta no plano de contas nº 4.2.0.0.0.00.00.00.00 - **Contribuições**, verifica-se o valor lançado de R\$ 14.595.907,25. Pela conta no plano de contas nº 4.2.1.0.0.00.00.00.00 - **Contribuições Sociais**, verifica-se o valor lançado de R\$ 14.595.907,25. Pela conta no plano de contas nº 4.2.1.1.0.00.00.00.00 - **Contribuição Social - RPPS e Militares**, verifica-se o valor lançado de R\$ 14.595.907,25. Pela conta no plano de contas nº 4.2.1.1.1.00.00.00.00 - **Contribuição Social - RPPS e Militares Consolidação**, verifica-se o valor lançado de R\$ 7.268.988,81. Pela conta no plano de contas nº 4.2.1.1.1.02.00.00.00 - **Contribuição do Segurado ao - RPPS**, verifica-se o valor lançado de R\$ 7.268.988,81. Pela conta no plano de contas nº 4.2.1.1.1.02.01.00.00 - **Contribuição do Servidor – RPPS**, verifica-se o valor lançado de R\$ 6.963.220,22. Pela conta no plano de contas nº 4.2.1.1.1.02.02.00.00 - **Contribuição do Aposentado – RPPS**, verifica-se o valor lançado de R\$ 271.927,80. Pela conta no plano de contas nº 4.2.1.1.1.02.03.00.00 - **Contribuição de Pensionista - RPPS**, verifica-se o valor



**Pró-Gestão**  
RPPS

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

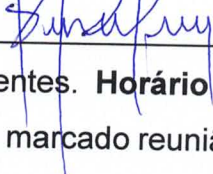


lançado de R\$ 33.840,79. Pela conta no plano de contas nº 4.2.1.1.2.00.00.00.00.00  
- **Contribuição Sociais - RPPS E MILITARES - INTRA- OFSS**, verifica-se o valor  
lançado de R\$ 7.326.918,44. Pela conta no plano de contas  
4.2.1.1.2.01.00.00.00.00 - **Contribuições Patronais ao - RPPS**, verifica-se o valor  
lançado de R\$ 7.326.918,44. Pela conta no plano de contas  
4.2.1.1.2.01.01.00.00.00 - **Contribuição Patronal de servidor ativo - RPPS**,  
verifica-se o valor lançado de R\$ 6.949.509,72. Pela conta no plano de contas nº  
4.2.1.1.2.01.99.00.00.00 - **Outras contribuições patronais ao - RPPS**, verifica-se  
o valor lançado de R\$ 377.408,72. Pela conta no plano de contas nº  
4.4.0.0.0.00.00.00.00.00 - **Variações Patrimoniais Aumentativas Financeiras**,  
verifica-se o valor lançado de R\$ 17.753.587,80. Pela conta no plano de contas nº  
4.4.5.0.0.00.00.00.00.00 - **Remuneração de depósitos bancários e aplicações**,  
verifica-se o valor lançado de R\$ 17.753.587,80. Pela conta no plano de contas nº  
4.4.5.1.0.00.00.00.00.00 - **Remuneração de depósito bancários**, verifica-se o valor  
lançado de R\$ 14.828,45. Pela conta no plano de contas nº 4.4.5.1.1.00.00.00.00.00  
- **Remuneração de depósitos bancários – consolidação**, verifica-se o valor  
lançado de R\$ 14.828,45. Pela conta no plano de contas nº 4.4.5.1.1.01.00.00.00.00  
- **Rendimentos de depósitos bancários**, verifica-se o valor lançado de R\$  
14.828,45. Pela conta no plano de contas nº 4.4.5.2.0.00.00.00.00.00 -  
**Remuneração de Aplicações Financeiras** - verifica-se o valor lançado de R\$  
14.828,45. Pela conta no plano de contas nº 4.4.5.2.1.00.00.00.00.00 -  
**Remuneração de Aplicações Financeiras - consolidada**, verifica-se o valor  
lançado de R\$ 17.738.759,35. Pela conta no plano de contas nº  
4.4.5.2.1.01.00.00.00.00 - **Remuneração de Aplicações Financeiras**, verifica-se o  
valor lançado de R\$ 17.738.759,35. Pela conta no plano de contas nº  
4.5.0.0.0.00.00.00.00.00 - **Transferência e delegações recebidas**, verifica-se o valor  
lançado de R\$ 3.004.448,21. Pela conta no plano de contas nº  
4.6.0.0.0.00.00.00.00.00 - **Valorização e ganhos com Ativos e desincorporação**,  
verifica-se o valor lançado de R\$ 51.554.739,67. Pela conta no plano de contas nº  
4.6.1.0.0.00.00.00.00.00 - **Reavaliação de Ativos**, verifica-se o valor lançado de R\$



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



51.554.739,67. Pela conta no plano de contas nº 4.9.9.1.0.00.00.00.00.00 – **Compensação financeira entre RCGPS-RPPS**, verifica-se o valor lançado de R\$ 63.664,18. Pela conta no plano de contas nº 4.9.9.1.3.00.00.00.00.00 – **Compensação financeira entre RCGPS-RPPS - INTER-OFSS**, verifica-se o valor lançado de R\$ 63.664,18. E assim concluímos os trabalhos deste conselho, ficando a presente, a disposição dos servidores ativos, inativos e pensionistas no Portal da Transparência da P.M.M., a fim de que tenham conhecimento acerca do Plano de Contas com seus lançamentos no período de 01/06/2024 a 30/06/2024, enviado a este Conselho Fiscal para análise, em 04/09/2024 às **13:26 h**. Damos por encerrada a presente reunião. Fechando assim a análise dos resultados dos documentos abordados em pauta. Nada mais havendo a tratar, esta ATA foi lavrada por mim, Susan Cristina Venturini Ferraz,  sendo lida, aprovada e assinada por todos os presentes. **Horário de Término: 18:40**, por decisão dos membros deste Conselho, fica marcada reunião **Extraordinária** para 12 de setembro 2024 às 17 h.

CONSELHO FISCAL		
HÉLIDA MARCIA DA COSTA M DAMASCENO	PRESIDENTE	
UELITON MACHADO PINTO	MEMBRO	
SUSAN C. V. FERRAZ	MEMBRO	
MARCELO P. TAVARES	MEMBRO	



Pró-Gestão  
RPPS

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



**REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA – ATA DA 34ª REUNIÃO POR CONVOCAÇÃO DOS MEMBROS DO CONSELHO FISCAL DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE MACAÉ (MACAEPREV) REALIZADA NO DIA 12/09/2024.**

**ATA nº 34/2024 DE 12/09/2024** - Ata de Reunião Extraordinária do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé, sendo aberta às 17:00 h, convocada por todos os membros, conforme Lei Complementar 119/2009 e art. 5º do Decreto 025/2012. Na presente reunião, reuniram-se na sede do Instituto de Previdência Social, na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, 293, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, inscrito no CNPJ sob o nº 03.567.964/0001-04, presentes os membros: **Hélida Marcia da Costa Mendonça Damasceno, Marcelo Puertas Tavares, Susan Cristina Venturini Ferraz e Ueliton Machado Pinto.** A presente reunião visa analisar e realizar a conferência entre o plano de contas e o saldo contido nos extratos bancários da competência de junho de 2024. **DA ANÁLISE DO PLANO DE CONTAS SALDO ATUAL REFERENTE AO MÊS DE JUNHO DE 2024.** Bancos, contas e movimentações - Iniciada a conferência: **PAGAMENTO INATIVOS E PENSIONISTAS DA CÂMARA MUNICIPAL**, pela conta 11395-3 - onde os valores de **R\$ 83.824,35**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **BANCO CONTA MOVIMENTO - FUNDO EM CAPITALIZAÇÃO - R\$ 35.903,13.** Pela conta BANCO ITAÚ – 13939-8 - onde os valores de **R\$ 14.997,69**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. Pela conta BRADESCO – AG 1545-8 c/c 59.698-1 - onde os valores de **R\$ 78,84**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. Pela conta BANCO DO BRASIL - 10.610-0 - onde os valores de **R\$ 20.826,60**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **BANCO CONTA MOVIMENTO – TAXA DE ADMINISTRAÇÃO** - onde os valores de **R\$ 4.135,76**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **C-C da taxa de ADMINISTRAÇÃO NO ITAÚ – 94774-1** - onde os valores de **R\$ 4.135,76**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **APLICAÇÕES FINANCEIRAS DE LIQUIDEZ IMEDIATA – RPPS** – onde os valores de **R\$ 244.131,71**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. Pela conta CAIXA FI BRASIL



**Pro-Gestão**  
RPPS

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



DISPONIBILIDADES RF (TAXA ADM) 71021-1 - onde os valores de **R\$ 1.464,66**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. Pela conta BB PREVD RF FLUXO (TAXA ADM) 59350-8 - onde os valores de **R\$ 242.667,05**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **APLICAÇÕES FINANCEIRAS DE LIQUIDEZ IMEDIATA – RPPS – F** - onde os valores de **R\$ 42.164,34**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. Pela conta BB PREVID RF fluxo – 10610-0 - onde os valores de **R\$ 42.061,84**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. Pela conta CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF – 740-5 - onde os valores de **R\$ 102,50**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **DEMAIS CRÉDITOS E VALORES A CURTO PRAZO** - onde os valores de **R\$ 14.774.342,94**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. **ADIANTAMENTOS CONCEDIDOS** - onde os valores de **R\$ 10.000,00**, estão devidamente lançados no plano de contas. **ADIANTAMENTOS DIVERSOS CONCEDIDOS CONSOLIDAÇÃO e SUPLEMENTOS DE FUNDOS** – onde os valores de **R\$ 10.000,00**, estão devidamente lançados no plano de contas. **CRÉDITOS PREVIDENCIÁRIOS A RECEBER A CURTO PRAZO** - onde os valores de **R\$ 14.764.342,94**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **CRÉDITOS PREVIDENCIÁRIOS A RECEBER A CURTO PRAZO** - onde os valores de **R\$ 77.767,21**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS A RECEBER** - onde os valores de **R\$ 77.767,21**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **CONTRIBUIÇÕES DO RPPS A RECEBER – SERVIDOR APOSENTADO** - onde os valores de **R\$ 77.767,21**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS A RECEBER** - onde os valores de **R\$ 13.802.705,11**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **CONTRIBUIÇÕES DO RPPS A RECEBER - PATRONAL FUNDOS** - onde os valores de **R\$ 6.952.326,61**, estão devidamente contabilizados, conforme extrato bancário. **CONTRIBUIÇÕES DO RPPS A RECEBER – SERVIDOR APOSENTADO FUNDOS** - onde os valores de **R\$ 6.850.378,50**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **CRÉDITOS PREVIDENCIÁRIOS PARCELADOS** - onde os valores



Pró-Gestão  
RPPS

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



de R\$ 883.870,62, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **INVESTIMENTOS E APLICAÇÕES TEMPORÁRIAS DE CURTO PRAZO** - onde os valores de R\$ 2.534.271.120,78, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. **APLICAÇÕES EM SEGMENTO DE RENDA FIXA - RPPS – FUNDO NO VALOR DE R\$ 1.354.640.348,84**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. Pelo **FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE APLICAM EXCLUSIVAMENTE NO VALOR DE R\$ 546.067.162,13**, estão devidamente contabilizados conforme extrato bancário. Pela conta CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP - 740-5 - onde os valores de R\$ 80.511.538,21, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVID RF IRFM1 (APORTES DEFICIT ATUARIAL) - 100616-9 - onde os valores de R\$ 1.896.178,04, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB Previdenciário RF IMA-B5 FIC LP - 100616 – 9 - onde os valores de R\$ 4.454.371,80, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta Caixa FI Brasil IRF-M 1 TP- 71024 – 6 - onde os valores de R\$ 1.944.007,11, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta Caixa Brasil IDKA IPCA 2 A TP RF LP - 71024 – 6 - onde os valores de R\$ 4.437.893,77, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta Caixa Gestão Estratégica FIC RF- 71024-6 - onde os valores de R\$ 4.336.616,58, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XXI – 10610-0 - onde os valores de R\$ 243.685.097,73, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta FI BR TÍTULOS PÚBLICOS -740-5 - onde os valores de R\$ 6.403.669,35, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB RF ref. DI TP FI - 10610-0 - onde os valores de R\$ 2.112.798,41, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA BRASIL IMAB 5± TP RF LP – 740-5 - onde os valores de R\$ 140.798.982,65, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVID RF Vértice 2024 – 051-5 -102518-X - onde os valores de R\$ 20.152.165,65, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVID RF TP Vértice 2024 051-5 -104955-0 - onde os valores de R\$ 35.333.842,83, estão devidamente contabilizados conforme o extrato



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



bancário. Pelo **FUNDOS DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA** - encontra-se o valor de **R\$ 806.431.572,24**, devidamente informados pelo Plano de Contas referente ao mês de junho de 2024, enviado a este conselho na data de 04-09-2024 às 10.35 hs. Pela conta CAIXA REFERENCIADO DI LP – 740-5 - onde os valores de **R\$ 117.561.893,32**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREV RF PERFIL – 10610-0 - onde os valores de **R\$ 418.779.757,80**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF – 100616-9 - onde os valores de **R\$ 4.503.652,48**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVID RF PERFIL – 102518-X APORTES 2022 – 102518-X - onde os valores de **R\$ 597.974,94**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB RF ATIVA PLUS – 10610-0 - onde os valores de **R\$ 224.052.911,32**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVID RF PERFIL – 107445-8 - onde os valores de **R\$ 40.935.382,38**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. **FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS** - FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA-SENIOR – 9999-9 - de **R\$ 2.141.614,47**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. **APLICAÇÕES EM SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL – RPPS – FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM AÇÕES** - onde os valores de **R\$ 516.368.597,03**, onde os valores estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO - 10610-0 - onde os valores de **R\$ 20.258.189,72**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO I – 10610-0 - onde os valores de **R\$ 30.074.637,39**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES RETORNO TOTAL – 10610-0 - onde os valores de **R\$ 46.665.967,16**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO – 740-5 - onde os valores de **R\$ 49.206.187,76**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA – 10610-0 - onde os valores de **R\$ 52.953.859,67**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela



Pro-Gestão  
RPPS

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



conta CAIXA FIC FIA AÇÕES MULTIGESTOR – 740-5 - onde os valores de **R\$ 50.714.323,73**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE – 740-5 - onde os valores de **R\$ 57.136.344,41**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES AGRO – 10610-0 - onde os valores de **R\$ 44.020.481,93**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI – 10610-0 - onde os valores de **R\$ 52.310.587,90**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC - 100616-9 - onde os valores de **R\$ 323.372,18**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO - 100616-9 onde os valores de **R\$ 439.098,73**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE - 71024-6 - onde os valores de **R\$ 500.397,01**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FIC FIA AÇÕES MULTIGESTOR - 71024-6 - onde os valores de **R\$ 378.313,99**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO -71024-6 - onde os valores de **R\$ 288.841,16**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FIC EXPERT CLARITAS VALOR AÇÕES 740-5 - onde os valores de **R\$ 4.510.382,70**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB ESPELHO AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME – 10610-0 – onde os valores de **R\$ 19.049.301,95**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB ESPELHO AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS FIC FIA – 10610-0 - onde os valores de **R\$ 18.788.876,02**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FIC FI AÇÕES EXPERT VINCI VALOR RPPS – 740-5 – onde os valores de **R\$ 23.873.969,53**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FIC AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS – 740-5 – onde os valores de **R\$ 44.875.464,09**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. **APLICAÇÕES DO RPPS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR** – encontra-se o valor de





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



R\$ 361.976.434,26, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. **FUNDO DE INVESTIMENTO – SUFIXO “INVESTIMENTO NO EXTERIOR”** - onde os valores de R\$ 166.345.819,69, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE – 10610-0 - onde os valores de R\$ 66.015.372,28, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB MULTIMERCADO NORDEA IE – 10610-0 - onde os valores de R\$ 53.529.463,64, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIROMENT IE -10610-0 - onde os valores de R\$ 25.323.574,41, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE – 10610-0 - onde os valores de R\$ 21.477.409,36, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. **FUNDOS DE INVESTIMENTO DA CLASSE “AÇÕES – BDR NÍVEL”** - onde os valores de R\$ 195.630.614,57, estão devidamente contabilizados. Pela conta CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I - 740-5 - onde os valores de R\$ 74.571.492,51, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I – 10610-0 - onde os valores de R\$ 48.230.991,74, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I – 10610-0 - onde os valores de R\$ 69.669.670,03, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I – 100616-9 - onde os valores de R\$ 1.530.797,89, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I – 71024-6 - onde os valores de R\$ 1.627.662,40, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. **APLICAÇÕES EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS MULTIMERCADO** - onde os valores de R\$ 59.301.486,96, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta Caixa FI INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP 740-5 - onde os valores de R\$ 56.961.370,67, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO – 71024-6 - onde os valores R\$ 718.909,71, estão devidamente



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

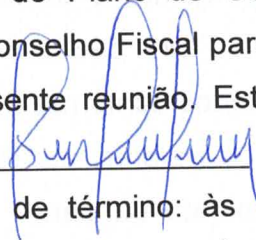


contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FI INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP - 71024-6 - onde os valores de **R\$ 887.457,02**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB Previdenciário FI Multimerado Alocação - 100616 -9 - onde os valores de **R\$ 733.749,56**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela **APLICAÇÕES COM A TAXA DE ADMINISTRAÇÃO DO RPPS** - onde os valores de **R\$ 241.984.253,69**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta do BB PREV RF IRF-M - 59350-8 - onde os valores de **R\$ 4.006.256,27**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela BB PREVID RF IRF-M - 67650-0 - onde os valores de **R\$ 12.874.372,17**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVID RF IRF-M 1-59350-8 - onde os valores de **R\$ 2.923.299,22**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF- 71021-1 - onde os valores de **R\$ 225.575,98**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB Previd RF IRF-M1 - 67650-0 - onde os valores de **R\$ 66.778.960,69**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB Previd RF IMAB5 - 67650-0 - onde os valores de **R\$ 19.196.706,21**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVID RF IDKA2 - 67650-0 - onde os valores de **R\$ 25.066.564,91**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP 71021-1 - onde os valores de **R\$ 29.128.721,16**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL - 59350-8 - onde os valores de **R\$ 14.745.950,50**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta BB PREVIDENCIÁRIO ALOCAÇÃO RETORNO TOTAL FIC RF - 67650-0 - onde os valores de **R\$ 67.037.846,58**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta 939206-9 Selic - Custódia de Títulos PÚBLICOS Federais - BB -10610-0 - onde os valores de **R\$ 2.085.663.873,89**, estão devidamente contabilizados conforme o extrato bancário. Pela conta CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF - 740-5 - onde os valores de **R\$ 217.148.956,06**, estão devidamente contabilizados




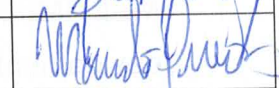


Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Comitê de Investimentos



conforme o extrato bancário. Fica deliberado ainda, para que se faça constar em ATA, o convite do MACAEPREV para a audiência pública, para a apresentação do Relatório de Governança Corporativa de 2022, a ser realizada em 16 de setembro, às 15:00 h, de modo online, através do youtube. Assim concluímos os trabalhos deste conselho, ficando a presente, a disposição dos servidores ativos, inativos e pensionistas no Portal da Transparência da P.M.M., a fim de que tenham conhecimento acerca do balancete mensal e Análise do Plano de Contas no período de 01/06/2024 a 30/06/2024, enviado a este Conselho Fiscal para análise em 04/09/2024 às 10:35 h. Damos por encerrada a presente reunião. Está ATA foi lavrada por mim, **Susan Cristina Venturini Ferraz**,  sendo lida, aprovada e assinada por todos os presentes. Horário de término: às 19:50 h. Fica marcado para o dia 19/09/2024 a próxima reunião **EXTRAORDINÁRIA** deste Conselho Fiscal, às 17:00hs, na sede deste Instituto. Nada mais havendo para o momento, foi encerrada a reunião.

**CONSELHO FISCAL**

<b>HÉLIDA MARCIA DA COSTA M DAMASCENO</b>	<b>PRESIDENTE</b>	
<b>UELITON MACHADO PINTO</b>	<b>MEMBRO</b>	
<b>SUSAN C. V. FERRAZ</b>	<b>MEMBRO</b>	
<b>MARCELO P. TAVARES</b>	<b>MEMBRO</b>	



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



**REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA – ATA DA 35ª REUNIÃO POR CONVOCAÇÃO DOS MEMBROS DO CONSELHO FISCAL DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE MACAÉ (MACAEPREV) REALIZADA NO DIA 19/09/2024.**

**ATA nº 35/2024 DE 19/09/2024** - Ata de Reunião Extraordinária do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé, sendo aberta às 17:00 h, convocada por todos os membros, conforme Lei Complementar 119/2009 e art. 5º do Decreto 025/2012. Na presente reunião, reuniram-se na sede do Instituto de Previdência Social, na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, 293, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, inscrito no CNPJ sob o nº 03.567.964/0001-04, presentes os membros: **Hélida Marcia da Costa Mendonça Damasceno, Marcelo Puertas Tavares, Susan Cristina Venturini Ferraz e Ueliton Machado Pinto.** A presente reunião visa: **ANALISAR O RELATÓRIO DO INVESTIMENTO – MAIO DE 2024- PRÓ-GESTÃO:** Os membros deste conselho fiscal receberam do sr. Erenildo Motta da Silva Júnior, Gestor de Investimentos do Macaeprev, o Relatório de Investimentos referente ao mês de **MAIO DE 2024**. A presidente deste Conselho, esclareceu que o envio deste relatório, visa cumprir uma exigência atual para certificação no Pró-Gestão, item G6, Elaboração de Relatórios Mensais, uma vez que a Secretaria de Previdência - SPREV do Ministério da Fazenda – MF por força da Lei nº 13.341/2016, editou a Portaria MPS nº 185/2015, que instituiu o Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios - Pró-Gestão RPPS. Inicialmente, destacamos trechos do **RELATÓRIO DO INVESTIMENTO – MAIO DE 2024:** No mês de maio, após as dificuldades enfrentadas no mês abril, tivemos recuperação das carteiras de investimentos. Os investimentos no exterior apresentaram bons resultados. No front geopolítico, a tensão no oriente médio diminuiu em maio, tendo em vista o aumento da tensão entre o Irã e Israel no mês de abril, com a investida iraniana em retaliação ao ataque israelense ao consulado iraniano na Síria. Além da guerra da Ucrânia completar 28 meses sem perspectiva de avanço nas negociações diplomáticas. Nos EUA, o mês



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



de maio, trouxe leituras mistas para o cenário de crescimento, com vendas no varejo e o dado agregado do consumo (PCE) mais fracos do que o esperado o mês de abril. Mas um Índice de Gerentes de Compras (PMI) sugerindo uma retomada do crescimento em maio. O PMI Composto de produção dos EUA, que acompanha os setores de manufatura e de serviços, caiu de 52,1 em março para 50,9 em abril. Ou seja, um componente mostrando quase uma contração, mas ainda dos 50, indicando uma expansão no setor privado. O consumo agregado recuou -0,05% m/m em abril, sendo abaixo das expectativas (0,1% m/m) sendo um trimestre com demanda mais tímida. Com os resultados, o consumo americano apresenta um carregamento de 1,3% t/t anualizado para o 2T24, abaixo dos 1,99% verificados no 1T24. Apesar da desaceleração, não significa que a economia norte americana está fraca. A primeira leitura do Produto Interno Bruto (PIB) no primeiro trimestre mostrou um crescimento de 1,6%, com expectativa de 2,9%. A inflação medida pelo índice CPI em abril cresceu de 0,3% (M/M) ante 0,4% (M/M) em março. Com o dado o índice acumulado em 12 meses reduziu de 3,5% para 3,4% (A/A). Já a inflação medida pelo PCE de abril apresentou um crescimento de 0,3%(M/M) pelo 3º mês consecutivo, com estabilidade da inflação anualizada em 2,7%. No mês de abril, o payroll registrou um aumento de 175 mil empregos, abaixo da expectativa do mercado (+238 mil), refletindo uma desaceleração do setor de serviços, além da forte desaceleração das contratações pelo governo. O *Federal Open Market Committee* (FOMC) decidiu novamente por manter os juros básicos estáveis no intervalo de 5,25% a 5,5% ao ano, em consenso do mercado. A ata do FOMC revela que o comitê se posicionava com preocupação ante as surpresas inflacionárias no 1T24. A sequência de dados divulgados desde a reunião de maio mostrou um cenário mais favorável ao mandato do Federal Reserve (Fed), com acomodação do mercado de trabalho e uma inflação mais benigna em abril. Nesse sentido, a comunicação recente revela um FOMC "cautelosamente otimista" (como citado pelo vice-chair Jefferson), entendendo que o progresso na desinflação pode ter voltado, embora a maioria dos membros ainda precise ver mais dados nessa direção e uma desinflação mensal adicional para construir a confiança necessária para uma redução da taxa de juros. O risco de uma retomada do ciclo de alta de juros ficou



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

**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**


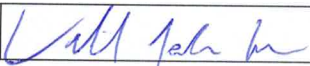
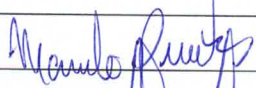
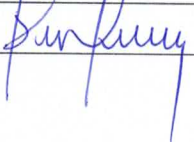
**MAIO DE 2024**

**TERMO DE APROVAÇÃO CONSELHO FISCAL**

Ao dia **19/09/2024**, nas dependências do Instituto de Previdência Social de Macaé – MACAEPREV, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, 293, Centro, Macaé/RJ, o Conselho Fiscal reuniu-se para análise dos investimentos, acompanhamento da rentabilidade, dos riscos das diversas modalidades de operações realizados na aplicação dos recursos do RPPS, da aderência das alocações, processos decisórios de investimentos e políticas de investimentos referentes à **MAIO DE 2024**. Considerando todas as informações constantes no presente relatório, **APROVAMOS** o relatório de investimentos referente à **MAIO DE 2024**.

*Macaé, 19 de setembro de 2024.*

**CONSELHO FISCAL**

<b>HELIDA MARCIA DA COSTA MENDONÇA DAMASCENO</b>	<b>PRESIDENTE</b>	
<b>UELITON MACHADO PINTO</b>	<b>MEMBRO</b>	
<b>MARCELO PUERTAS TAVARES</b>	<b>MEMBRO</b>	
<b>SUSAN CRISTINA VENTURINE FERRAZ</b>	<b>MEMBRO</b>	



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



para trás e os membros do comitê entendem que a política está restritiva, ainda que demorando mais do que o esperado para direcionar a inflação novamente para a meta. Na China, por sua vez, o *People's Bank of China* (PBoC) informou que manteve estáveis as suas taxas de empréstimo (*Loan Prime Rate - LPR*), com a taxa de um ano em 3,45% e a de 5 anos em 3,95%, conforme amplamente esperado pelo mercado. A economia chinesa continua mostrando uma trajetória mista de crescimento no curto prazo. A produção industrial avançou 6,7% a/a em abril, acima do consenso (5,5% a/a), mais uma vez puxada pelos setores automotivo e de eletrônicos. Por outro lado, os setores industriais ligados ao setor imobiliário, como produção de aço e cimento, mostraram forte recuo no mês (-7,2% e -8,6% a/a, respectivamente). Por sua vez, as vendas no varejo cresceram apenas 2,3% a/a, abaixo do esperado (3,7%) e bem abaixo da meta estabelecida para a economia como um todo, mostrando que a demanda doméstica deve contribuir menos para os objetivos do governo para o ano. Quanto ao setor imobiliário, os investimentos no segmento recuaram 9,8% a/a, um pouco pior que a queda de 9,6% esperada, refletindo as persistentes dificuldades do setor. Na sequência da comunicação do Politburo no final de abril, o mês de maio voltou a revelar políticas de suporte ao setor imobiliário. O país eliminou a taxa mínima de hipoteca, reduziu os pagamentos iniciais e instruiu os governos locais a comprarem o estoque de casas. Para tanto, o novo programa conta com 21 bancos elegíveis para participar do programa de realocação e emprestar a empresas estatais locais selecionadas por governos regionais. Para cada empréstimo que os bancos estenderem ao projeto, o PBOC fornecerá o equivalente a 60% do principal do empréstimo, atingindo US\$ 41,5 bilhões. Os fundos de realocação têm um prazo de um ano, a uma taxa de 1,75%, mas permitem quatro renovações. Por outro lado, as LGFVs, empresas estatais locais envolvidas com elevada dívida, serão impedidas de comprar imóveis. Os imóveis adquiridos devem ser usados para habitação pública, seja para venda ou aluguel. Algumas cidades já anunciaram medidas, com destaque para Xangai e Shenzhen. Por fim, a China segue enfrentando um ambiente comercial adverso. Os EUA anunciaram a elevação de tarifas para diversos itens chineses, incluindo veículos elétricos, baterias, células solares, chips, guindastes de cais, e



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



certos tipos de aço, alumínio, minerais críticos e suprimentos médicos. O aumento tarifário é significativo, variando de 25% a 100%, enquanto o valor total das importações dos produtos visados é de cerca de USD 18 bilhões, o que não é um volume relevante para a economia chinesa, mas fecha um potencial mercado. O grande desafio é a mensagem que isso passa para outros parceiros comerciais que já estão desconfortáveis com as exportações baratas vindas da China, como Europa, Japão e Austrália. Na Zona do Euro, a inflação medida pelo do CPI de abril acelerou para 2,6% (A/A), acima das expectativas de mercado. Olhando para os principais grupos, destaque para alta da inflação de serviços 4,1% (A/A). A Páscoa antecipada acabou afetando o setor de serviços relacionados com o turismo em março (viés de alta) e abril (viés de baixa), mas a surpresa altista do segmento mostra que a dinâmica da inflação dos serviços permanece mais persistente do que se pensava anteriormente. A inflação de alimentos marcou uma redução de 2,6% ante 2,8% (A/A). A preliminar do CPI cresceu 0,6% em abril e manteve o patamar de 2,4% em 12 meses. A leitura preliminar do PMI Composto da Zona do Euro (52,3 pontos) surpreendeu positivamente em sete dos últimos nove meses, com o resultado de maio voltando a suportar a análise de continuidade da recuperação da economia ao longo do 2T24. O resultado foi impulsionado pelo aumento na produção manufatureira (47,4 pontos), apesar da desaceleração na França, com Alemanha e a periferia do bloco como os principais responsáveis por essa melhora. Já o setor de serviços (53,3 pontos) segue como o principal motor de crescimento do bloco neste ano, além de mostrar uma desaceleração de preços que sugere uma desinflação à frente da inflação do setor, sendo um vento favorável ao Banco Central Europeu (BCE). O Comitê de Política Monetária (MPC) do BoE (*Bank of England*, sigla em inglês) manteve sua taxa básica de juros em 5,25% a.a., sendo esse o maior nível de juros desde 2008. Nessa reunião, dos seus nove membros, sete votaram pela manutenção e dois foram favoráveis a um corte de 0,25 p.p. Desde a sua última reunião, o MPC avalia que as trajetórias implícitas para as taxas de juros, utilizadas nas suas projeções de inflação, se elevaram e passaram de 3,25% para 3,75% ao final do horizonte de análise. A ata da última reunião do BCE, na qual a taxa de depósitos foi mantida em 4,00% a.a., seguiu





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



trazendo uma avaliação favorável para o cenário prospectivo de inflação, indicando que está caminhando em direção a 2,0%, possivelmente no ritmo esperado. Segundo o documento, os níveis atuais das taxas de juros diretas estavam contribuindo substancialmente para o processo contínuo de desinflação. Os membros do *Governing Council* do BCE já formaram um consenso sobre a probabilidade de um corte na taxa de juros na reunião do início de junho. No entanto, há divergências significativas quanto às ações futuras além de junho. Enquanto alguns membros veem o corte como o início de uma fase de redução de taxas, inclusive já vocalizando a possibilidade de outro ajuste em julho, a maior parte dos membros ainda enfatiza a necessidade de cautela e não se compromete com uma trajetória específica para os próximos meses, destacando a importância de manter uma postura flexível e adaptável às condições econômicas. No Brasil, a confiança teve predomínio negativo, interrompendo a sequência de predomínio positivo visto desde março de 2024. Entre os setores, destaque para a piora da confiança do consumidor (-4,3% M/M) e do comércio (-4,2% M/M). O índice de incerteza da economia de maio também indicou deterioração do cenário, ao subir 6,0% (M/M). Em relação aos dados da atividade econômica, houve melhora, com destaque para o emprego formal, indicando continuidade da robustez do mercado de trabalho. Nesse sentido, vale destacar a geração líquida de vagas formais (CAGED) de abril (240.033), impulsionado, mais uma vez, pelo setor de serviços (138.309). O Índice de Atividade Econômica do Banco Central (IBC-Br) recuou -0,3% (M/M), após, praticamente, uma sequência de seis meses de números não negativos. Entre os vetores, destaque para a deterioração do varejo ampliado e os efeitos defasados da política monetária contracionista. Por outro lado, a arrecadação federal manteve o ritmo forte dos últimos meses, atingindo o total de R\$ 228,9 bilhões em abril. Esse valor representa um avanço de 8,3% em relação ao mesmo período de 2023. Os principais fatores para esse desempenho foram o retorno da tributação sobre o PIS/Cofins nos combustíveis e a tributação dos fundos exclusivos. Apesar do aumento na arrecadação nos últimos meses, não será suficiente para que o país alcance um déficit primário de 0% em 2024. Em relação ao campo monetário, o Banco Central do Brasil (BCB) deliberou, em votação dividida, pelo corte de 0,25 pp, levando a taxa



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



básica de juro (Selic) de 10,75% para 10,50% aa. A votação dividida, com um placar de 5 a 4, evidenciou um racha dentro do próprio Banco Central. Os cinco membros indicados pelo governo anterior votaram a favor de uma redução em um ritmo mais moderado, enquanto os membros indicados pelo governo atual defenderam a manutenção do ritmo de corte de juros. Essa decisão trouxe incertezas para o mercado, pois sugere que, a partir do próximo ano, com a maioria dos membros indicada pelo governo atual, as decisões de política monetária podem ser influenciadas pelos interesses políticos, em detrimento de critérios técnicos. No geral, no comunicado pós Copom, foi observado um tom bastante duro (*hawkish*), com a autoridade monetária citando o cenário externo adverso, incerteza elevada sobre o início de flexibilização monetária americana e mercado de trabalho robusto no mundo e no Brasil. As projeções de inflação no cenário de referência foram revisadas de 3,5% para 3,8% em 2024 e de 3,2% para 3,3% em 2025. O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) que avançou +0,46% (M/M) em maio, acelerando em relação ao avanço de +0,38% (M/M) observado no mês anterior. A variação foi em linha com a projeção de mercado. Com isso, o índice acumulou alta de +3,93% em 12 meses (ante +3,69% em abril). A maior contribuição para a variação do índice contudo, partiu do grupo Alimentação e bebidas influenciado pelo aumento dos itens de Alimentação no domicílio com destaque para Tubérculos, raízes e legumes. Os preços administrados avançaram +0,55% em maio ante +0,74% de abril, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Taxa de água e esgoto (+1,62% ante +0,09% na leitura anterior). Já os preços livres aceleraram (+0,42%) ainda se mantendo como os principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres, produtos industriais e serviços aceleraram de +0,21% para +0,29% e de +0,05% para +0,4% respectivamente. Por outro lado, alimentos desaceleraram de +0,81% para +0,66%. A média dos núcleos acelerou, tanto na comparação mensal (+0,39%), quanto quando observada a variação acumulada em 12 meses (+3,56%). Na margem, tivemos aceleração tanto da medida subjacente de industriais (+0,29%), quanto do núcleo de serviços (+0,41%). O índice de difusão passou de 57,03% em abril para 57,29% em

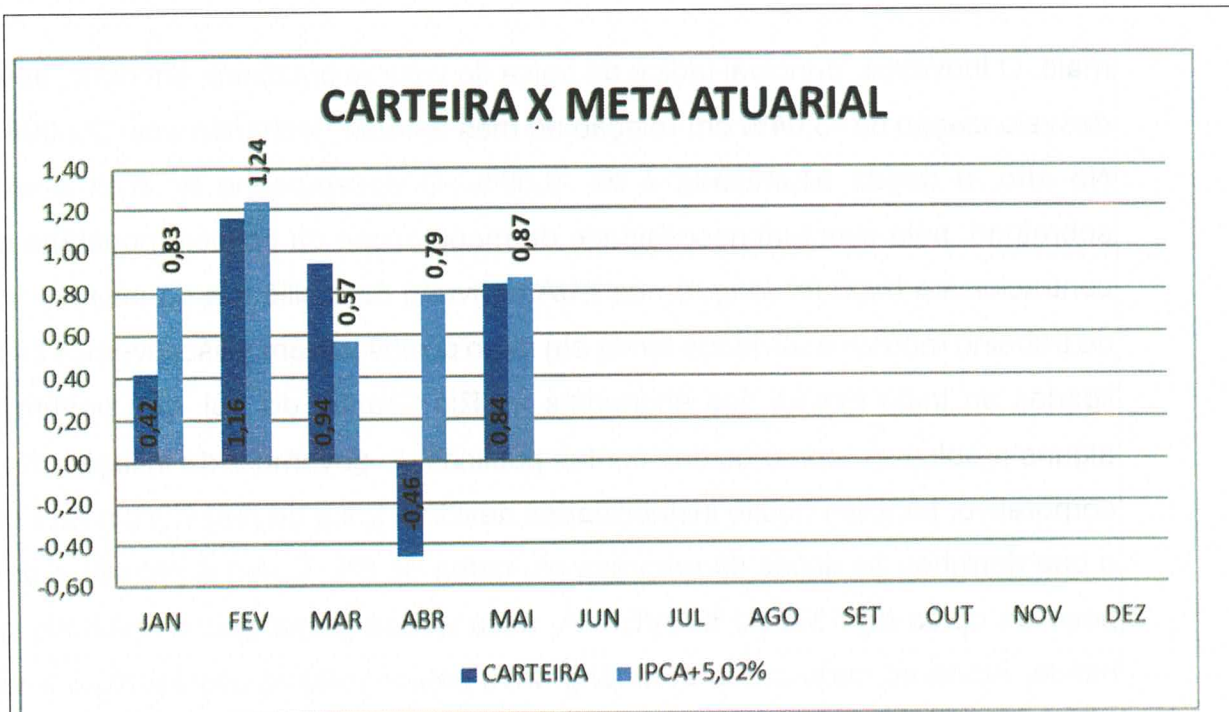


maio. O Ibovespa, principal índice da bolsa de valores brasileira, em maio, apresentou desvalorização de -3,04% em relação ao mês anterior, fechando aos 122.098 pontos. No ano, a queda acumulada é de -9,00%. O desempenho do mês é explicado, sobretudo, pela eventual necessidade de manutenção da política monetária em nível contracionista (*high for longer*) nos EUA derivado da resiliência da inflação, mercado de trabalho robusto e atividade ainda em ritmo positivo. Além disso, tivemos as tensões ligadas ao triste evento das enchentes no Rio Grande do Sul, que podem agravar alguns problemas, como os das contas públicas do governo e de inflação. No âmbito corporativo, também houve instabilidades devido à troca de presidência na Petrobras, o que derrubou as ações da empresa em cerca de 8%. Como a Petrobras detém um peso de cerca de 13% no IBOVESPA, essa queda prejudicou o resultado geral do índice. Ainda no curto prazo o cenário deve seguir volátil e desfavorável à alocação em *equities* até que se tenha uma maior certeza acerca do início de cortes de juros pelo Fed. A política monetária norte-americana segue tendo grande influência no desempenho da bolsa brasileira e tem se mostrado o principal fator que dita o apetite a risco de emergentes. Espera-se que o fluxo estrangeiro para o Brasil aumente a partir de uma maior definição do início de cortes pelo FOMC. Internamente, é esperado que o fluxo doméstico aumente a partir de uma Selic mais próxima a um dígito, expectativa que foi prorrogada para o segundo semestre de 2025.

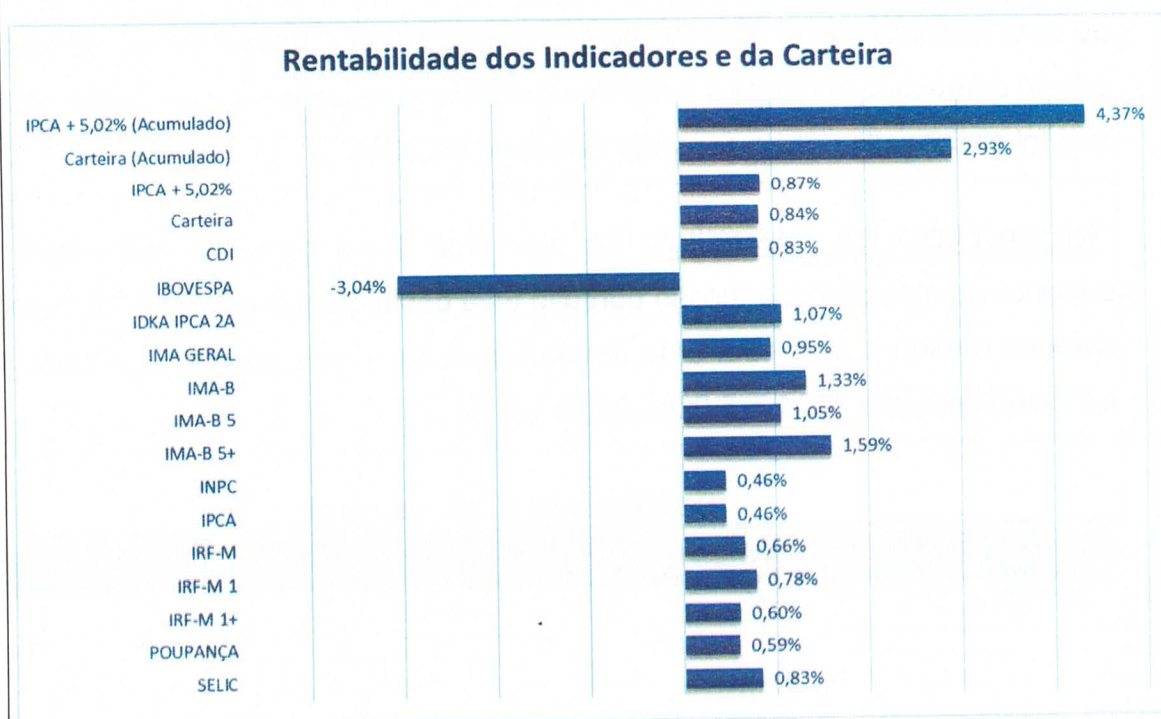
**'RESULTADO DA CARTEIRA:** Os membros deste conselho verificaram que no decorrer do mês de maio, nosso portfólio teve desempenho inferior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com uma rentabilidade de 0,84%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 5,02%, foi de 0,87%.

#### 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



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





Pró-Gestão  
RPPS

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



Analisando o relatório, a conselheira Hélida ressalta que em maio, foi observado um comportamento positivo em nossos fundos de investimento. Os investimentos no exterior foram os que mais contribuíram para nossa carteira. Dessa forma, as maiores altas na carteira foram do Caixa Institucional BDR Nível I com 6,78% e BB Ações Globais Institucional BDR Nível I com 6,26%. Na contramão do cenário global, a bolsa brasileira continua sofrendo com os entraves internos. Alguns dados relacionados à nossa estabilidade fiscal afetaram o humor dos mercados. Com isso, as forças vendedoras, devido ao contexto macroeconômico, acabaram pressionando a cotação das nossas empresas. Apesar das quedas no mês, boas empresas continuam muito baratas visto os múltiplos contraídos. Dessa forma, entendemos que a taxa de retorno esperada em um prazo maior é bem interessante. Na renda variável, por vezes, os retornos podem se materializar rapidamente, como ocorreu no final de 2023, quando o Ibovespa subiu 18,6% nos últimos dois meses do ano. Daí a importância de mantermos nossa posição, justamente pela dificuldade de prever quando e com que intensidade essa recuperação pode ocorrer. Por isso, reforçamos a importância de permanecermos fiéis à alocação estratégica elaborada na Política Anual de Investimentos (PAI). Isso nos manterá resilientes durante a jornada e nos ajudará a alcançar melhores retornos a longo prazo. Em média, os fundos de ações brasileiras apresentaram rentabilidade de -2,85%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno médio de 5,05%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno de 5,84%. Os fundos de investimento no exterior tiveram resultado médio de 2,73%. Os fundos de vértice FI Caixa Brasil 2024 e BB Previdenciário RF TP XXI renderam 0,89%. As NTN-B 2024 renderam 0,95%, as NTN-B 2025 renderam 0,91%, as NTN-B 2026 renderam 0,90%, as NTN-B 2027 renderam 0,92%, as NTN-B 2028 renderam 0,90%, as NTN-B 2040 renderam 0,88%, as NTN-B 2045 renderam 0,83%, as NTN-B 2050 renderam 0,89%, as NTN-B 2055 renderam 0,90% e as NTN-B 2060 renderam 0,89%. Em média, as NTN-B ficaram com 0,90%. Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,72%. O fundo de renda fixa com gestão ativa rendeu 0,88%. O fundo IMA-B 5 teve um retorno de 1,03%. Os fundos IMA-B 5+ tiveram retorno de



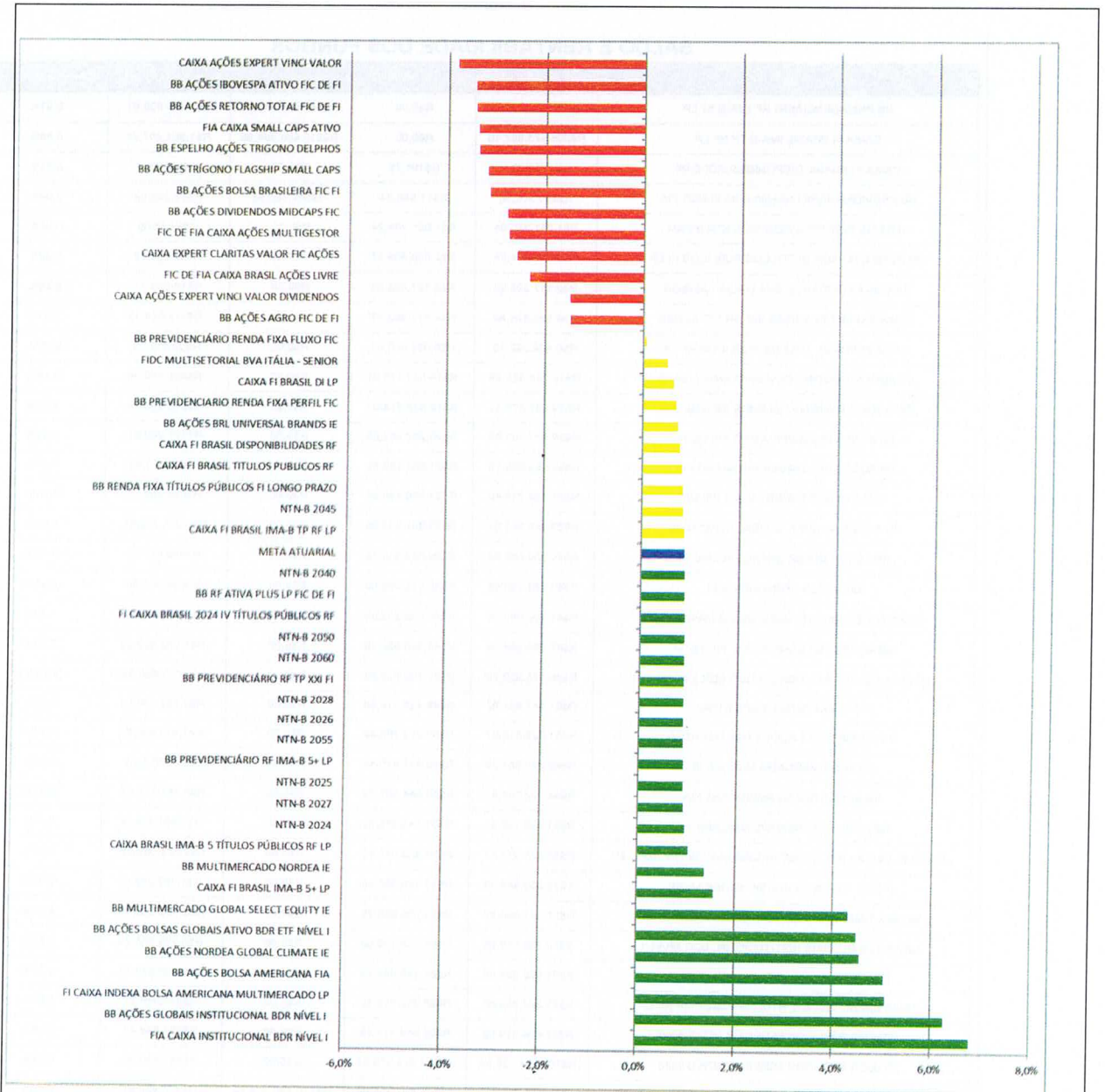
Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Comitê de Investimentos



1,24%. O fundo que acompanha o IMA-B teve retorno de 0,86%. O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade positiva de 0,48%. Até 31/05/2024 foram resgatados o total de R\$ 10.132.155,67 (dez milhões e cento e trinta e dois mil e cento e cinquenta e cinco reais e sessenta e sete centavos), mais de 100% do capital total investido. O saldo em 31 de maio estava em R\$ 2.127.494,56 (dois milhões e cento e vinte e sete mil e quatrocentos e noventa e quatro reais e cinquenta e seis centavos). O gráfico a seguir mostra a comparação entre a rentabilidade dos fundos e a Meta Atuarial. Os fundos em verde bateram a Meta Atuarial, os fundos em amarelo apresentaram resultado positivo, porém, abaixo da Meta Atuarial e os fundos em vermelho tiveram resultado negativo.



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



**DO RENDIMENTO DA CARTEIRA:** O rendimento de maio da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 40.548.607,83 (quarenta milhões e quinhentos e quarenta e oito mil e seiscentos e sete reais e oitenta e três centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de maio em R\$ 4.407.767.360,90 (quatro bilhões e quatrocentos e sete milhões e setecentos e sessenta e sete mil e trezentos e sessenta reais e noventa centavos).



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



**SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS**

Fundo de Investimento	Saldo em 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\$48.502.761,62	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\$214.660.220,37	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\$4.364.402.644,08</b>	<b>R\$4.407.767.360,90</b>	<b>R\$37.841.964,89</b>	<b>R\$40.548.607,83</b>	<b>0,84%</b>





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



**DA DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA CARTEIRA:**

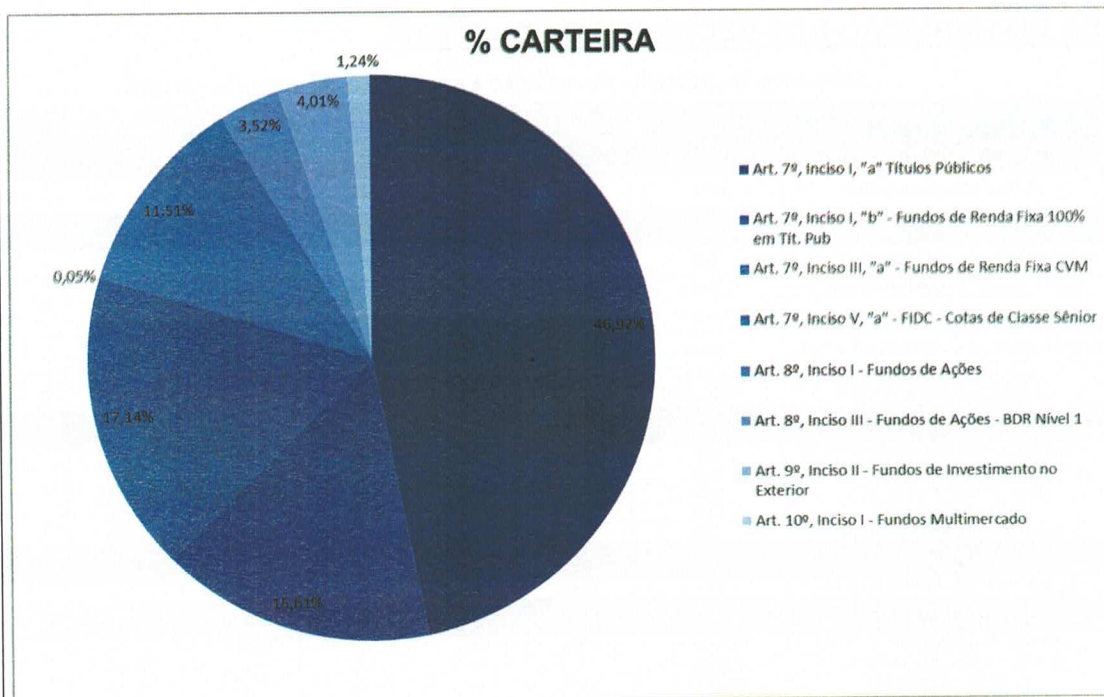
**ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024**

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>		46,92%	100,00%	50,00%	100,00%	Não se Aplica	<b>R\$2.067.925.114,54</b>
<b>TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS</b>	IPCA+	46,92%	100,00%	50,00%	100,00%	N/A	<b>R\$2.067.925.114,54</b>
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub</b>		15,61%	100,00%	50,00%	100,00%	100,00%	<b>R\$688.250.455,09</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>		17,14%	65,00%	65,00%	20,00%	15,00%	<b>R\$755.572.973,00</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>		0,05%	5,00%	0,20%	20,00%	5,00%	<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>		11,51%	35,00%	25,00%	20,00%	15,00%	<b>R\$607.190.805,33</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 1</b>		4,01%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	<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>		3,52%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	<b>R\$155.060.639,74</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>		1,24%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	<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>



Pró-Gestão  
RPPS

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

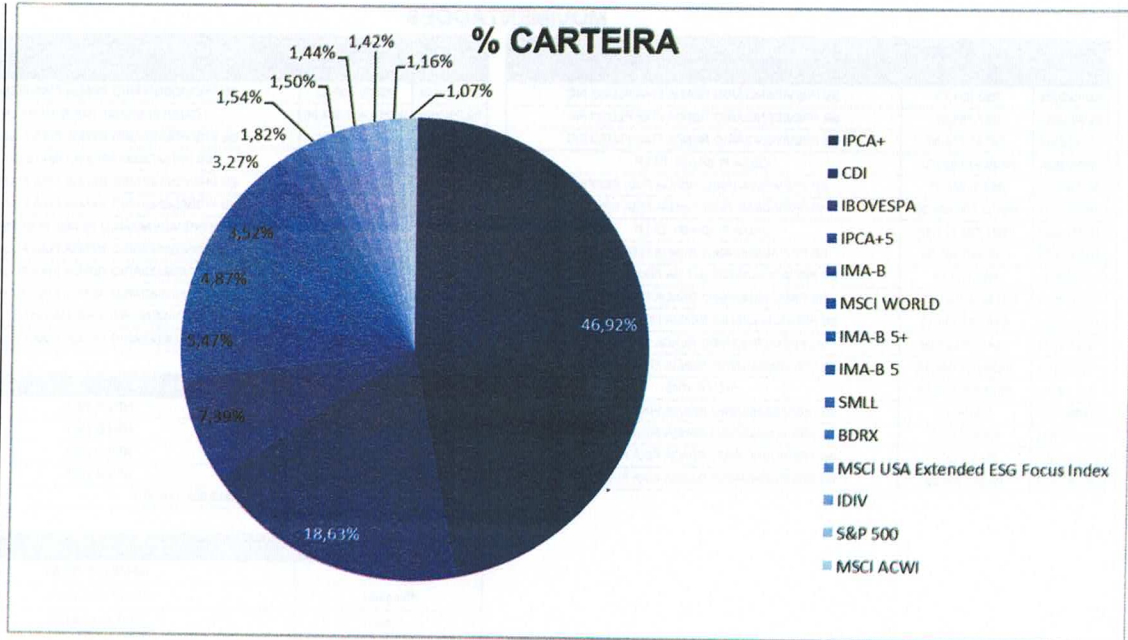


**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

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>

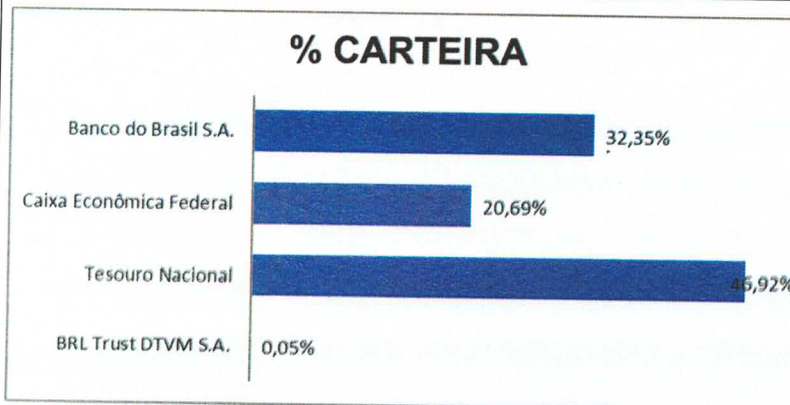


Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Comitê de Investimentos



**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%



**DO ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES:**

*[Handwritten signatures and initials in blue ink]*

**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	
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

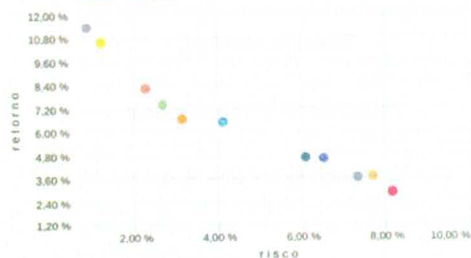
**DO MONITORAMENTO DE RISCOS:**

**art. 7º, inciso i, "A" – TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOURO NACIONAL**

Gráficos



Risco x Retorno - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



- PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1
- NTN-B 780199 20240815
- NTN-B 780199 20250515
- NTN-B 780199 20260815
- NTN-B 780199 20270515
- NTN-B 780199 20280815
- NTN-B 780199 20400815
- NTN-B 780199 20450515
- NTN-B 780199 20500815
- NTN-B 780199 20550515
- NTN-B 780199 20600815

**art. 7º, inciso I, "B" – fundos de renda fixa 100% em TP**



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

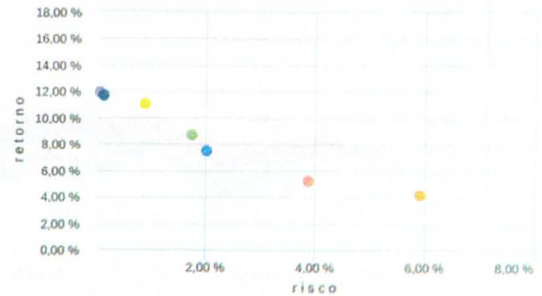


Gráficos

Retorno Acumulado - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



Risco x Retorno - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)

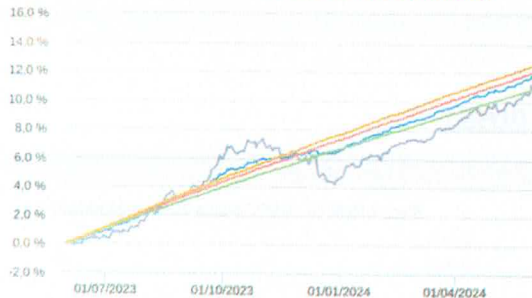


- PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1
- BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
- BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
- CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

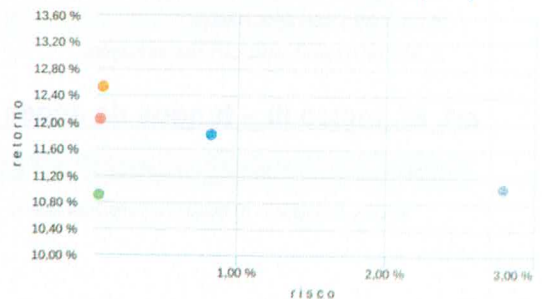
**art. 7º, inciso lii, "A" – fundos de renda fixa cvm**

Gráficos

Retorno Acumulado - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



Risco x Retorno - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



- 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

**art. 8º, inciso I – fundos de fundos de ações**



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

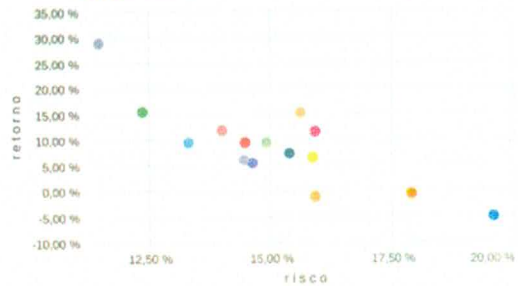


Gráficos

Retorno Acumulado - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



Risco x Retorno - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



- 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 TRIGONO 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
- TRIGONO FLAGSHIP SMALL CAPS MASTER FI AÇÕES

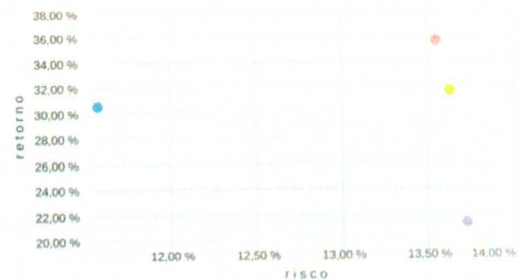
**art. 8º, inciso III – fundos de ações – bdr nível i**

Gráficos

Retorno Acumulado - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



Risco x Retorno - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



- PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1
- BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I
- BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I
- CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I

**art. 9º, inciso II – fundos de INVESTIMENTO NO EXTERIOR**



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

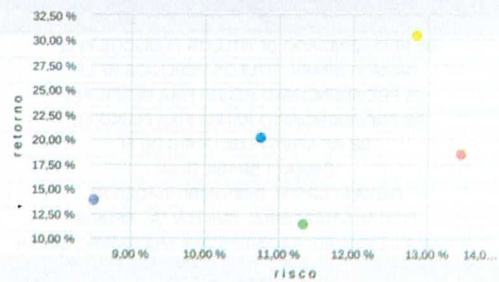


Gráficos

Retorno Acumulado - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



Risco x Retorno - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



- PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1
- BB BRL UNIVERSAL BRANDS PRIVATE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES
- BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO
- BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES
- BB NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO

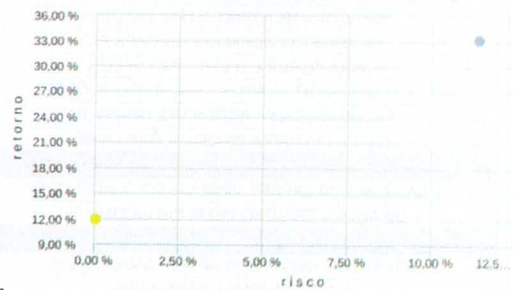
**art. 10º, inciso I – fundos multimercado**

Gráficos

Retorno Acumulado - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



Risco x Retorno - 01/06/2023 a 31/05/2024 (diária)



- PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1
- CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP
- CDI

**DA ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS E VALUE AT RISK (VAR):**

*[Handwritten signatures and initials in blue ink]*



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



### 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%	2,67%	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%	6,58%	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%	4,66%	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 TRÍGONO 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 TRÍGONO 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%

#### DOS RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO:

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





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



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

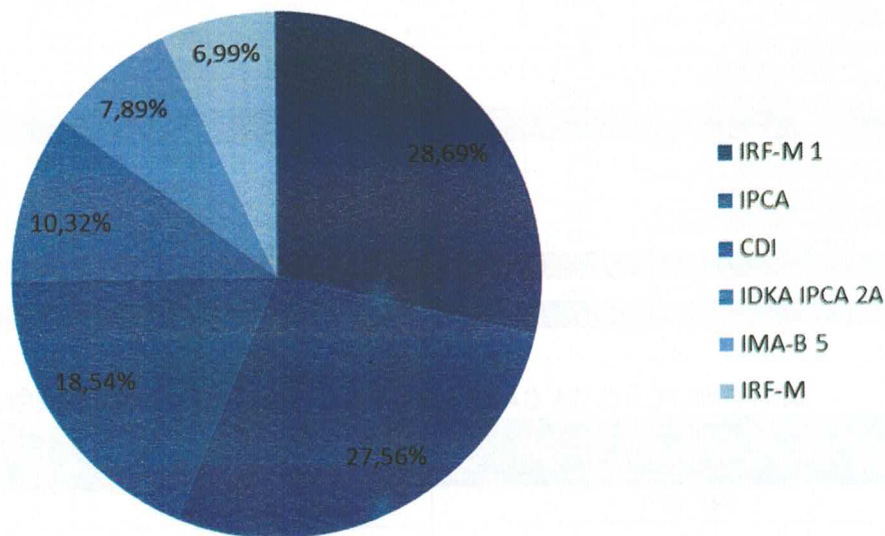
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub</b>		<b>53,89%</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$130.568.903,24</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>

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>



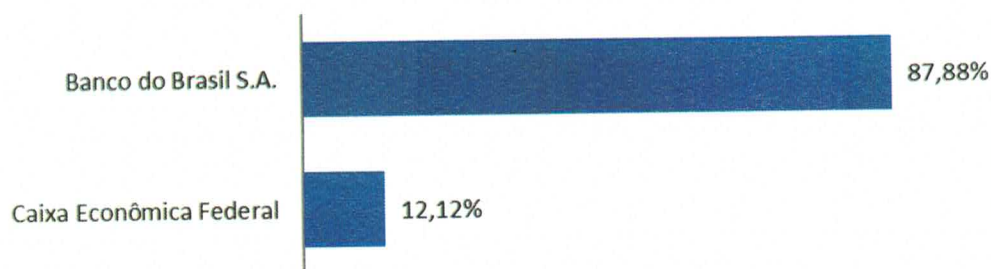
### % CARTEIRA



### 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%

### % CARTEIRA



### DOS RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021:

*[Handwritten signatures and initials in blue ink]*



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



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

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

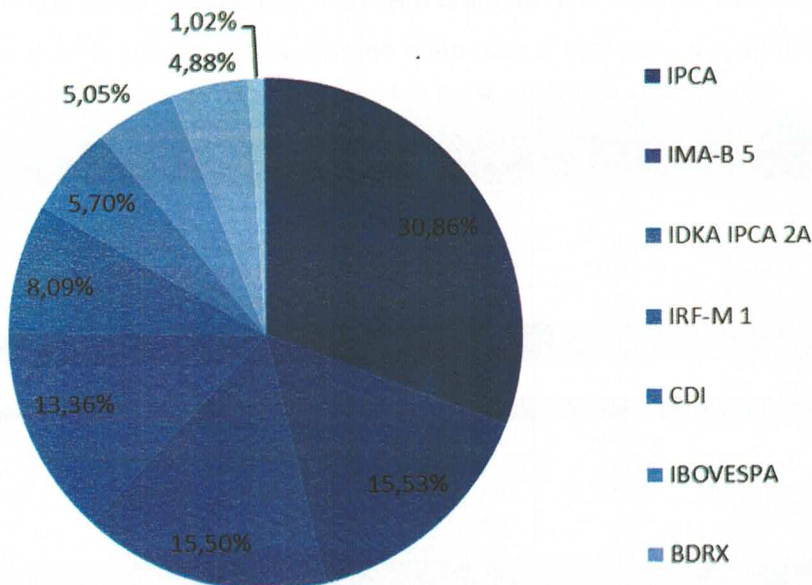
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub</b>		<b>59,56%</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$17.013.285,51</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:</b>							<b>R\$28.567.073,25</b>

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>



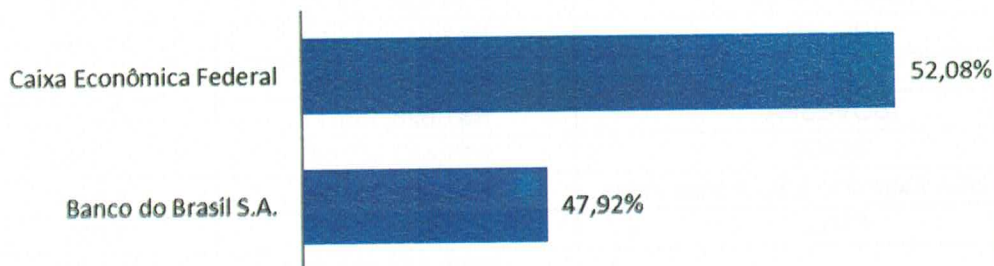
### % CARTEIRA



### 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%

### % CARTEIRA



### DOS RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022:

Foi observado pelo Membro Marcelo que a Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de 0,89% e fechou o mês com o saldo de R\$

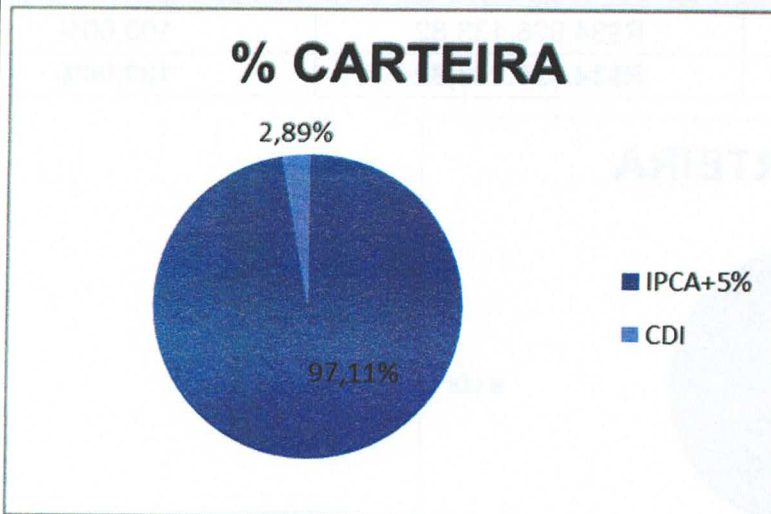
20.512.927,64 (vinte milhões e quinhentos e doze mil e novecentos e vinte e sete reais e sessenta e quatro centavos).

**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 PREVIDENCIÁRIO 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>

**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>



**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

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

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

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

**DOS RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023:**



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



Foi observado pelo membro Uliton que a Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um resultado de 0,89% e fechou o mês com o saldo de R\$ 34.926.133,82 (trinta e quatro milhões e seiscentos e dezessete mil e duzentos e noventa reais e oitenta e dois centavos).

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

Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do	% Participação	Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$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>

**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>



**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

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



**DOS RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2024:**

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

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

**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>





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



## DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

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



### DOS CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES:

*[Handwritten signatures]*





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



**CUSTOS DOS FUNDOS**

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

**CUSTOS SELIC**

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

**CONCLUSÃO:**



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



Analisando o presente relatório, verifica-se que o Macaeprev encerrou o mês de maio de 2024 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 4.774.669.413,57 (quatro bilhões e setecentos e setenta e quatro milhões e seiscentos e sessenta e nove mil e quatrocentos e treze reais e cinquenta e setes centavos). O gráfico a seguir apresenta a evolução patrimonial do Macaeprev a cada final de exercício.

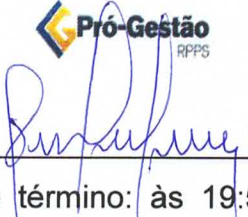


Os membros deste conselho ressaltam que, ao analisar os resultados da carteira nos últimos meses, é louvável observar um crescimento constante no saldo investido, apesar das flutuações nas taxas de retorno. A manutenção e expansão do saldo evidenciam diligência na administração dos recursos, conferindo segurança e potencial de crescimento para o porvir. Sendo assim, após análise detalhadamente das informações prestadas no presente relatório de investimento, deliberam por unanimidade os membros deste conselho pela **APROVAÇÃO** do relatório de investimento do mês de **MAIO de 2024**. Deliberam ainda os membros deste conselho fiscal, pela emissão de **TERMO DE APROVAÇÃO**, com o encaminhamento ao Gestor de Investimentos. Assim concluímos os trabalhos deste conselho sobre o relatório de investimento, ficando a presente ata à disposição dos servidores ativos, inativos e pensionistas, a fim de que tenham conhecimento acerca das informações contidas no presente. Esta ATA foi lavrada por mim, **Susan Cristina Venturini Ferraz**,


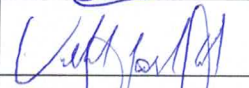
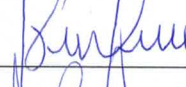
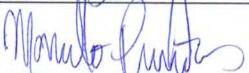


Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Comitê de Investimentos



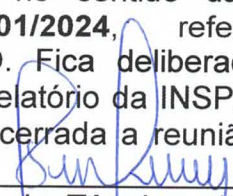
 sendo lida, aprovada e assinada por todos os presentes. Horário de término: às 19:50 h. Fica marcado para o dia 26/09/2024 a próxima reunião **EXTRAORDINÁRIA** deste Conselho Fiscal, às 17:00hs, na sede deste Instituto. Nada mais havendo para o momento, foi encerrada a reunião.

**CONSELHO FISCAL**





<b>HÉLIDA MARCIA DA COSTA M DAMASCENO</b>	<b>PRESIDENTE</b>	
<b>UELITON MACHADO PINTO</b>	<b>MEMBRO</b>	
<b>SUSAN C. V. FERRAZ</b>	<b>MEMBRO</b>	
<b>MARCELO P. TAVARES</b>	<b>MEMBRO</b>	



**REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA – ATA DA 36ª REUNIÃO POR CONVOCAÇÃO DOS MEMBROS DO CONSELHO FISCAL DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE MACAÉ (MACAEPREV) REALIZADA NO DIA 26/09/2024.**

**ATA nº 36/2024 DE 26/09/2024** - Ata de Reunião Extraordinária do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé, sendo aberta às 17:00 h, convocada por todos os membros, conforme Lei Complementar 119/2009 e art. 5º do Decreto 025/2012. Na presente reunião, reuniram-se na sede do Instituto de Previdência Social, na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, 293, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, inscrito no CNPJ sob o nº 03.567.964/0001-04, presentes os membros: **Hélida Marcia da Costa Mendonça Damasceno, Marcelo Puertas Tavares, Susan Cristina Venturini Ferraz e Ueliton Machado Pinto**. A presente reunião visa analisar a análise da Folha de pagamento dos pensionistas deste instituto, conforme demonstrativo em anexo, referente a julho de 2024, processo **310001/2024 volume VII**. Da análise do processo. Os membros deste Conselho após análise e debates, concluíram o relatório de INSPEÇÃO PROCESSUAL. Após novos debates e análises dos documentos acostados ao processo, pelos membros deste conselho, foi deliberado por **UNANIMIDADE** no sentido da **REGULARIDADE DOS ATOS EMITIDOS** no processo **310001/2024**, referente À AUTORIZAÇÃO PARA LIQUIDAÇÃO DE PAGAMENTO. Fica deliberado ainda, que seja anexada ao processo cópia desta Ata e do Relatório da INSPEÇÃO PROCESSUAL. Nada mais havendo para o momento, foi encerrada a reunião. Esta ATA foi lavrada por mim, Susan Cristina Venturini Ferraz,  sendo lida, aprovada e assinada por todos os presentes. Horário de Término: 19:20hs. Fica marcado para o dia 03/10/2024, a próxima reunião deste Conselho Fiscal, às 17:00 h, na sede deste Instituto.

**CONSELHO FISCAL**

<b>HÉLIDA MARCIA DA COSTA M DAMASCENO</b>	<b>PRESIDENTE</b>	
<b>MARCELO PUERTAS TAVARES</b>	<b>MEMBRO</b>	
<b>SUSAN CRISTINA VENTURINI FERRAZ</b>	<b>MEMBRO</b>	
<b>UELITON MACHADO PINTO</b>	<b>MEMBRO</b>	



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



EM BRANCO