



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



1 ATA n.º 40/2024 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 29/08/2024 – 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 nove de agosto de dois mil e vinte e quatro, estando
6 presentes os membros, *Alfredo Tanos Filho, Claudio de Freitas Duarte, Erenildo Motta da*
7 *Silva Júnior e José Eduardo da Silva Guinâncio*, instituídos através da portaria de nomeação
8 n.º 289/2021, os membros, *Miriam Amaral Queiroz e Patric Alves de Vasconcellos*
9 instituídos através da portaria n.º 306/2022, o membro *Viviane da Silva Lourenço Campos*
10 instituída através da portaria n.º 1.707/2022 e o membro *Fábio Carvalho de Moraes*
11 *Drumond* instituído através da portaria n.º 0685/2023. Iniciada a reunião, realizada de forma
12 on-line, através da plataforma Google Meets, que devido ao aumento de demanda está sendo
13 realizada conjuntamente com o Conselho Previdenciário, mas em atas separadas, sendo
14 tratados os seguintes assuntos: I – APRESENTAÇÃO DO RELATÓRIO DE
15 INVESTIMENTOS – CARTEIRA DE JULHO DE 2024: INTRODUÇÃO: Mantendo
16 elevados níveis de transparência e para manter boa comunicação junto aos servidores e
17 munícipes, o Instituto de Previdência Social do Município de Macaé – Macaeprev apresenta o
18 relatório de investimentos, referente ao mês de julho de 2024. Neste relatório é possível
19 observar a consolidação de todas as informações relativas ao período de referência, incluindo
20 o cenário econômico, os resultados alcançados em relação às metas estabelecidas, o
21 comportamento dos ativos financeiros que compõe a carteira de investimentos do Macaeprev,
22 inclusive quanto aos indicadores de desempenho e gerenciamento de riscos. **CENÁRIO**
23 **ECONÔMICO:** No mês de julho, os mercados foram agitados por eventos políticos e
24 econômicos, como a desistência da candidatura à reeleição do presidente dos Estados Unidos,
25 Joe Biden, e o discurso mais dovish do presidente do Federal Reserve (Fed), Jerome Powell,
26 após a última reunião do Federal Open Market Committee (FOMC). Os investimentos no
27 exterior continuaram apresentando bons resultados, impulsionados pela valorização do dólar
28 em relação ao real e pelo desempenho positivo dos índices globais. No front geopolítico, a
29 tensão no oriente médio aumentou neste mês com um ataque a lideranças do Hamas em solo
30 iraniano, o que reduziu a probabilidade de um cessar-fogo e aumentou o risco de uma

1



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



31 escalada para um conflito regional envolvendo Israel e Irã. Além disso, a guerra da Ucrânia
32 completa 29 meses, sem perspectivas de avanço nas negociações diplomáticas. Nos EUA, os
33 dados do varejo ficaram estáveis (0,0%), acima das expectativas do mercado, que esperava
34 queda de -0,3%. Além disso, o resultado do mês anterior foi revisado para cima, de +0,1%
35 para +0,3%. O Índice de Gerente de Compras (PMI, na sigla em inglês) composto dos Estados
36 Unidos, que reúne dados do setor industrial e, também de serviços, subiu marginalmente para
37 54,8 em junho, ante 54,5 em maio, segundo dados da S&P Global. É o crescimento mais
38 rápido da atividade em 22 meses. A inflação medida pelo índice CPI em junho caiu 0,1%
39 (M/M). O resultado significa uma desaceleração na comparação anual. Nos últimos 12 meses
40 até junho, o índice ficou em 3%. Os dados vieram abaixo das estimativas do mercado, que
41 esperava alta mensal de 0,1% e anual de 3,1%. Já a inflação medida pelo PCE de maio
42 apresentou estabilidade ante o crescimento de 0,1% (M/M) em junho, com estabilidade do
43 índice acumulado em 12 meses em 2,6%, abaixo da projeção de mercado. No mês de junho,
44 foram geradas 206 mil vagas, abaixo da estimativa revisada para baixo de 215 mil, mesmo
45 assim o mercado de trabalho continua a mostrar dados robustos. No entanto, a taxa de
46 desemprego subiu de 4% para 4,1%, marcando a primeira vez desde novembro de 2021 que a
47 taxa de desemprego ficou acima de 4%. Esse cenário continua a pressionar a política
48 monetária, o que pode levar à manutenção das taxas de juros por um período mais longo. O
49 FOMC decidiu novamente por manter os juros básicos estáveis no intervalo de 5,25% a
50 5,50% a.a. em linha com o consenso de mercado. Com relação à conjuntura econômica, o
51 comunicado realizou uma necessária adequação, reconhecendo os avanços recentes obtidos na
52 direção de um melhor equilíbrio entre os dois objetivos do mandato do Fed. Especificamente,
53 o documento novamente indicou que a atividade econômica continuou se expandindo a um
54 ritmo sólido, mas avaliou que os ganhos de empregos “moderaram” e que a “taxa de
55 desemprego subiu” apesar de permanecer baixa. Em conferência, Jerome Powell inclusive
56 revelou que houve uma discussão sobre um possível corte, mas que foi constituída uma forte
57 maioria pela manutenção. Ele também teve que esclarecer que um corte inicial de 50 bps não
58 era algo com o que o comitê estaria considerando e, em linhas gerais, deixou claro que o
59 momento para ajustar juros está próximo. Na China, por sua vez, o People’s Bank of China
60 (PBoC) informou que reduziu as suas taxas referenciais de empréstimos (Loan Prime Rate -



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



61 LPR) em 10 bps, com a taxa de um ano passando de 3,45% a.a. para 3,35% a.a. e a de cinco
62 anos passando de 3,95% a.a. para 3,85% a.a. A decisão surpreendeu o mercado, cuja mediana
63 das expectativas apontava para a manutenção dos respectivos patamares. Esse efeito tem
64 sustentado o bom desempenho da indústria. No entanto, o segmento imobiliário ainda
65 apresenta dados frustrantes e desempenho abaixo das expectativas. Falando um pouco de
66 Japão, o Policy Board do Bank of Japan (BoJ) decidiu, com 7 votos favoráveis e 2 contrários,
67 elevar sua taxa de juros de curto prazo do intervalo (0,0% a 0,1% a.a.) para em torno de
68 0,25% a.a., mantendo sua política monetária em terreno acomodatório, mas surpreendendo o
69 mercado que esperava pela manutenção. Na Zona do Euro, a inflação medida pelo CPI de
70 junho desacelerou de 2,6% para 2,5% (A/A), em linha com as expectativas de mercado
71 (2,5%). O Banco Central Europeu (BCE) manteve estáveis suas três taxas de juros diretoras,
72 em linha com a expectativa do mercado. Assim, as taxas de juros das operações principais de
73 refinanciamento, de cedência de liquidez e de depósito permaneceram, respectivamente, no
74 patamar de 4,25%, 4,50% e 3,75%. No comunicado, a autoridade monetária justificou a
75 decisão pelo fato de o cenário seguir corroborando a avaliação da instituição de convergência
76 da inflação para a meta no médio prazo. De acordo com o documento, o Conselho do BCE
77 segue determinado a assegurar o retorno da inflação para o seu objetivo no horizonte de
78 análise e avalia que as taxas diretoras permanecerão suficientemente restritivas durante o
79 tempo que for necessário, sem se comprometer previamente com uma trajetória específica
80 para as taxas. Mais uma vez, a autoridade monetária apontou que seguirá com uma postura
81 dependente dos dados. Christine Lagarde, presidente do BCE, foi questionada de forma
82 reiterada sobre um eventual corte na reunião de setembro/24. Em suas respostas, indicou que
83 há dados para serem divulgados até lá e que o conselho decide reunião a reunião (meeting by
84 meeting), ressaltando mais de uma vez que não há compromisso prévio com uma trajetória
85 específica para os juros. No Brasil, em julho, houve melhora generalizada nos dados de
86 confiança e o índice de incerteza recuou 0,3% (M/M). Destaque positivo para a confiança da
87 indústria (3,4%, M/M) e do consumidor (2,0%, M/M). Em relação aos dados da atividade
88 econômica, vale destacar a geração líquida de vagas formais (CAGED) de junho (201.705).
89 No acumulado de janeiro a junho, os cinco grandes grupamentos de atividades econômicas
90 registraram saldos positivos no ano, com destaque para o crescimento do emprego no setor de

   3  



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



91 Serviços (716.909), que acumulou 55,14% do saldo total. A Indústria também apresentou
92 saldo positivo de 242.314 no ano, com destaque para a Fabricação de Álcool (11.747) e a
93 Fabricação de Embalagens de Material Plástico (7.786), seguida da Construção Civil
94 (180.779), do Comércio (86.254) e da Agropecuária (73.809), setores que tiveram acréscimo
95 de postos de trabalho no ano. O resultado marcou o sexto mês consecutivo com mais
96 contratações do que demissões e fez o mercado de trabalho fechar o primeiro semestre com
97 1,3 milhão de novas vagas formais. No mesmo período do ano passado, o saldo de
98 contratações com carteira assinada ficou positivo em 1,0 milhão de postos. Em maio, o Índice
99 de Atividade Econômica do Banco Central (IBC-Br) avançou 0,2% (M/M), mesmo com as
100 enchentes no estado do Rio Grande do Sul. Entre os setores da atividade econômica, destaque
101 para o varejo restrito (1,2%, M/M) em maio, segmento que vem sendo beneficiado pelo
102 aumento da massa salarial real (9,0% para 9,2%, A/A) e a melhora da confiança. Entre os
103 vetores, destaque para itens mais ligados à renda, tais como (i) Vestuário (2,0%), se
104 beneficiando de melhores preços, (ii) Outros artigos de uso pessoal e doméstico (1,6%) e (iii)
105 Hiper mercados (0,7%). Em relação ao campo monetário, houve a reunião do Comitê de
106 Política Monetária (Copom), o principal evento do mês. Apesar das pressões inflacionárias e
107 da desvalorização cambial, o comitê decidiu manter, por unanimidade, a taxa básica de juro
108 (Selic) em 10,5% a.a. O comitê avaliou que a decisão de manter os juros é compatível com a
109 estratégia de convergência da inflação para o redor da meta. Entretanto, o comitê destacou
110 que o cenário global está incerto e o cenário doméstico está sendo marcado por resiliência na
111 atividade, elevação das projeções de inflação e expectativas “desancoradas” que “demandam
112 acompanhamento diligente e ainda maior cautela”. Em relação aos próximos passos, não foi
113 fornecido um guidance, com o Comitê apenas afirmando que “se manterá vigilante” e que
114 “eventuais ajustes futuros na taxa de juros serão ditados pelo firme compromisso de
115 convergência da inflação à meta”. O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE)
116 divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) que avançou +0,38%
117 (M/M) em julho, acelerando em relação ao avanço de +0,21% (M/M) observado no mês
118 anterior. Sendo que a variação foi superior à projeção de mercado de +0,31%. Com isso, o
119 índice acumulou alta de +4,50% em 12 meses (ante +4,23% em junho). Os itens que mais
120 contribuíram para a variação vieram dos grupos Transportes (variação de +1,82% ante



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



121 projeção de +1,54%) e Saúde e cuidados pessoais (+0,22% ante projeção de -0,14%). A maior
122 contribuição para a variação do índice partiu do grupo Transportes influenciado pelo
123 expressivo aumento dos itens de Transporte público. Os preços administrados avançaram
124 +1,08% em julho, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Gasolina
125 (+3,15% ante +0,64% na leitura anterior). Já os preços livres desaceleraram (de +0,16% para
126 +0,14%) deixando de ser os principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres
127 houve avanço de produtos industriais e de serviços +0,13% para +0,33% e +0,04% para
128 +0,75% respectivamente, enquanto alimentos apresentaram recuo de +0,47% para -1,51%. Na
129 margem, tivemos desaceleração da medida subjacente de industriais (de +0,13% para
130 +0,11%), entretanto, o núcleo de serviços ganhou ritmo (de +0,36% para +0,63%). O índice
131 de difusão passou de 52,25% em junho para 46,95% em julho. O Ibovespa, principal índice da
132 bolsa de valores brasileira, em julho, apresentou valorização de 3,02% em relação ao mês
133 anterior, fechando aos 127.652 pontos. No ano, o índice acumula queda de 4,87%, se
134 descolando das principais bolsas do mundo. Neste contexto, a performance positiva no mês
135 pode ser explicada, majoritariamente, pela expressiva entrada de recursos de investidores
136 estrangeiros em função da expectativa de que o Fed deverá iniciar o ciclo de corte de juros
137 nos Estados Unidos em setembro. Além disso, o início da flexibilização monetária diminui a
138 atratividade dos títulos públicos norte-americanos e, em contrapartida, aumenta o apetite dos
139 investidores estrangeiros por ativos de maior risco, como ações, fazendo com que países
140 emergentes, como o Brasil, sejam beneficiados por um maior ingresso de recursos vindo
141 desses investidores. Espera-se então que o fluxo estrangeiro para o Brasil aumente a partir de
142 uma maior definição do início de cortes pelo FOMC. Internamente, é esperado que o fluxo
143 doméstico aumente a partir de uma Selic mais próxima a um dígito, expectativa que foi
144 prorrogada para o segundo semestre de 2025. **RESULTADO DA CARTEIRA:** No mês de
145 julho, nosso portfólio teve desempenho superior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês
146 com uma rentabilidade de 1,17%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA +
147 5,02%, foi de 0,79%.



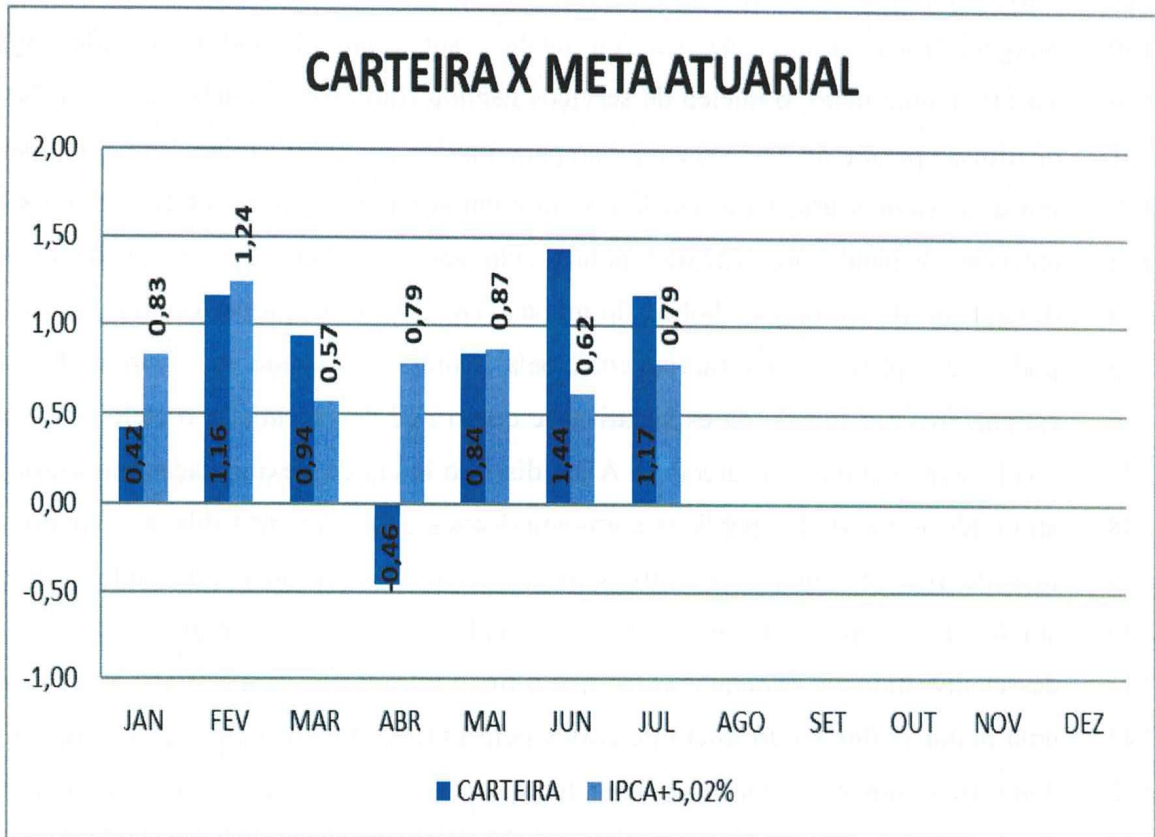
148

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
CARTEIRA	0,42	1,16	0,94	-0,46	0,84	1,44	1,17						5,63
IPCA+5,02%	0,83	1,24	0,57	0,79	0,87	0,62	0,79						5,85

149

150



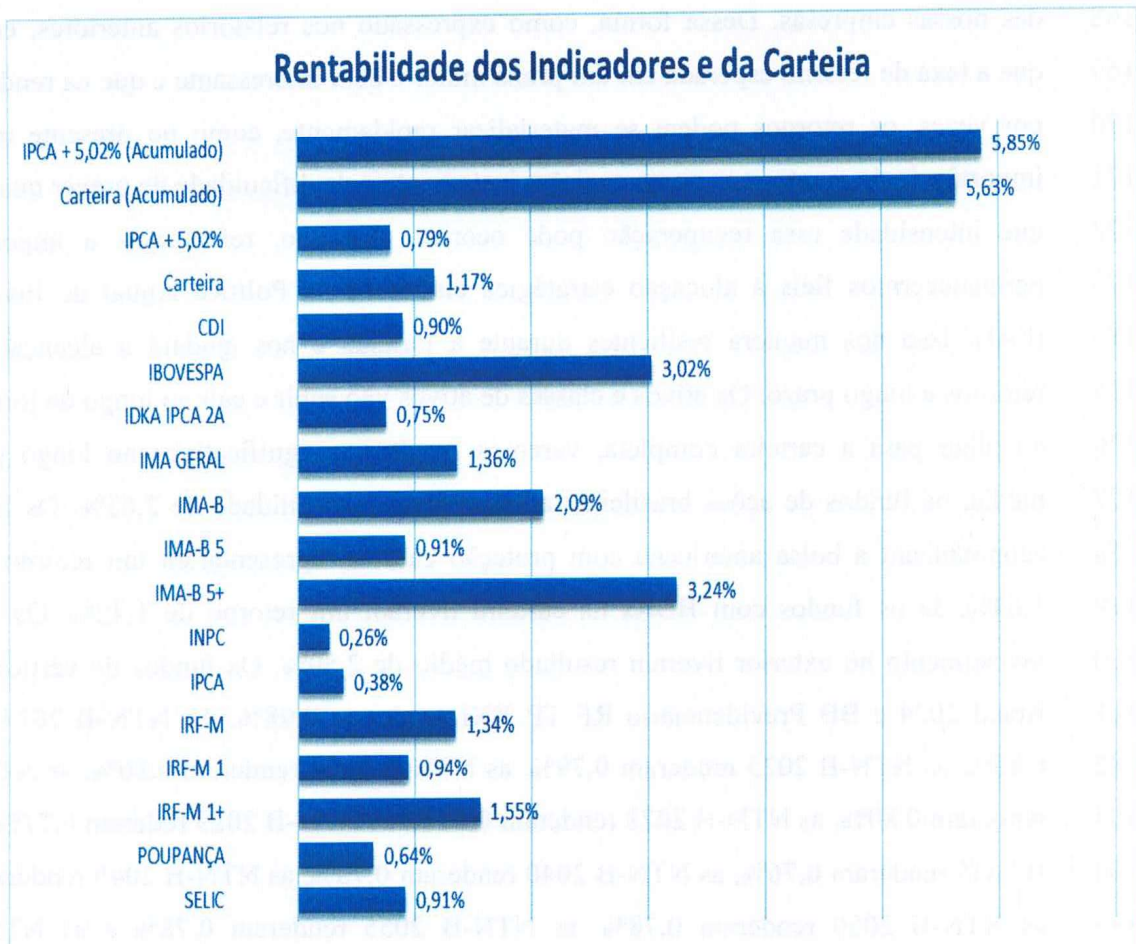
151

152 A seguir, apresento o quadro com o comportamento da Carteira, Meta Atuarial e diversos

153 índices do mercado.

154

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



155

156 No mês de julho, observamos um comportamento positivo em nossos fundos de investimento.
157 Os investimentos no exterior e bolsa doméstica foram os que mais contribuíram para nossa
158 carteira. Dessa forma, as maiores altas na carteira foram do BB Multimercado Nordea IE com
159 5,12%, BB Ações Ibovespa Ativo com 4,25% e Caixa Expert Claritas Valor com 3,83%. Esse
160 desempenho positivo deve-se, principalmente, à fala considerada dovish do presidente do Fed.
161 Isso foi extremamente benéfico para a classe de ativos e, conseqüentemente, para a nossa
162 carteira. Nesse mês, a bolsa brasileira acompanhou o cenário global. Falas mais comedidas do
163 Campos Neto e de Galípolo, acenando que buscam formas de atingir o centro da meta de
164 juros, geraram um certo alívio. Dessa forma, quase toda a carteira do Macaeprev fechou no
165 campo positivo, com apenas dois fundos com rendimentos negativos: FIDC Multisetorial
166 Itália com -1,05% e BB Multimercado Global Select Equity IE com -0,02%. Com isso, as
167 forças vendedoras, devido ao contexto macroeconômico, reduziram a pressão nas cotações



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

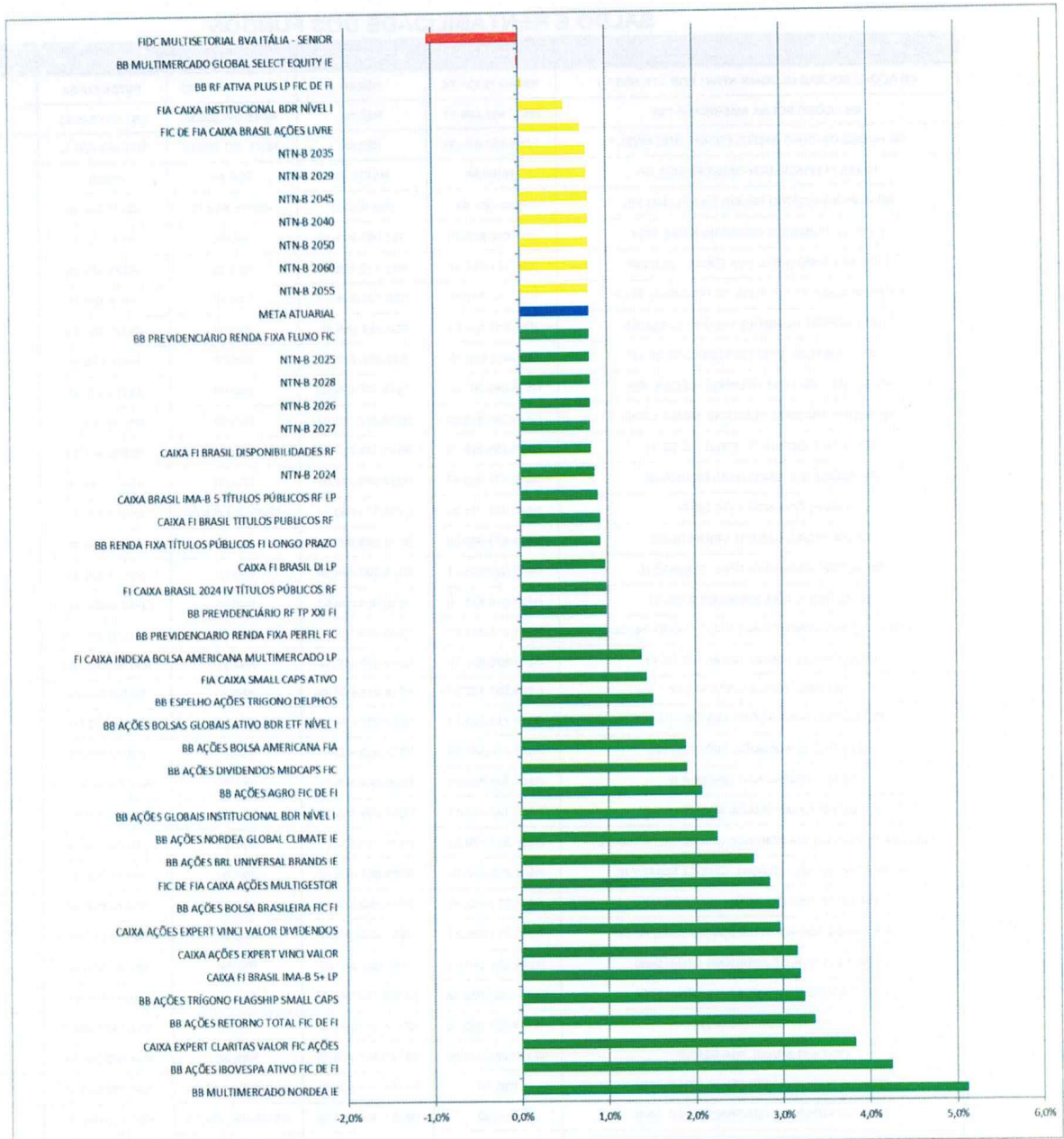


168 das nossas empresas. Dessa forma, como expressado nos relatórios anteriores, entendemos
169 que a taxa de retorno esperada em um prazo maior é bem interessante e que na renda variável,
170 por vezes, os retornos podem se materializar rapidamente, como no presente mês. Daí a
171 importância de mantermos nossa posição, justamente pela dificuldade de prever quando e com
172 que intensidade essa recuperação pode ocorrer. Por isso, reforçamos a importância de
173 permanecermos fiéis à alocação estratégica elaborada na Política Anual de Investimentos
174 (PAI). Isso nos manterá resilientes durante a jornada e nos ajudará a alcançar melhores
175 retornos a longo prazo. Os ativos e classes de ativos vão subir e cair ao longo da jornada, mas,
176 ao olhar para a carteira completa, veremos resultados significativos no longo prazo. Em
177 média, os fundos de ações brasileiras apresentaram rentabilidade de 2,63%. Os fundos que
178 acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno médio de
179 1,64%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno de 1,42%. Os fundos de
180 investimento no exterior tiveram resultado médio de 2,50%. Os fundos de vértice FI Caixa
181 Brasil 2024 e BB Previdenciário RF TP XXI renderam 0,98%. As NTN-B 2024 renderam
182 0,85%, as NTN-B 2025 renderam 0,79%, as NTN-B 2026 renderam 0,80%, as NTN-B 2027
183 renderam 0,80%, as NTN-B 2028 renderam 0,80%, as NTN-B 2029 renderam 0,77%, as NTN-
184 B 2035 renderam 0,76%, as NTN-B 2040 renderam 0,78%, as NTN-B 2045 renderam 0,78%,
185 as NTN-B 2050 renderam 0,78%, as NTN-B 2055 renderam 0,78% e as NTN-B 2060
186 renderam 0,78%. Em média, as NTN-B ficaram com 0,78%. Os fundos de renda fixa
187 indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,95%. O fundo de renda fixa
188 com gestão ativa rendeu 0,03%. O fundo IMA-B 5 teve um retorno de 0,89%. O fundo IMA-
189 B 5+ teve retorno de 3,20%. O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade negativa de -
190 1,05%. Até 31/07/2024 foram resgatados o total de R\$ 10.132.155,67 (dez milhões e cento e
191 trinta e dois mil e cento e cinquenta e cinco reais e sessenta e sete centavos), mais de 100% do
192 capital total investido. O saldo em 31 de julho estava em R\$ 2.119.105,84 (dois milhões e
193 cento e dezenove mil e cento e cinco reais e oitenta e quatro centavos). O gráfico a seguir
194 mostra a comparação entre a rentabilidade dos fundos e a Meta Atuarial. Os fundos em verde
195 bateram a Meta Atuarial, os fundos em amarelo apresentaram resultado positivo, porém,
196 abaixo da Meta Atuarial e os fundos em vermelho tiveram resultado negativo.

197



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



198

199

200 O rendimento de julho da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 51.906.106,77 (cinquenta e
201 um milhões e novecentos e seis mil e cento e seis reais e setenta e sete centavos). O
202 Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de julho em R\$ 4.523.771.274,33 (quatro
203 bilhões e quinhentos e vinte e três milhões e setecentos e setenta e um mil e duzentos e setenta
204 e quatro reais e trinta e três 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 30/06/2024	Saldo em 31/07/2024	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$48.230.991,74	R\$0,00	-R\$48.962.710,36	R\$731.718,62	1,52%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$52.953.859,67	R\$0,00	-R\$53.955.500,50	R\$1.001.640,83	1,89%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$69.669.670,03	R\$0,00	-R\$71.227.220,75	R\$1.557.550,72	2,24%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$102,50	R\$103,33	R\$0,00	R\$0,83	0,81%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$42.061,84	R\$6.850,65	-R\$145.542,15	R\$110.330,96	0,79%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2024	R\$1.060.870,73	R\$1.069.984,12	R\$0,00	R\$9.113,39	0,85%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$2.141.614,47	R\$2.119.105,84	R\$0,00	-R\$22.508,63	-1,05%
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	R\$2.112.798,41	R\$2.131.964,55	R\$0,00	R\$19.166,14	0,91%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$4.510.382,70	R\$4.682.966,49	R\$0,00	R\$172.583,79	3,83%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$6.403.669,35	R\$6.462.249,20	R\$0,00	R\$58.579,85	0,91%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	R\$19.049.301,95	R\$19.337.574,93	R\$0,00	R\$288.272,98	1,51%
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	R\$18.788.876,02	R\$19.397.103,92	R\$0,00	R\$608.227,90	3,24%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$20.258.189,72	R\$21.118.631,35	R\$0,00	R\$860.441,63	4,25%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	R\$21.477.409,36	R\$22.048.572,66	R\$0,00	R\$571.163,30	2,66%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$44.020.481,93	R\$24.573.090,13	-R\$20.000.000,00	R\$552.608,20	2,07%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	R\$23.873.969,53	R\$24.628.095,90	R\$0,00	R\$754.126,37	3,16%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	R\$25.323.574,41	R\$25.892.096,65	R\$0,00	R\$568.522,24	2,25%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$30.074.637,39	R\$30.963.266,57	R\$0,00	R\$888.629,18	2,95%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	R\$44.875.464,09	R\$46.204.155,29	R\$0,00	R\$1.328.691,20	2,96%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$46.665.967,16	R\$48.235.450,18	R\$0,00	R\$1.569.483,02	3,36%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$49.206.187,76	R\$49.914.687,99	R\$0,00	R\$708.500,23	1,44%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$50.714.323,73	R\$52.157.276,14	R\$0,00	R\$1.442.952,41	2,85%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$52.310.587,90	R\$53.302.880,71	R\$0,00	R\$992.292,81	1,90%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$53.529.463,64	R\$56.269.336,81	R\$0,00	R\$2.739.873,17	5,12%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$57.136.344,41	R\$57.536.549,44	R\$0,00	R\$400.205,03	0,70%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$56.961.370,67	R\$57.746.894,71	R\$0,00	R\$785.524,04	1,38%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$66.015.372,28	R\$66.005.309,49	R\$0,00	-R\$10.062,79	-0,02%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$74.571.492,51	R\$74.950.310,80	R\$0,00	R\$378.818,29	0,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$80.511.538,21	R\$81.230.373,87	R\$0,00	R\$718.835,66	0,89%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2060	R\$89.221.389,60	R\$89.926.947,00	R\$0,00	R\$705.557,40	0,78%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2040	R\$102.337.936,48	R\$103.141.746,12	R\$0,00	R\$803.809,64	0,78%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$117.561.893,32	R\$118.704.841,89	R\$0,00	R\$1.142.948,57	0,97%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	R\$140.798.982,65	R\$145.301.379,46	R\$0,00	R\$4.502.396,81	3,20%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2035	R\$0,00	R\$151.155.823,73	R\$149.996.238,76	R\$1.159.584,97	0,76%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2029	R\$0,00	R\$151.164.553,20	R\$149.998.497,74	R\$1.166.055,46	0,77%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2028	R\$153.194.372,51	R\$154.442.375,98	R\$0,00	R\$1.248.003,47	0,80%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2055	R\$187.104.221,28	R\$188.583.064,66	R\$0,00	R\$1.478.843,38	0,78%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	R\$224.052.911,32	R\$199.115.001,02	-R\$25.000.000,00	R\$62.089,70	0,03%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2026	R\$206.513.329,04	R\$208.183.744,23	R\$0,00	R\$1.670.415,19	0,80%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$217.148.956,06	R\$219.266.387,48	R\$0,00	R\$2.117.431,42	0,98%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$243.685.097,73	R\$246.061.620,61	R\$0,00	R\$2.376.522,88	0,98%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2045	R\$270.098.364,07	R\$272.226.630,66	R\$0,00	R\$2.128.266,59	0,78%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2050	R\$296.073.678,86	R\$298.412.320,90	R\$0,00	R\$2.338.642,04	0,78%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$418.779.757,80	R\$343.743.959,60	-R\$77.959.771,33	R\$2.923.973,13	0,99%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2027	R\$349.174.118,74	R\$352.019.377,75	R\$0,00	R\$2.845.259,01	0,80%
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 2025	R\$430.885.582,58	R\$434.336.618,32	R\$0,00	R\$3.451.025,74	0,79%
TOTAL	R\$4.469.121.176,15	R\$4.523.771.274,33	R\$2.743.991,41	R\$51.906.106,77	1,17%



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



206 DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

207

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

209

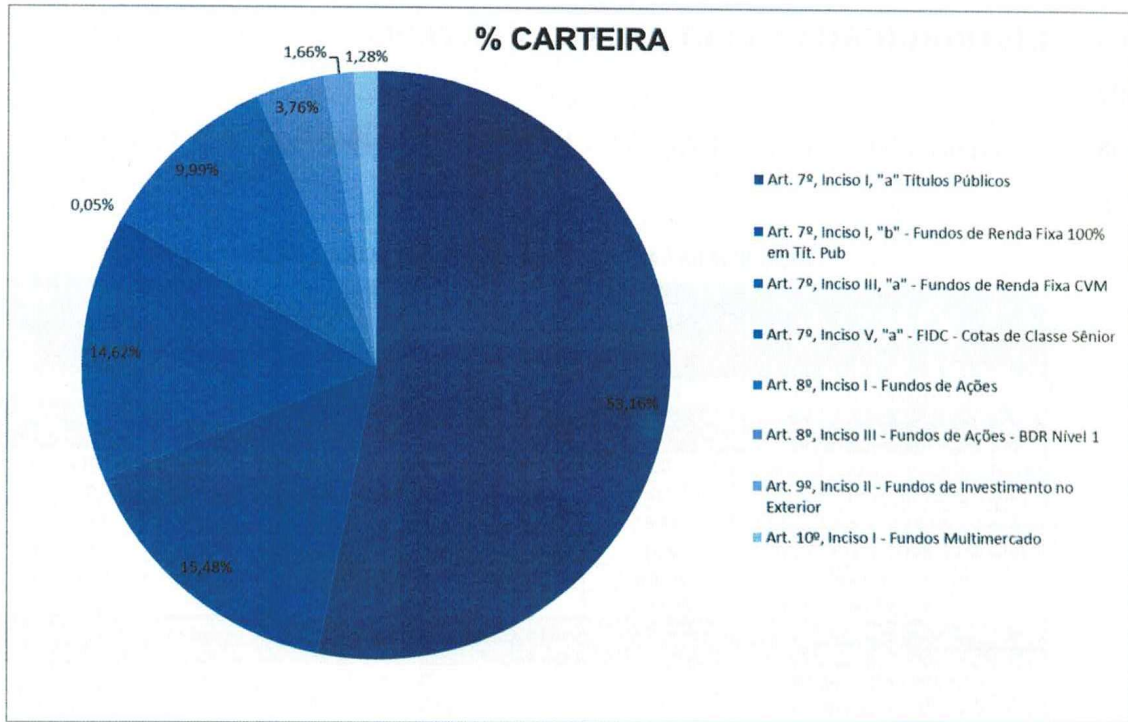
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2024

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		53,16%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	Não se Aplica	R\$2.404.663.186,67
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	IPCA+	53,16%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	NA	R\$2.404.663.186,67
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		15,48%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$700.453.975,17
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	CDI	0,05%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,01% ✓	R\$2.131.964,55
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	0,14%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,06% ✓	R\$6.462.249,20
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	1,80%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,12% ✓	R\$81.230.373,87
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	4,85%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	5,38% ✓	R\$219.266.387,48
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	IMA-B 5+	3,21%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	12,45% ✓	R\$145.301.379,46
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	5,44%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	6,59% ✓	R\$246.061.620,61
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		14,82%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$661.570.756,49
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	7,60%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	2,00% ✓	R\$343.743.959,60
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$6.850,65
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	CDI	4,40%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	4,27% ✓	R\$199.115.001,02
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	2,62%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,73% ✓	R\$118.704.841,89
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$103,33
Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior		0,05%	5,00% ✓	0,20% ✓	20,00% ✓	5,00% ✓	R\$2.119.105,84
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,05%	5,00% ✓	0,20% ✓	20,00% ✓	3,64% ✓	R\$2.119.105,84
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		9,99%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$452.051.729,04
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,47%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	14,67% ✓	R\$21.118.631,35
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,68%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	15,16% X	R\$30.963.266,57
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,54%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	11,15% ✓	R\$24.573.090,13
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,07%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	6,78% ✓	R\$48.235.450,18
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	1,18%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	6,89% ✓	R\$53.302.880,71
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	IDIV	0,43%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	10,27% ✓	R\$19.337.574,93
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	SMLL	0,43%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	36,02% ✓	R\$19.397.103,92
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	IBOVESPA	0,54%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	3,19% ✓	R\$24.628.095,90
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	IDIV	1,02%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	4,44% ✓	R\$46.204.155,29
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,10%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	16,72% ✓	R\$4.682.966,49
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,10%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	8,23% ✓	R\$49.914.687,99
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,15%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	9,48% ✓	R\$52.157.276,14
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,27%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	8,67% ✓	R\$57.536.549,44
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		1,66%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$74.950.310,80
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,66%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	2,76% ✓	R\$74.950.310,80
Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior		3,78%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$170.215.315,61
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	1,46%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	4,14% ✓	R\$66.005.309,49
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	MSCI WORLD	0,57%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	7,53% ✓	R\$25.892.096,65
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	MSCI WORLD	0,49%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	11,13% ✓	R\$22.048.572,66
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	1,24%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	41,48% ✓	R\$56.269.336,81
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		1,28%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$57.746.894,71
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,28%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	3,00% ✓	R\$57.746.894,71
Total:							R\$4.523.771.274,33

210



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



211
212
213
214

DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

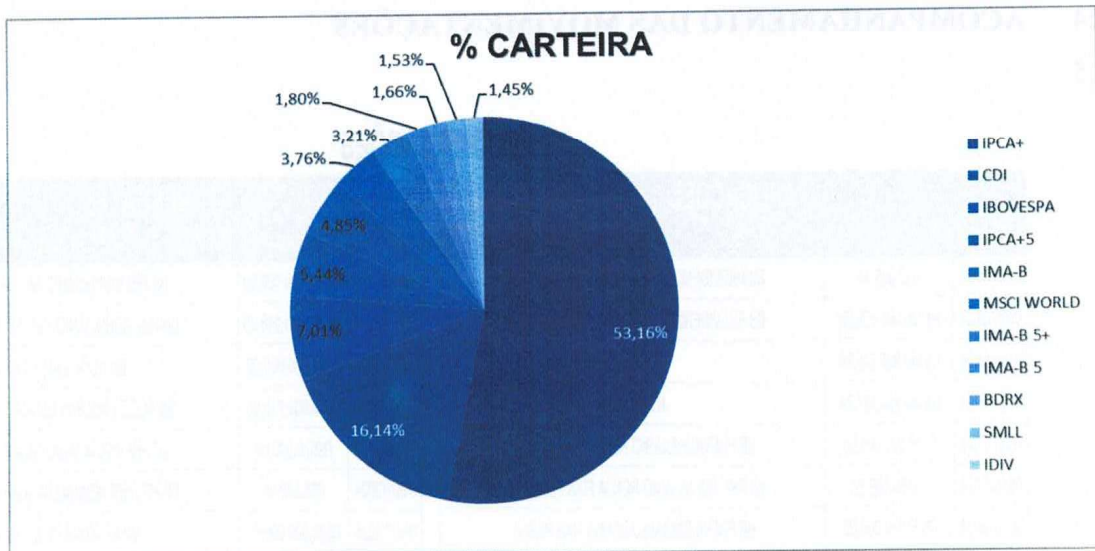
Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IPCA+	R\$2.404.663.186,67	53,16%
CDI	R\$730.030.970,79	16,14%
IBOVESPA	R\$317.198.206,91	7,01%
IPCA+5	R\$246.061.620,61	5,44%
IMA-B	R\$219.266.387,48	4,85%
MSCI WORLD	R\$170.215.315,61	3,76%
IMA-B 5+	R\$145.301.379,46	3,21%
IMA-B 5	R\$81.230.373,87	1,80%
BDRX	R\$74.950.310,80	1,66%
SMLL	R\$69.311.791,91	1,53%
IDIV	R\$65.541.730,22	1,45%
Total	R\$4.523.771.274,33	100,00%

215
216

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



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



217

218

219 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

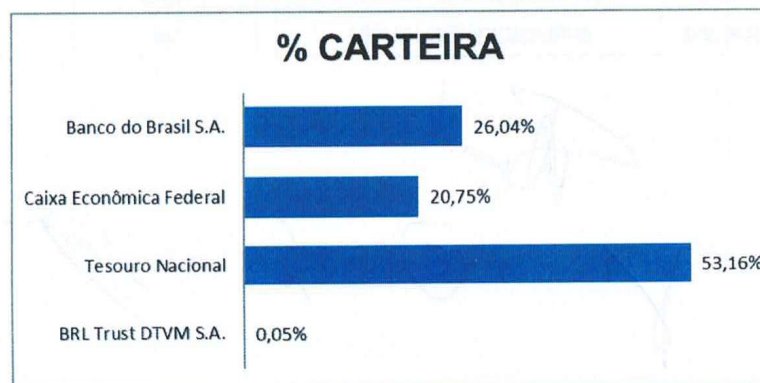
220

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$2.119.105,84	0,05%
Tesouro Nacional	R\$2.404.663.186,67	53,16%
Caixa Econômica Federal	R\$938.786.271,99	20,75%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.178.202.709,83	26,04%

221

222



223



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



224 ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

225

MOVIMENTAÇÕES

APLICAÇÕES			RESGATES		
Data	Valor		Data	Valor	Ativo
01/07/2024	R\$2.805,18	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	02/07/2024	R\$300.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
02/07/2024	R\$300.005.009,99	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	03/07/2024	R\$299.985.918,25	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
03/07/2024	R\$149.996.238,76	NTN-B 2035	04/07/2024	R\$20.000.000,00	BB AÇÕES AGRO FIC DE FI
03/07/2024	R\$149.998.497,74	NTN-B 2029	04/07/2024	R\$48.962.710,36	BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FI BDR
05/07/2024	R\$25.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	04/07/2024	R\$670.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
05/07/2024	R\$150.086,22	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	04/07/2024	R\$8.540,08	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
08/07/2024	R\$69.270.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	05/07/2024	R\$25.000.000,00	BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI
09/07/2024	R\$54.217.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	05/07/2024	R\$53.955.500,50	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES
10/07/2024	R\$71.227.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	05/07/2024	R\$71.227.220,75	BB AÇÕES ESG IS FI EM AÇÕES BDR
10/07/2024	R\$832,63	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	08/07/2024	R\$50.094,81	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
11/07/2024	R\$3.419,91	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	09/07/2024	R\$258.132,03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/07/2024	R\$4.595.711,60	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	12/07/2024	R\$20.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
17/07/2024	R\$4.440.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	12/07/2024	R\$2.780,38	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
18/07/2024	R\$29.462,20	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	17/07/2024	R\$4.432.340,72	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
22/07/2024	R\$11.279,96	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	19/07/2024	R\$135.464,58	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
23/07/2024	R\$1.392,80	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	24/07/2024	R\$9.780.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
24/07/2024	R\$781,55	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	30/07/2024	R\$4.417.771,33	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL
25/07/2024	R\$8.294.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	31/07/2024	R\$1.157.546,82	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
25/07/2024	R\$1.033.089,58	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
26/07/2024	R\$50.422,81	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
29/07/2024	R\$702,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
30/07/2024	R\$278,79	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
31/07/2024	R\$4.480.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL			
TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES					
Aplicações			R\$842.808.012,02		
Resgates			-R\$840.064.020,61		
Saldo			R\$2.743.991,41		

226

227

228

229

230

231

232

233



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



234 MONITORAMENTO DE RISCOS

235

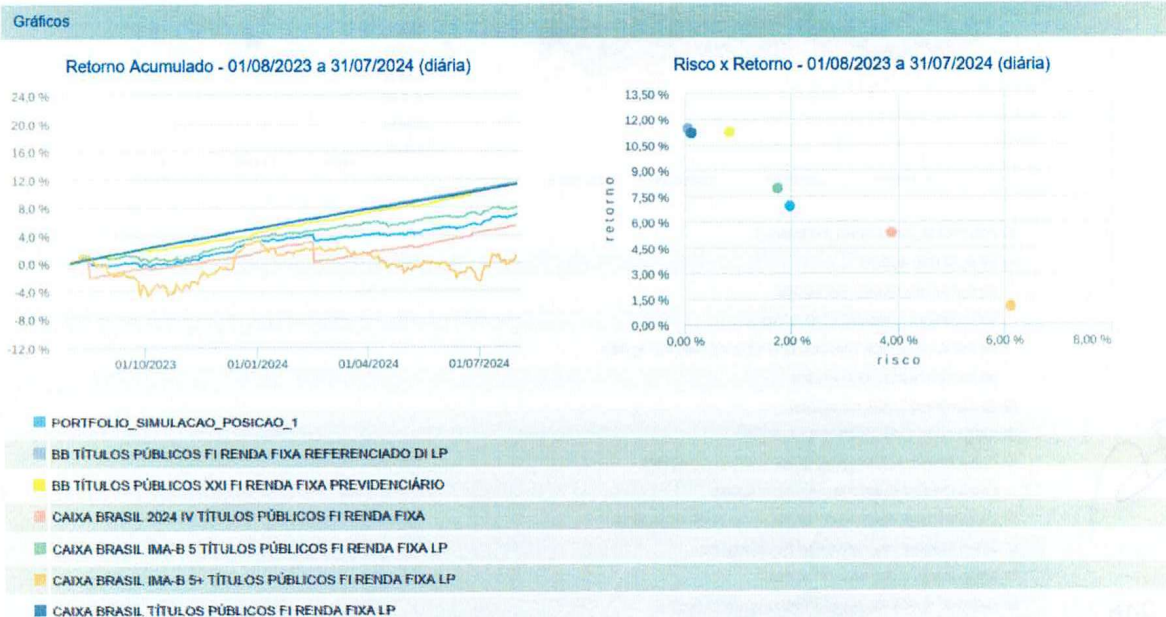
236 ART. 7º, INCISO I, "A" – TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOUREO NACIONAL



237

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

239



240

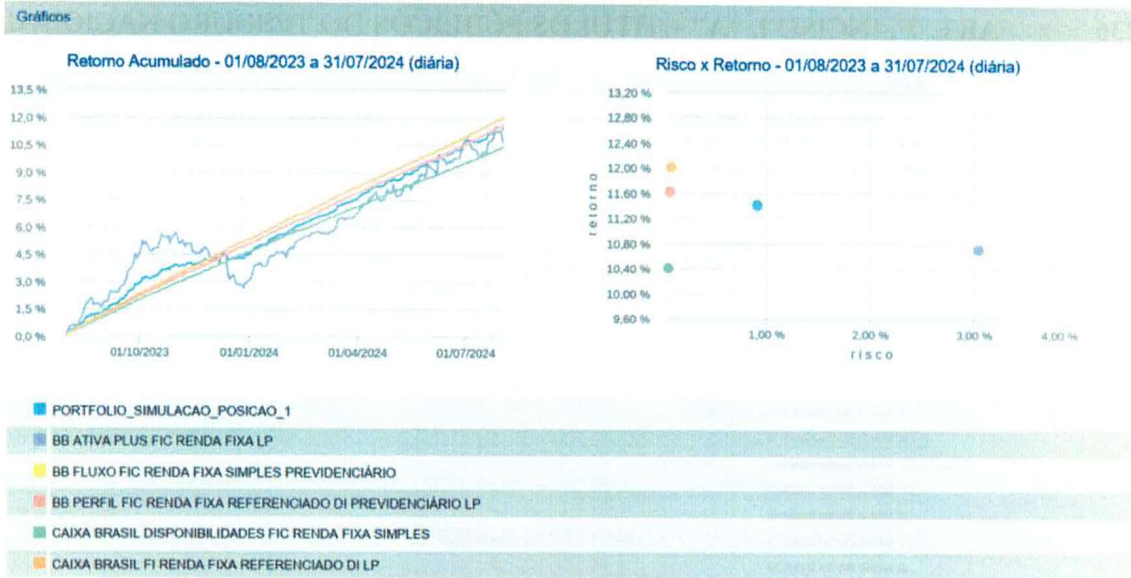


Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Comitê de Investimentos



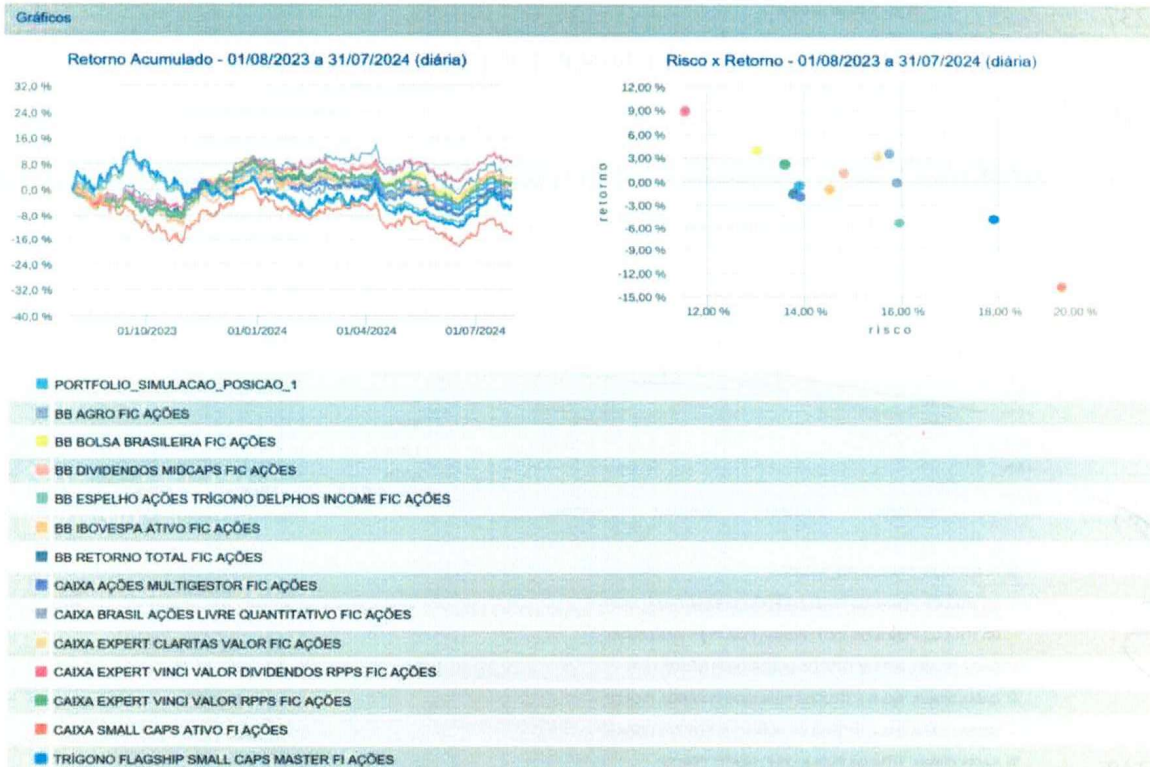
241
242

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



243
244
245

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



246

Handwritten signatures and initials at the bottom of the page, including a large signature on the left and several initials on the right.



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



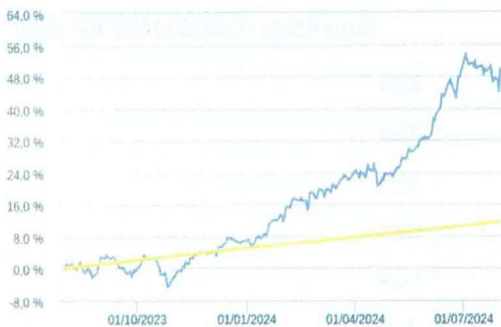
247

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

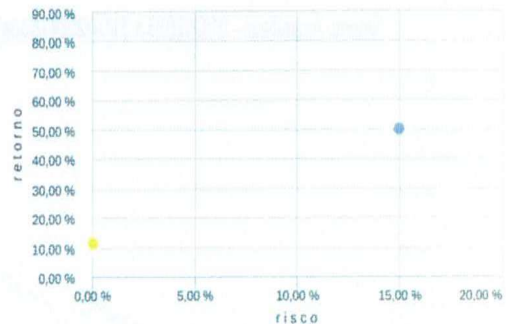
248

Gráficos

Retorno Acumulado - 01/08/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 01/08/2023 a 31/07/2024 (diária)



- PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
- CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I
- CDI

249

250

251

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

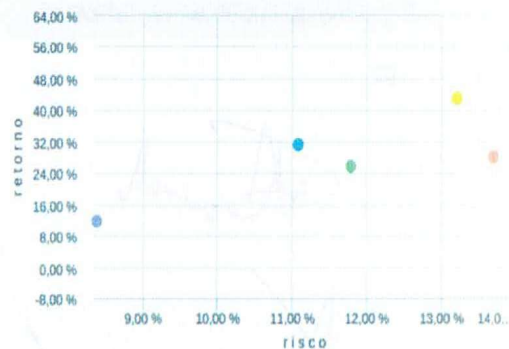
252

Gráficos

Retorno Acumulado - 01/08/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 01/08/2023 a 31/07/2024 (diária)



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

253

254

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]



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

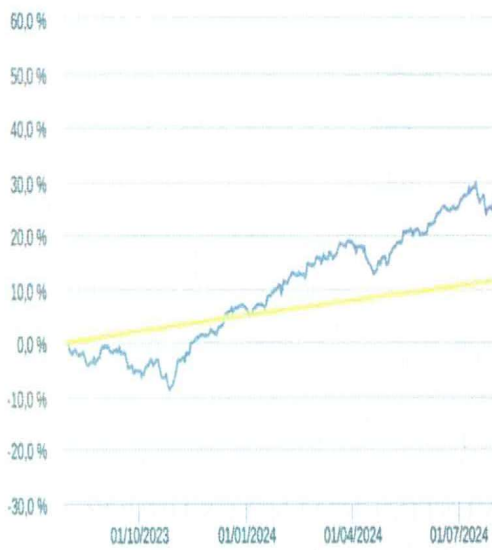


255
256

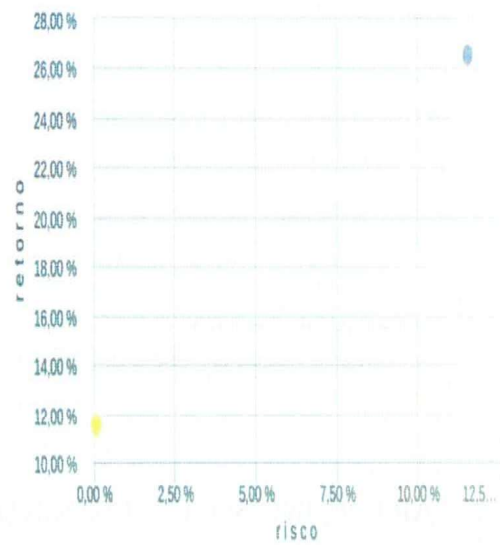
ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO

Gráficos

Retorno Acumulado - 01/08/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 01/08/2023 a 31/07/2024 (diária)



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1

CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP

CDI

257
258
259
260
261
262
263



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



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

265

ANÁLISE COMPARATIVA DE FUNDOS

Fundo de Investimento	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	VaR 21 du 95%
CDI	0,90%	6,17%	2,55%	5,15%	11,60%	26,65%	
BB REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	0,90%	6,15%	2,53%	5,13%	11,45%	26,55%	0,03%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,91%	5,96%	2,50%	4,96%	11,19%	26,25%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,97%	6,26%	2,61%	5,24%	11,60%	26,75%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	0,81%	5,56%	2,29%	4,64%	10,40%	24,17%	0,03%
BB RF ATIVA PLUS LP FIC DE FI	0,06%	7,54%	2,17%	6,02%	10,70%	23,22%	0,32%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,97%	6,38%	2,65%	5,33%	12,00%	27,35%	0,03%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,81%	5,55%	2,28%	4,63%	10,40%	23,40%	0,03%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	-1,05%	-2,41%	0,08%	-3,11%	200,72%	165,32%	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	1,37%	18,30%	10,67%	16,34%	26,54%	52,86%	1,39%
IMA-B 5	0,91%	4,26%	2,37%	3,56%	8,16%	20,37%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	0,89%	4,12%	2,31%	3,44%	7,90%	19,88%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,89%	4,13%	2,31%	3,44%	7,93%	20,02%	0,11%
IMA-B	2,09%	0,97%	2,45%	1,42%	4,38%	20,51%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	2,07%	0,82%	2,37%	1,29%	4,17%	20,10%	0,32%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,97%	3,78%	3,05%	2,65%	5,36%	9,12%	0,01%
IMA-B 5+	3,23%	-1,96%	-2,52%	-0,50%	1,02%	20,59%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	3,19%	-2,17%	2,45%	-0,67%	0,71%	19,74%	0,54%
CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ LP	3,19%	-2,04%	2,45%	-0,59%	0,99%	20,02%	0,53%
IPCA + 5%	0,83%	5,84%	2,27%	4,99%	9,73%	19,73%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,97%	6,75%	3,05%	5,58%	11,25%	22,27%	0,01%
IBOVESPA	3,02%	-4,86%	0,41%	0,64%	5,28%	24,87%	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	4,24%	-8,25%	0,69%	-3,01%	-1,07%	15,41%	0,98%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	2,95%	-5,26%	1,18%	-0,44%	3,96%	22,11%	0,93%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	0,02%	-5,63%	1,79%	-0,49%	-0,10%	7,80%	1,53%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	3,36%	-9,70%	1,34%	-4,77%	-1,56%	4,68%	0,91%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	1,89%	-4,06%	0,14%	-2,36%	1,05%	25,88%	1,40%
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR	3,15%	-5,93%	0,59%	-1,88%	2,09%	15,93%	0,92%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	3,82%	-2,02%	1,90%	1,22%	3,17%	17,37%	1,20%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	2,84%	-6,80%	1,03%	-2,77%	-1,94%	10,97%	1,13%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	0,70%	-6,20%	-1,74%	-3,57%	-3,57%	22,45%	1,59%
IDIV	1,89%	-1,57%	0,99%	1,47%	11,46%	32,36%	
CAIXA AÇÕES EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS	2,96%	-0,53%	3,22%	2,62%	8,78%	27,49%	0,87%
BB AÇÕES TRÍGONO DELPHOS INCOME FIA	1,51%	-9,08%	0,29%	-2,57%	-5,51%	0,00%	1,70%
SMLL	1,49%	-13,56%	-3,96%	-7,38%	-13,30%	1,65%	
BB AÇÕES TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS	3,23%	-8,27%	1,85%	-0,77%			1,62%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1,44%	-13,89%	-2,41%	-7,81%	-13,85%	0,43%	1,76%
BDRX	0,29%	41,47%	21,39%	35,02%	51,99%	65,02%	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,50%	40,22%	20,98%	34,10%	49,77%	60,78%	2,20%
MSCI WORLD	1,70%	12,70%	7,52%	10,34%	16,80%	33,51%	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	-0,02%	31,44%	15,31%	26,16%	43,29%	53,47%	1,51%
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE IE	2,24%	24,94%	13,31%	25,88%	28,13%	24,36%	1,48%
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE	2,65%	6,50%	5,46%	3,65%	11,69%	28,46%	0,61%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	5,11%	20,35%	13,14%	16,59%	25,70%	22,39%	1,48%
MSCI ACWI	1,51%	11,99%	7,05%	10,37%	15,40%	30,75%	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	1,03%	12,55%	7,86%	11,73%	15,86%	30,62%	1,38%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,39%	15,25%	9,02%	11,90%	20,12%	35,61%	
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,49%	29,53%	16,07%	24,15%	38,62%	45,09%	2,24%
S&P 500	1,13%	15,78%	9,05%	12,13%	20,52%	37,25%	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1,45%	17,93%	10,76%	15,99%	25,13%	45,13%	1,38%

266



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



267 RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

268

269 RENTABILIDADE

270

271 A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 1,01% no mês de julho,
272 totalizando um saldo de R\$ 243.845.812,54 (duzentos e quarenta e três milhões e oitocentos e
273 quarenta e cinco mil e oitocentos e doze reais e cinquenta e quatro centavos).

274

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

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

Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub		54,25%	100,00%	50,00%	100,00%	100,00%	R\$132.291.007,04
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	IRF-M 1	28,84%	100,00%	50,00%	100,00%	0,86%	R\$70.333.707,67
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	0,09%	100,00%	50,00%	100,00%	0,00%	R\$227.670,93
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2A	10,36%	100,00%	50,00%	100,00%	0,47%	R\$25.257.976,66
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	7,94%	100,00%	50,00%	100,00%	0,39%	R\$19.368.234,89
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	IRF-M	7,01%	100,00%	50,00%	100,00%	0,46%	R\$17.103.416,89
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		33,64%	65,00%	65,00%	20,00%	15,00%	R\$82.036.026,28
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COT	CDI	5,71%	65,00%	65,00%	20,00%	0,08%	R\$13.926.815,50
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	CDI	0,15%	65,00%	65,00%	20,00%	0,01%	R\$375.531,58
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$1.476,60
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	27,78%	65,00%	65,00%	20,00%	1,04%	R\$67.732.202,60
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		12,11%	10,00%	10,00%	20,00%	15,00%	R\$29.518.779,22
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,11%	10,00%	10,00%	20,00%	2,34%	R\$29.518.779,22
Total:							R\$243.845.812,54

276

277

278 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

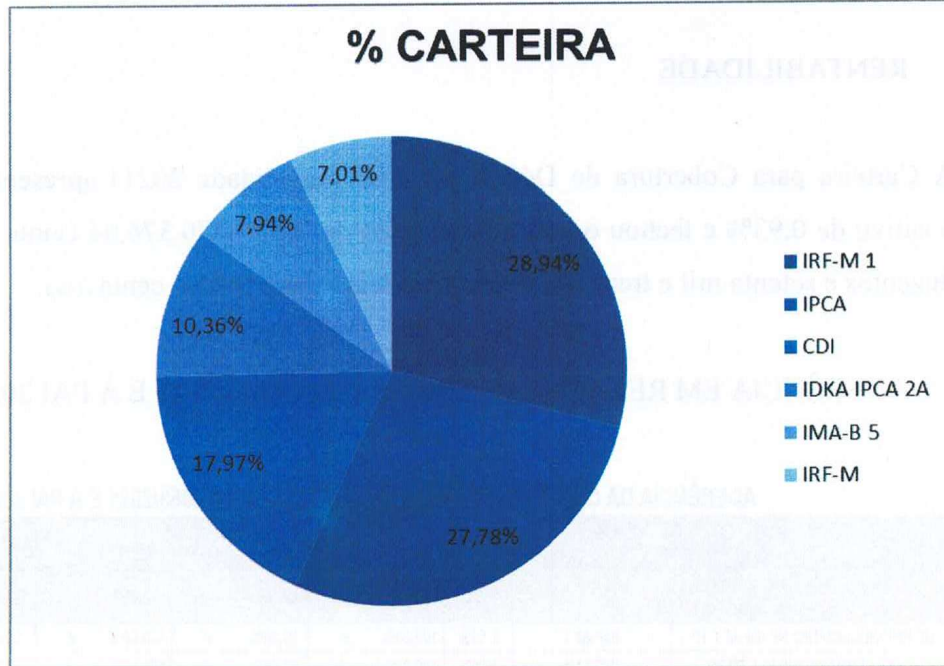
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IRF-M 1	R\$70.561.378,60	28,94%
IPCA	R\$67.732.202,60	27,78%
CDI	R\$43.822.602,90	17,97%
IDKA IPCA 2A	R\$25.257.976,66	10,36%
IMA-B 5	R\$19.368.234,89	7,94%
IRF-M	R\$17.103.416,89	7,01%
	R\$243.845.812,54	100,00%

279



280



281

282

283 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

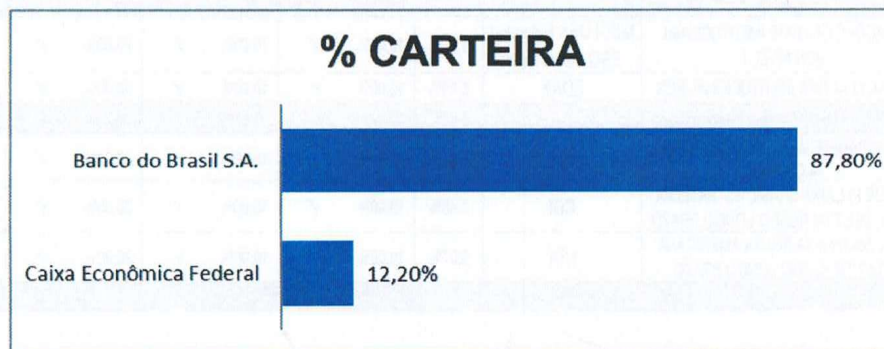
284

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$29.747.926,75	12,20%
Banco do Brasil S.A.	R\$214.097.885,79	87,80%

285

286



287



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



288 RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

289

290 RENTABILIDADE

291

292 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado
293 positivo de 0,93% e fechou o mês com o saldo de R\$ 29.270.376,04 (vinte e nove milhões e
294 duzentos e setenta mil e trezentos e setenta e seis reais e quatro centavos).

295

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

297

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

Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		58,82%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$17.218.132,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	6,54%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,02% ✓	R\$1.913.355,92
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	6,70%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,02% ✓	R\$1.962.061,36
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	15,27%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,10% ✓	R\$4.470.117,29
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	15,35%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,09% ✓	R\$4.494.173,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	14,96%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,09% ✓	R\$4.378.424,60
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		15,55%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$4.550.299,83
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,55%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,07% ✓	R\$4.550.299,83
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		6,73%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$1.971.347,88
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	IBOVESPA	1,54%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	0,06% ✓	R\$451.119,93
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,14%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	0,05% ✓	R\$334.247,93
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,72%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	0,08% ✓	R\$503.901,98
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,33%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	0,07% ✓	R\$389.077,99
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,00%	35,00% ✓	25,00% ✓	20,00% ✓	0,05% ✓	R\$293.000,05
Art. 8º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		10,79%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$3.159.215,76
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	5,20%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	0,10% ✓	R\$1.523.284,95
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	5,59%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	0,06% ✓	R\$1.635.930,81
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		8,10%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$2.371.380,37
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	2,54%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	0,71% ✓	R\$742.729,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,49%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	0,36% ✓	R\$728.955,37
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	3,07%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	0,05% ✓	R\$899.695,47
Total:							R\$29.270.376,04

298

299



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



300 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

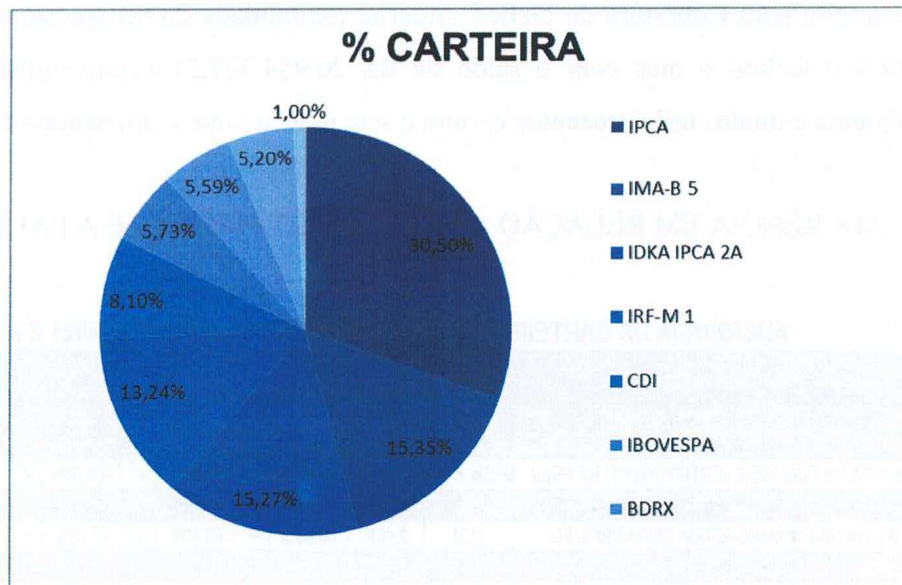
301

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IPCA	R\$8.928.724,43	30,50%
IMA-B 5	R\$4.494.173,03	15,35%
IDKA IPCA 2A	R\$4.470.117,29	15,27%
IRF-M 1	R\$3.875.417,28	13,24%
CDI	R\$2.371.380,37	8,10%
IBOVESPA	R\$1.678.347,83	5,73%
BDRX	R\$1.635.930,81	5,59%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.523.284,95	5,20%
SMLL	R\$293.000,05	1,00%
	R\$29.270.376,04	100,00%

302

303



304

305

306 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

307

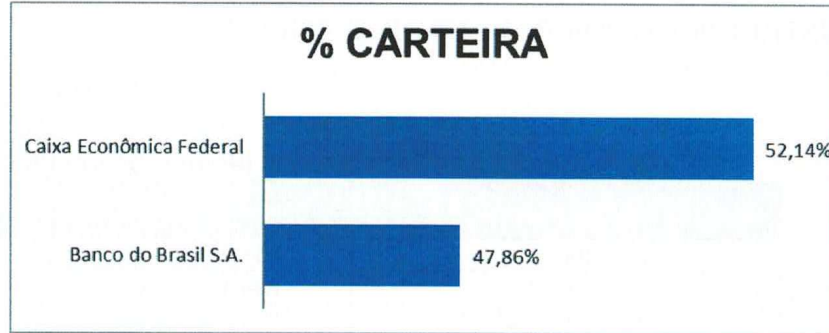
DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$14.009.211,12	47,86%
Caixa Econômica Federal	R\$15.261.164,92	52,14%

308



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



309

310

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

312

313 **RENTABILIDADE**

314

315 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de
316 0,98% e fechou o mês com o saldo de R\$ 20.954.327,21 (vinte milhões e novecentos e
317 cinquenta e quatro mil e trezentos e vinte e sete reais e vinte e um centavos).

318

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

320

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\$20.350.538,66
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA + 5%	97,12%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	0,57% ✓	R\$20.350.538,66
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$603.788,55
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	2,88%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$603.788,55
Total:							R\$20.954.327,21

321

322

323 **DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

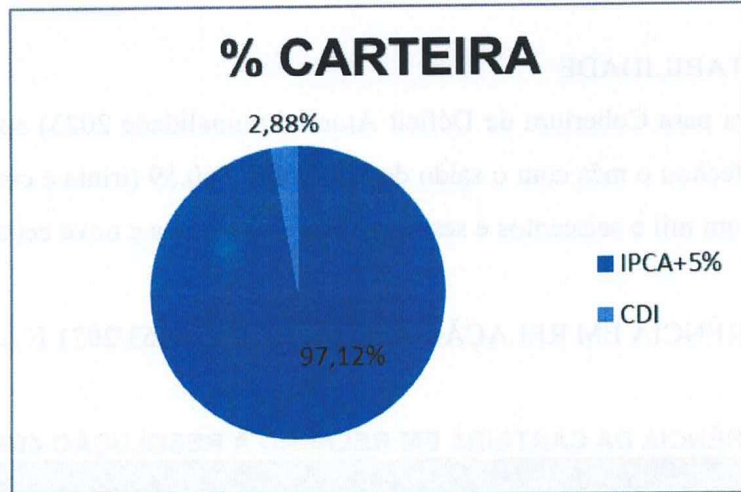
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IPCA+5%	R\$20.350.538,66	97,12%
CDI	R\$603.788,55	2,88%
	R\$20.954.327,21	100,00%

324



325



326

327

328 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

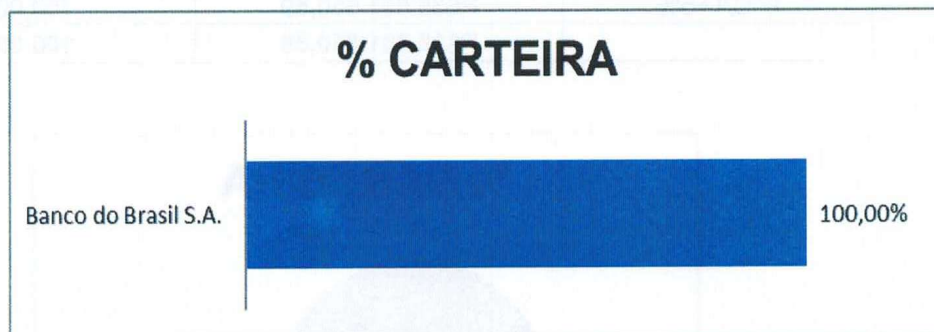
329

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$20.954.327,21	100,00%

330

331



332

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



333 RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2023

334

335 RENTABILIDADE

336 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) apresentou um resultado de
337 0,98% e fechou o mês com o saldo de R\$ 35.681.660,59 (trinta e cinco milhões e seiscentos e
338 oitenta e um mil e seiscentos e sessenta reais e cinquenta e nove centavos).

339

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

341

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\$35.681.660,59
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RF PREV	IPCA+5%	100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	1,01% ✓	R\$35.681.660,59
Total:							R\$35.681.660,59

342

343

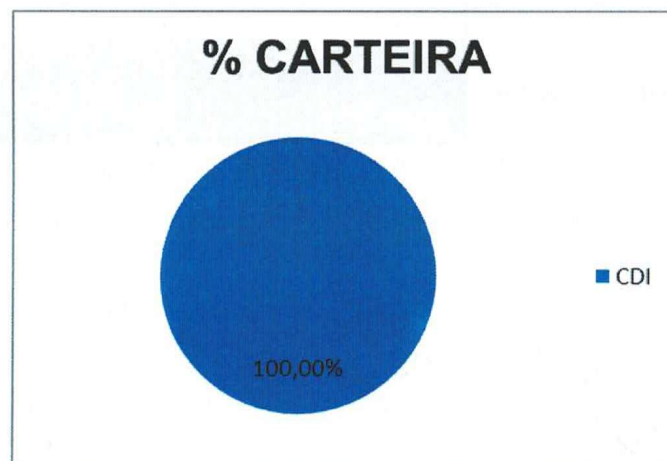
344 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
IPCA+5%	R\$35.681.660,59	100,00%
	R\$35.681.660,59	100,00%

345

346



347



348 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

349

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$35.681.660,59	100%

350

351



352

353

RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2024

355

RENTABILIDADE

357

358 A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2024) apresentou um resultado de
359 0,97% e fechou o mês com o saldo de R\$ 41.333.362,81 (quarenta e um milhões e trezentos e
360 trinta e três mil e trezentos e sessenta e dois reais e oitenta e um centavos).

361

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

363

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

Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2024	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		100,00%	100,00% ✓	50,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$41.333.362,81
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	100,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,24% ✓	R\$41.333.362,81
Total:							R\$41.333.362,81

364

365



366 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

367

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA		
Indicador	Saldo em 31/07/2024	Participação
CDI	R\$41.333.362,81	100,00%
	R\$41.333.362,81	100,00%

368

369



370

371

372 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

373

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$41.333.362,81	100%

374

375



376



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



377 CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES
378 TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE
379 INVESTIMENTOS
380

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%

381



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



382 CUSTO SELIC PARA OS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

383

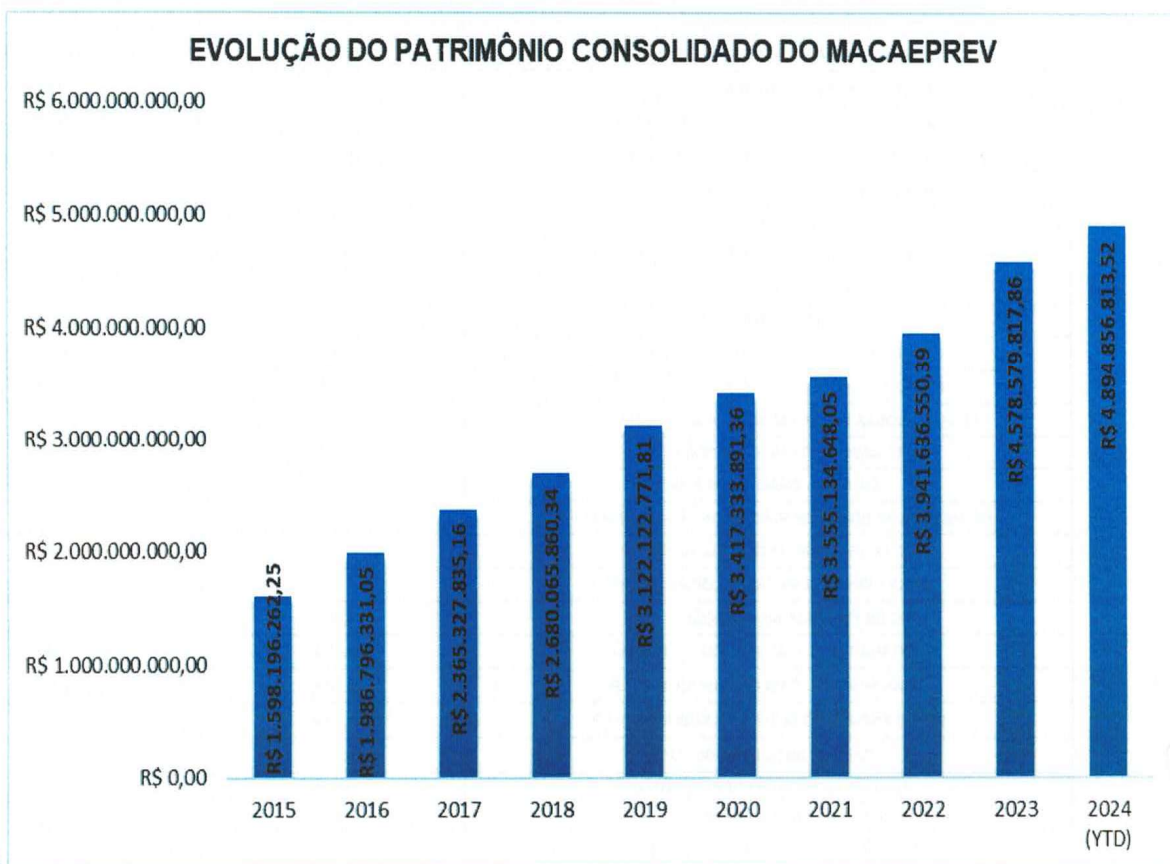
CUSTOS SELIC		
Ativos	Patrimônio (R\$)	SELIC
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	R\$ 2.404.663.186,67	R\$ 5.736,99

384

385 **CONCLUSÃO:** O Macaeprev encerrou o mês de julho de 2024 com o Patrimônio
386 Consolidado de R\$ 4.894.856.813,52 (quatro bilhões e oitocentos e noventa e quatro milhões
387 e oitocentos e cinquenta e seis mil e oitocentos e treze reais e cinquenta e dois centavos). O
388 gráfico a seguir apresenta a evolução patrimonial do Macaeprev a cada final de exercício.

389

390



391

392



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



393 **II – APROVAÇÃO DO RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS JULHO DE 2024:** Após a
394 apresentação do relatório, por unanimidade, os membros do Comitê de Investimentos
395 aprovaram o Relatórios de Investimentos referente ao mês de julho de 2024, o qual o termo
396 segue anexo a esta ata. **III - CARTEIRA PARA COBERTURA DE DÉFICIT**
397 **ATUARIAL (ANUALIDADE 2023):** Pelo membro *Erenildo*, nas reuniões dos dias 21/08
398 (Comitê de Investimentos) e 22/08 (Conselho Previdenciário), foi sugerido que os recursos da
399 Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2023) fossem investidos no fundo BB
400 Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos Vértice 2028, CNPJ: 49.963.751/0001-00. No
401 entanto, a taxa de administração do fundo informada pelo banco estava incorreta. Ao invés de
402 0,07% ao ano, a taxa correta é de 0,15% ao ano. Dessa forma, o membro *Erenildo* sugeriu
403 que os recursos fossem aplicados no fundo BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos
404 Vértice 2027, CNPJ: 55.746.782/0001-02, pois este estava com a taxa de administração de
405 0,07% ao ano, o que seria mais vantajoso. A sugestão foi aprovada por unanimidade pelos
406 membros do Comitê de Investimentos e do Conselho Previdenciário. **IV – CONVITE**
407 **APRESENTAÇÃO RELATÓRIO DE GOVERNANÇA COPORTARIA 2021 – PRÓ-**
408 **GESTÃO:** Pelo membro *Erenildo* foi convidado a todos os membros deste Comitê para a
409 Audiência Pública para apresentação do Relatório de Governança Corporativa de 2021 para
410 cumprimento do nosso PRÓ-GESTÃO que será realizada de forma online no dia 30/08/2024
411 as 15:00 através de link que foi distribuído anteriormente. Gostaria de contar com a presença
412 de todos. **X - ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às
413 dezoito horas e quinze minutos, tendo a ata sido lida e assinada por todos os presentes.

414 COMITÊ DE INVESTIMENTOS:

415 
416
417 Alfredo Tanos Filho

418 
419 Erenildo Motta da Silva Júnior

420
421 
422 José Eduardo da Silva Guinâncio

423 
Patric Alves de Vasconcellos


Claudio de Freitas Duarte


Fábio de Carvalho de Moraes Drumond


Miriam Amaral Queiroz


Viviane da Silva Lourenço Campos



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

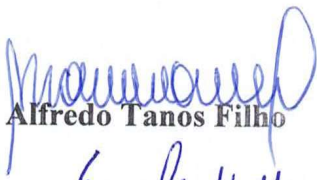
Aos vinte e nove dias do mês de agosto de 2024, o Comitê de Investimentos, ordinariamente, reuniu-se via plataforma de reunião *Google Hangouts Meet*, para apresentação e análise dos investimentos, acompanhamento de rentabilidade, dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS, da aderência das alocações, processos decisórios de investimentos e políticas de investimentos referentes ao mês de **julho** de 2024;

Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos que segue na íntegra na ata do dia de hoje: **29 de agosto de 2024**.

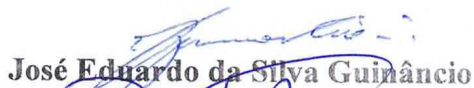
Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de **julho de 2024**, e que foram devidamente fundamentadas e registradas nas atas de reunião do Comitê.

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 **JULHO 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