



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

ATA nº 23 - CONSELHO PREVIDENCIÁRIO de 13/06/2024 Ata de Reunião extraordinária do Conselho Previdenciário do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé, situado à Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro nº 293, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, realizada aos treze dias do mês de junho do ano de 2024, através do aplicativo Zoom, no horário de 17 horas. Presentes todos os membros, a reunião teve início com o gestor de investimentos informando ao Conselho que as NTNs-B 2025, 2027, 2045 e 2055 efetuaram pagamento de cupom semestral de juros no dia 15 de maio de 2024, sendo o seguinte valor: **R\$ 35.025.745,90** (trinta e cinco milhões e vinte e cinco mil e setecentos e quarenta e cinco reais e noventa centavos). Informou, ainda, que, considerando o item 5.2. – **Limites e Alçadas** da Política Anual de Investimentos (PAI) para o ano 2024, que autoriza o Presidente, o Diretor Financeiro e o Gestor de Recursos do Macaeprev a realizarem a compra direta de Títulos Públicos Federais de acordo com o resultado de *Cash Flow Matching* do Estudo de *Asset Liability Management* (ALM). Ainda de acordo com a PAI 2024, o objetivo é realizar as compras de Títulos Públicos Federais com as taxas indicativas acima do IPCA + 5,50%.

RECURSOS	TIPO DE INVESTIMENTO AUTORIZADO	LIMITE
Saldo disponível das contribuições previdenciárias recebidas mensalmente	Aplicações em fundos de investimentos onde o Macaeprev já possui recursos investidos	Valor total dos recursos recebidos
Realocações entre fundos de investimentos	Aplicações em fundos de investimentos onde o Macaeprev já possui recursos investidos	Até 2% do total dos recursos do Macaeprev no último dia útil do mês anterior à operação
Realocações para Títulos Públicos Federais	Compra Direta de Títulos Públicos Federais	De acordo com o resultado de <i>Cash Flow Matching</i> do Estudo de ALM

Fonte: Política Anual de Investimentos 2024 – Macaeprev

	RESULTADO DO CASH FLOW MATCHING									
	MÉDIO PRAZO				LONGO PRAZO					
	até 2024	até 2025	até 2026	até 2027	até 2035	até 2040	até 2045	até 2050	até 2055	até 2060
VALOR ALOCADOS EM NTN'S CURVA	R\$ 1.029.520,53	R\$ 224.821.847,75	R\$ 101.695.654,75	R\$ 98.669.098,95	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 34.757.766,14	R\$ 188.866.291,61	R\$ 133.961.869,66	R\$ 87.059.320,47
VALOR ALOCADOS EM FUNDOS VERTICE COM CARENÇIA	R\$ 500.792.179,86									
SALDO PJ ALONGAMENTO CEN PÓS-CRISE					R\$ 0,00	R\$ 590.000.000,00	R\$ 500.000.000,00	R\$ 160.000.000,00	R\$ 50.000.000,00	R\$ 0,00
SALDO PJ ALONGAMENTO CEN PRÉ-CRISE					R\$ 275.200.000,00	R\$ 750.000.000,00	R\$ 460.000.000,00	R\$ 170.000.000,00	R\$ 100.000.000,00	R\$ 0,00
SALDO PJ ALONGAMENTO CEN HÍBRIDO					R\$ 0,00	R\$ 590.000.000,00	R\$ 500.000.000,00	R\$ 160.000.000,00	R\$ 50.000.000,00	R\$ 0,00

Observação: eventual alongamento ocorrido após 2023, na carteira do MACAEPREV, deverá ser descontado dos valores indicados para alocação.

Fonte: Estudo de Asset Liability Management - Macaeprev

Handwritten signatures and initials are present at the bottom of the page, including a large signature in the center and several smaller ones around it.

Handwritten scribble or signature.



