

# RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL  
DO MUNICÍPIO DE MACAÉ  
MACAEPREV**



# JUNHO - 2022



## SUMÁRIO

<b>1. INTRODUÇÃO</b> .....	<b>3</b>
<b>2. CENÁRIO ECONÔMICO</b> .....	<b>3</b>
<b>3. RESULTADO DA CARTEIRA</b> .....	<b>7</b>
<b>4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA</b> .....	<b>12</b>
4.1. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022 .....	12
4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA .....	13
4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA .....	14
<b>5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES</b> .....	<b>15</b>
<b>6. MONITORAMENTO DE RISCOS</b> .....	<b>15</b>
6.1. ART. 7º, INCISO I, “B” – FUNDOS DE RENDA FIXA 100% EM TP .....	15
6.2. ART. 7º, INCISO III, “A” – FUNDOS DE RENDA FIXA CVM .....	16
6.3. ART. 8º, INCISO I – FUNDOS DE AÇÕES .....	16
6.4. ART. 9º, INCISO II – FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR .....	17
6.5. ART. 9º, INCISO III – FUNDOS DE AÇÕES – BDR NÍVEL I.....	17
6.6. ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO.....	18
<b>7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b> .....	<b>18</b>
7.1. RENTABILIDADE .....	18
7.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA .....	19
7.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA .....	20
<b>8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021</b> .....	<b>20</b>
8.1. RENTABILIDADE .....	20
8.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA .....	21
8.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA .....	22
<b>9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022</b> .....	<b>22</b>
9.1. RENTABILIDADE .....	22
9.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA .....	23
9.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA .....	23
<b>10. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES</b> .....	<b>24</b>
10.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS .....	24
<b>11. CONCLUSÃO</b> .....	<b>25</b>



## 1. INTRODUÇÃO

Mantendo elevados níveis de transparência e para manter boa comunicação junto aos servidores e munícipes, o Instituto de Previdência Social do Município de Macaé – Macaeprev apresenta o relatório de investimentos, referente ao mês de junho de 2022.

Neste relatório é possível observar a consolidação de todas as informações relativas ao período de referência, incluindo o cenário econômico, os resultados alcançados em relação às metas estabelecidas, o comportamento dos ativos financeiros que compõe a carteira de investimentos do Macaeprev, inclusive quanto aos indicadores de desempenho e gerenciamento de riscos.

## 2. CENÁRIO ECONÔMICO

Chegamos ao final do primeiro semestre do ano com junho marcado por uma alta volatilidade nos mercados internacionais e local, em meio aos receios sobre uma possível recessão econômica na Europa e nos Estados Unidos, por conta dos altos índices de inflação e do tom mais duro dos bancos centrais, que abandonaram o discurso inicial de que o aumento geral de preços era um movimento transitório para um cenário de inflação estrutural e persistente.

Na China, o índice de confiança chinês mostrou melhora, fechando em 54,1% (território expansionista) após o encerramento dos *lockdowns*, uma das medidas de restrição com relação à Covid-19. Os dados sugerem que o início de uma recuperação pós-bloqueio começou em parte da economia chinesa, sendo provável que se acelere. Mas vale ressaltar que o setor industrial chinês ainda possui bastante atraso, o que sugere um problema maior de oferta de produto global.

O Escritório Nacional de Estatísticas divulgou dados sobre a economia da China de junho, mostrando que o índice nacional de preços ao consumidor (IPC) aumentou 2,5% em relação ao ano anterior, e o índice nacional de preços ao produtor (PPI) aumentou em 6,1%. Na média, de janeiro a junho, IPC e PPI aumentaram 1,7% e 7,7% respectivamente, mantendo a tendência de estabilidade. Especialistas acreditam que os preços da China têm mantido uma operação estável, em um cenário em que os preços internacionais das commodities continuam



em níveis elevados, e outras grandes economias ao redor do mundo enfrentam maiores pressões inflacionárias.

Nos EUA, a decisão de política monetária foi um dos principais destaques de junho. O FOMC optou por promover uma elevação dos juros maior do que vinha sendo sinalizada anteriormente, elevando a taxa básica em 0,75%, para o intervalo entre 1,50% e 1,75%, o maior aumento desde 1994. A instituição ainda revelou que deverá continuar o ciclo de aperto monetário ao longo do ano e anunciou uma revisão altista para a taxa de inflação de 2022, em 5,2% a.a., e baixista para o PIB norte-americano, com projeção de crescimento de 1,7% a.a. A aceleração no ritmo de alta de juros se deu em função da inflação maior que a esperada e da piora nas expectativas, inclusive para prazos mais longos.

Já a redução do balanço de ativos (“*quantitative tightening*”) foi mantida em um teto de US\$ 47,5 bilhões, sendo US\$ 30 bilhões em *Treasuries* e US\$ 17,5 bilhões em títulos imobiliários, com expectativa de passar para o dobro desses valores em setembro.

Os dados de atividade referentes ao mês de maio (divulgados em junho) trouxeram resultados mistos. A produção industrial mostrou desaceleração, passando de 1,4% M/M para 0,2%. Já as vendas do varejo mostraram uma retração de 0,3% M/M em maio impactada pela inflação elevada e pela migração do consumo de bens para serviços.

A criação de vagas de trabalho nos Estados Unidos em junho ficou acima do esperado e a taxa de desemprego permaneceu perto da mínima pré-pandemia, em sinais de força persistente no mercado de trabalho, que dão ao Federal Reserve (Fed, o banco-central norte-americano) munição para outro aumento de 0,75 ponto percentual da taxa de juros em julho. A economia dos EUA abriu 372.000 vagas de trabalho fora do setor agrícola no mês, mostrou o relatório de emprego do Departamento do Trabalho. Os dados de maio foram revisados ligeiramente para baixo para mostrar abertura de 384.000 postos de trabalho em vez dos 390.000 informados anteriormente.

A Zona do Euro, em função do conflito entre Rússia e Ucrânia, tem sido afetada pelos elevados custos de energia, o que pressiona a inflação e limita o consumo real das famílias. A inflação no mês de maio ficou em 8,1% em 12 meses, ante 7,4% no mês anterior. A aceleração se deu em função da alta nos preços de energia, de 37,5% para 39,1% em 12 meses. Os preços de alimentos também aceleraram, porém para um patamar menos pressionado.



**Estado do Rio de Janeiro**  
**Município de Macaé**  
**Instituto de Previdência Social**



O volume de vendas do varejista caiu 1,3% (M/M) em abril (divulgado em junho). A produção industrial na Zona do Euro cresceu 0,4% (M/M) no mês de abril. Quando comparado ao dado de abril de 2021, o resultado registrou queda de 2,0%. Acerca do mercado de trabalho, a taxa de desemprego se manteve estável em 6,8% no mês de abril em comparação a março, vindo em linha com as expectativas de mercado. Já o número de pessoas desempregadas caiu em relação ao mês anterior.

Apesar do Banco Central Europeu manter inalterada a taxa básica juros na reunião de maio, já sinalizou que começará a elevar gradualmente os juros da Zona do Euro, principalmente após a divulgação dos dados de inflação, que surpreendeu as previsões do mercado, fechando em 8,6% ante uma expectativa de 8,4%. Problemas de oferta, forte crescimento ao longo do primeiro semestre, além do conflito em Rússia e Ucrânia, foram fatores determinantes para a elevação do índice.

De acordo com Ministros das Finanças da região, o combate à inflação é a prioridade econômica atual da Zona do Euro, após serem informados sobre uma deterioração das perspectivas econômicas da Comissão Europeia. O comissário de Economia da UE, Paolo Gentiloni, alertou que os riscos para a economia do bloco têm aumentado uma vez que a Rússia pode cortar seu fornecimento de gás para a Europa. Ele acrescentou que Bruxelas pode adotar uma série de medidas, que incluem imposição de tetos para os preços, de forma a reduzir a pressão inflacionária das importações de gás, embora nenhuma decisão tenha sido tomada sobre a questão.

Aqui no Brasil também tivemos decisão sobre política monetária, em que o Banco Central por mais um encontro (amplamente dentro da expectativa) fez aumento da taxa básica de juros em 0,5 p.p., passando a taxa para 13,25% ao ano. Segundo informações do comunicado e da ata, o ciclo de aperto monetário (que já conta com 11 altas) ainda não acabou, porém, parece estar mais próximo do fim.

Os indicadores de atividade divulgados em junho, referentes a períodos anteriores, apresentaram os seguintes resultados: A “produção industrial” de abril avançou 0,1% (M/M), com variações positivas bem disseminadas. Na indústria geral, destaque para a indústria extrativa (0,4%). Entre as categorias econômicas, destaque para Bens de Consumo Semi e Não-Duráveis (2,3%) e Bens Intermediários (0,8%, M/M). No “varejo restrito” houve alta de 0,9% (M/M) em abril, o que representou a 4ª alta seguida. As maiores contribuições vieram de Móveis e Eletrodomésticos (2,3%) e Vestuário (1,7%). No ampliado, que inclui veículos e



**Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social**



material para construção civil, o varejo avançou 0,7% (M/M). O setor de “serviços” cresceu 0,2% (M/M) em abril, influenciado por Serviços ligados ao turismo (2,5%) e os prestados às famílias (1,9%).

Dados divulgados pela Secretaria de Comércio Exterior (Secex) do Ministério da Economia indicam que, até a terceira semana de junho, a balança comercial brasileira registrou superávit de US\$ 32,19 bilhões no acumulado do ano, com uma queda de 6,9% em relação ao período de janeiro a junho do ano passado, pela média diária. A corrente de comércio – soma de exportações e importações – subiu 22,8% na mesma comparação, atingindo US\$ 270,32 bilhões. As exportações em 2022 somaram US\$ 151,26 bilhões no período, com aumento de 18,8% (pelo critério de médias diárias sobre igual período de 2021). As importações atingiram US\$ 119,06 bilhões, com alta de 28,4%. O resultado da balança nas três primeiras semanas de junho indica alta de 13,6% no superávit do mês em relação à média diária de junho de 2021, atingindo um total de US\$ 6,76 bilhões. A corrente de comércio aumentou 25,2%, alcançando US\$ 32,98 bilhões no mês, refletindo o crescimento de 23,1% das exportações, que somaram US\$ 19,87 bilhões, e de 28,6% das importações, que totalizaram US\$ 13,11 bilhões. Apenas na terceira semana de junho, a balança comercial teve um saldo positivo de US\$ 3,34 bilhões e corrente de comércio de US\$ 11,72 bilhões, resultado de exportações de US\$ 7,53 bilhões e importações de US\$ 4,19 bilhões.

O percentual de famílias brasileiras com dívidas caiu em junho, pelo segundo mês seguido, segundo levantamento divulgado pela Confederação Nacional do Comércio de Bens, Serviços e Turismo (CNC). Apesar do recuo, 77,3% das famílias ainda têm dívidas – 7,6% acima do mesmo mês de 2021. A pesquisa apontou que a inadimplência também teve uma leve queda de 0,2 ponto percentual – a primeira desde setembro de 2021, chegando a 28,5% das famílias. Houve queda, ainda, entre os que dizem que não terão condições de pagar as contas atrasadas, para 1,6%, segundo a CNC.

Acerca do mercado de trabalho, a PNAD Contínua (IBGE) apontou que a taxa de desemprego de maio recuou de 10,5% para 9,8%.

No fim do mês de junho foi aprovada a Lei Complementar 194/2022, que tem efeito prático de limitar a cobrança de Imposto sobre Circulação de Mercadorias e Serviços (ICMS) por parte dos estados entre 17% e 18% em combustíveis e energia. Além disso, foi aprovada no Senado a chamada PEC dos benefícios sociais, com um impacto fiscal estimado em R\$ 41,25 bilhões fora do teto de gastos, que serão liberados por meio de créditos extraordinários



à medida que o texto prevê a decretação de estado de emergência no país ao longo do ano de 2022.

Com a aprovação de medidas que flexibilizam o teto de gastos, o mercado demonstrou preocupação com a deterioração da trajetória fiscal do país. Tal cenário, externo e interno, contribuiu para que o Índice Bovespa apresentasse o 3º pior desempenho dentre as bolsas do mundo recuando 11,50% em relação ao mês anterior, fechando aos 98.541 pontos. Como consequência, reverteu os ganhos anuais para uma queda de 5,99%.

O Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA), considerado a inflação oficial do país, foi de 0,67% em junho, ficando 0,20% acima da taxa de maio (0,47%). No ano, o IPCA acumula alta de 5,49% e, nos últimos 12 meses, de 11,89%, acima dos 11,73% observados nos 12 meses imediatamente anteriores. Em junho de 2021, a variação havia sido de 0,53%.

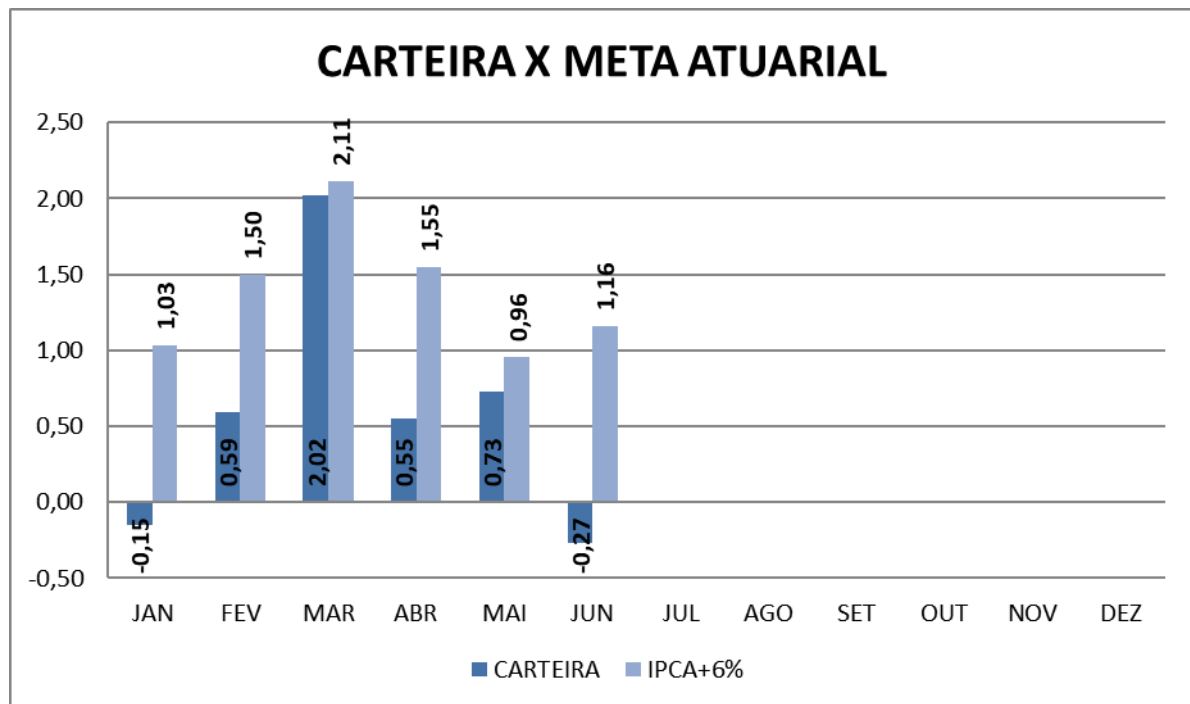
Todos os nove grupos de produtos e serviços pesquisados tiveram variação positiva em junho. A maior variação foi do grupo Vestuário, com alta de 1,67% e 0,07 p.p. de contribuição. Já o maior impacto (0,17 p.p.) veio de Alimentação e bebidas (0,80%). Na sequência, vieram Saúde e cuidados pessoais (1,24%) e Transportes (0,57%), com impactos de 0,15 p.p. e 0,13 p.p., respectivamente. O grupo Habitação, que havia registrado queda de 1,70% em maio, passou para alta de 0,41% em junho, com impacto de 0,06 p.p. Os demais grupos ficaram entre o 0,09% de Educação e o 0,55% de Artigos de residência.

### 3. RESULTADO DA CARTEIRA

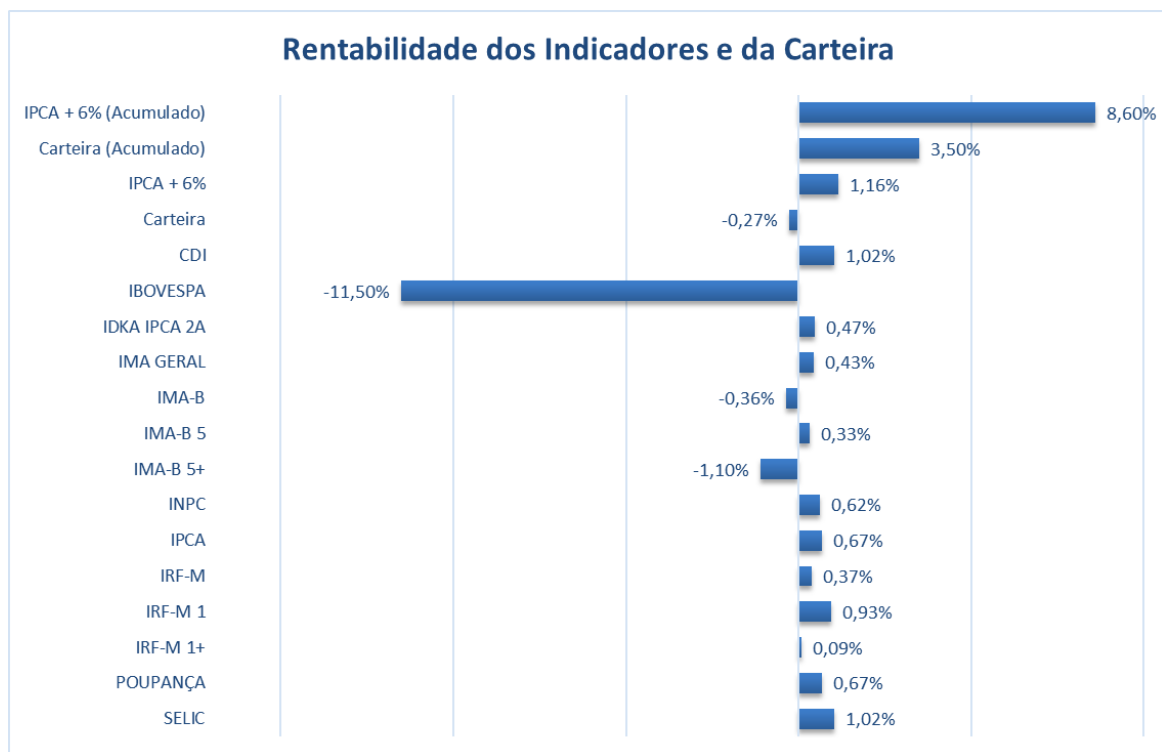
Em relação ao desempenho do nosso portfólio, junho foi um mês em que a Carteira teve um resultado negativo, marcando o pior resultado mensal do ano de 2022. A Carteira fechou o mês em queda de -0,27%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 6%, foi de 1,16%. Logo, a Carteira não conseguiu atingir a Meta Atuarial necessária. Nos quadros a seguir pode-se observar o desempenho da Carteira em 2022.

#### HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
CARTEIRA	-0,15	0,59	2,02	0,55	0,73	-0,27							3,50
IPCA+6%	1,03	1,50	2,11	1,55	0,96	1,16							8,60



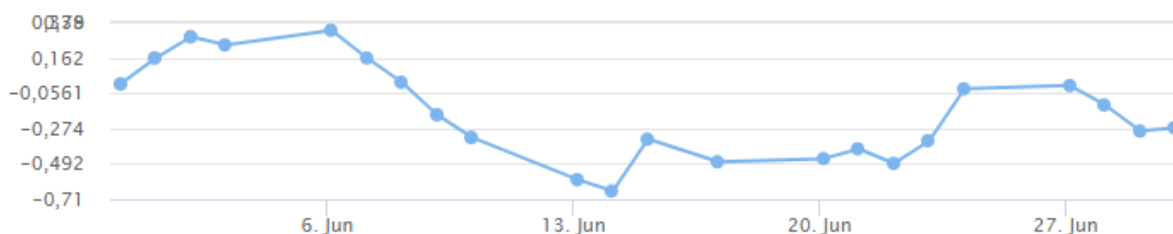
A seguir, apresento o quadro com o comportamento da Carteira, Meta Atuarial e diversos índices do mercado.







A imagem a seguir traz o comportamento da carteira ao longo do mês de junho.



A renda fixa segue como destaque positivo na carteira do Macaeprev, mas não foi o suficiente para apagar os resultados da forte baixa do seguimento de renda variável no Brasil, com o mercado precificando uma recessão global motivada pela elevação de juros das principais economias globais. Por fim, o segmento de investimentos no exterior teve resultados mistos, prejudicado pelos índices no exterior, mas beneficiado pela elevação do dólar frente ao real.

Apenas um fundo da carteira bateu a meta atuarial no mês de junho, o BB Multimercado Nordea IE que rendeu 2,70%. Em média, os fundos de investimento no exterior tiveram uma rentabilidade de 0,81%.

Os fundos de ações brasileiras tiveram uma forte queda, com rentabilidade média de -12,03%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno médio negativo de -7,61%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno negativo de -4,24%. Os fundos multimercado tiveram uma rentabilidade média de -0,53%.

O fundo de vértice Caixa FI Brasil 2022 I TP RF teve um retorno de 1,02%, o fundo Caixa FI Brasil 2023 TP RF rendeu 0,32%, o fundo BB Previdenciário RF TP IPCA FI rendeu 0,33%, enquanto o Caixa FI Brasil 2024 IV TP RF rendeu 0,22%.

Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 1,03%. O fundo de renda fixa com gestão ativa apresentou uma rentabilidade de 0,46%.

Os fundos IMA-B 5 tiveram um retorno de 0,33%. O fundo indexado ao IRF-M 1+ teve um retorno de 0,01%. O fundo IRF-M 1 teve um retorno de 0,89%. Enquanto os fundos IDKA 2A renderam 0,25%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade de 0,42%. Até 30/06/2022 foram resgatados o total de R\$ 8.710.810,98 (oito milhões e setecentos e dez mil e oitocentos e dez reais e noventa e oito centavos), cerca de 87% do total investido. Em junho, o fundo



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



apresentou resultado positivo de R\$ 7.229,42 (sete mil e duzentos e vinte e nove reais e quarenta e dois centavos). O saldo em 30 de junho estava em R\$ 1.711.674,18 (um milhão e setecentos e onze mil e seiscentos e setenta e quatro reais e dezoito 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, enquanto os fundos na cor vermelha apresentaram resultado negativo.



O rendimento de junho da Carteira do Instituto foi negativo em R\$ -9.466.889,96 (nove milhões e quatrocentos e sessenta e seis mil e oitocentos e oitenta e nove reais e noventa e seis centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de junho em R\$ 3.494.027.826,53 (três bilhões e quatrocentos e noventa e quatro milhões e vinte e sete mil e oitocentos e vinte e seis reais e cinquenta e três centavos).



**Estado do Rio de Janeiro**  
**Município de Macaé**  
**Instituto de Previdência Social**



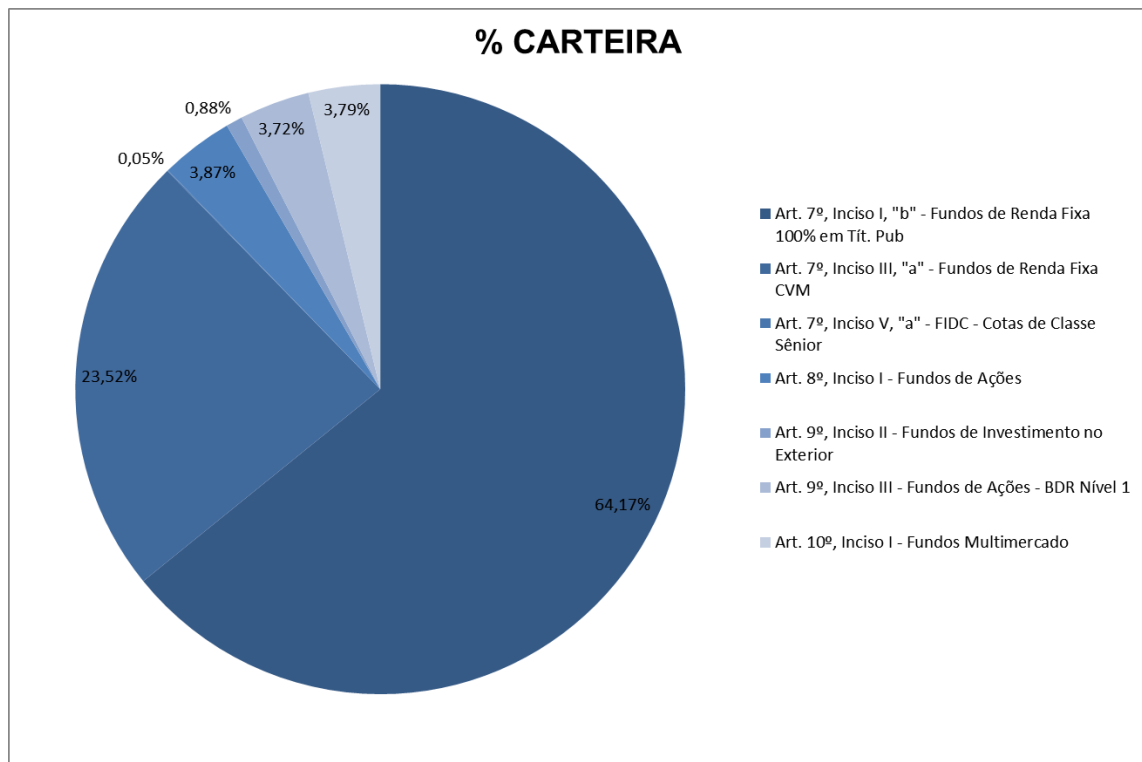
**SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS**

Fundo de Investimento	Saldo em 31/05/2022	Saldo em 30/06/2022	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$10.744,78	R\$4.987,03	-R\$5.897,83	R\$140,08	0,06%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$1.156.633,11	R\$1.208.443,33	R\$36.252,97	R\$15.557,25	0,09%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$1.704.444,76	R\$1.711.674,18	R\$0,00	R\$7.229,42	0,42%
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	R\$3.565.940,85	R\$3.566.872,53	R\$0,00	R\$931,68	0,03%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$4.117.553,32	R\$3.671.527,19	R\$0,00	-R\$446.026,13	-10,83%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$14.236.710,98	R\$11.917.721,46	R\$0,00	-R\$2.318.989,52	-16,29%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$15.023.706,15	R\$13.448.225,33	R\$0,00	-R\$1.575.480,82	-10,49%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$15.468.751,46	R\$13.637.881,29	R\$0,00	-R\$1.830.870,17	-11,84%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$15.921.684,13	R\$14.119.379,98	R\$0,00	-R\$1.802.304,15	-11,32%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$16.357.525,69	R\$14.473.491,04	R\$0,00	-R\$1.884.034,65	-11,52%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$16.524.169,05	R\$14.785.099,40	R\$0,00	-R\$1.739.069,65	-10,52%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$15.257.133,28	R\$15.092.881,12	R\$0,00	-R\$164.252,16	-1,08%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$17.569.540,75	R\$15.216.159,09	R\$0,00	-R\$2.353.381,66	-13,39%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$15.129.325,28	R\$15.538.392,73	R\$0,00	R\$409.067,45	2,70%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	R\$18.880.174,24	R\$16.962.067,69	R\$0,00	-R\$1.918.106,55	-10,16%
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	R\$17.213.700,00	R\$17.388.590,00	R\$0,00	R\$174.890,00	1,02%
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	R\$23.790.454,65	R\$23.594.691,39	R\$0,00	-R\$195.763,26	-0,82%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$27.742.250,71	R\$25.604.633,14	R\$0,00	-R\$2.137.617,57	-7,71%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$27.673.889,24	R\$27.676.173,58	R\$0,00	R\$2.284,34	0,01%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$36.595.340,44	R\$33.871.338,62	R\$0,00	-R\$2.724.001,82	-7,44%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$37.204.435,92	R\$34.309.864,01	R\$0,00	-R\$2.894.571,91	-7,78%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$42.857.028,19	R\$43.211.658,80	R\$0,00	R\$354.630,61	0,83%
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	R\$44.267.886,74	R\$44.312.472,46	R\$0,00	R\$44.585,72	0,10%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	R\$64.960.269,20	R\$55.127.709,94	-R\$10.410.000,00	R\$577.440,74	0,89%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	R\$71.568.619,62	R\$70.997.457,95	R\$0,00	-R\$571.161,67	-0,80%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	R\$132.716.683,55	R\$133.138.310,48	R\$0,00	R\$421.626,93	0,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$156.701.221,56	R\$157.223.944,20	R\$0,00	R\$522.722,64	0,33%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$177.719.026,04	R\$178.112.526,27	R\$0,00	R\$393.500,23	0,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	R\$218.952.941,92	R\$219.965.874,75	R\$0,00	R\$1.012.932,83	0,46%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	R\$223.516.875,53	R\$224.111.667,36	R\$0,00	R\$594.791,83	0,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	R\$239.610.727,25	R\$240.148.264,29	R\$0,00	R\$537.537,04	0,22%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$245.571.037,46	R\$248.175.591,06	R\$0,00	R\$2.604.553,60	1,06%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$335.404.181,34	R\$352.526.970,22	R\$13.635.000,00	R\$3.487.788,88	1,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	R\$378.004.115,96	R\$379.242.151,72	R\$0,00	R\$1.238.035,76	0,33%
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	R\$827.244.638,20	R\$829.933.132,90	R\$0,00	R\$2.688.494,70	0,32%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$3.500.239.361,35</b>	<b>R\$3.494.027.826,53</b>	<b>R\$3.255.355,14</b>	<b>-R\$9.466.889,96</b>	<b>-0,27%</b>

#### 4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

##### 4.1. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022

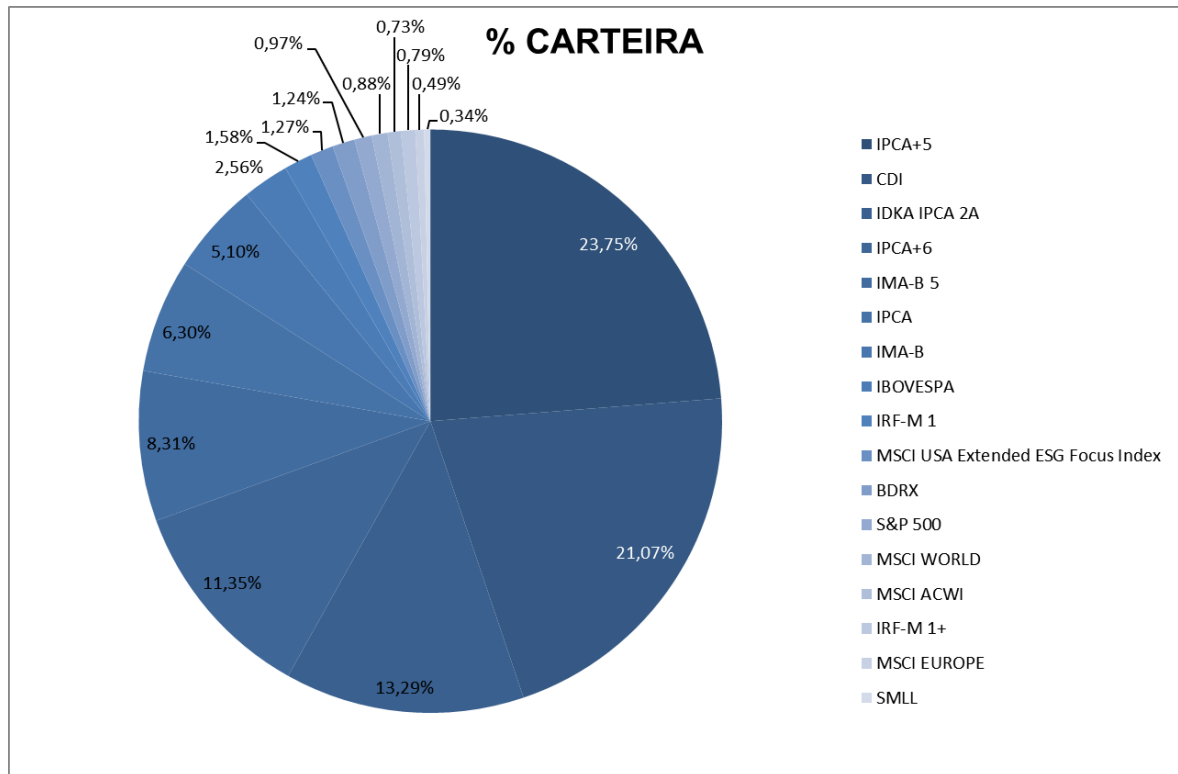
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022								
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2022	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total	
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub</b>		<b>64,17%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$2.242.102.470,74</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	1,58%	100,00%	100,00%	100,00%	1,08%	R\$55.127.709,94	
BB PREVID RF IDKA 2 FI	IDKA 2A	6,41%	100,00%	100,00%	100,00%	2,31%	R\$224.111.667,36	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF	IDKA 2A	6,87%	100,00%	100,00%	100,00%	2,14%	R\$240.148.264,29	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	IMA-B 5	3,81%	100,00%	100,00%	100,00%	1,90%	R\$133.138.310,48	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	IMA-B 5	4,50%	100,00%	100,00%	100,00%	1,42%	R\$157.223.944,20	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	IPCA+6%	10,85%	100,00%	100,00%	100,00%	13,20%	R\$379.242.151,72	
FI CAIXA BRASIL 2022 I TP RF	IPCA+6%	0,50%	100,00%	100,00%	100,00%	17,22%	R\$17.388.590,00	
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	IPCA+5%	23,75%	100,00%	100,00%	100,00%	24,05%	R\$829.933.132,90	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	IMA-B	5,10%	100,00%	100,00%	100,00%	7,55%	R\$178.112.526,27	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+	IRF-M 1+	0,79%	100,00%	100,00%	100,00%	22,21%	R\$27.676.173,58	
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>23,52%</b>	<b>65,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$821.881.866,39</b>	
BB PREVID RF PERFIL FI EM COTAS	CDI	10,09%	65,00%	65,00%	20,00%	3,58%	R\$352.526.970,22	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO	CDI	0,03%	65,00%	65,00%	20,00%	0,03%	R\$1.208.443,33	
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	7,10%	65,00%	65,00%	20,00%	1,97%	R\$248.175.591,06	
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$4.987,03	
BB PREV RF ALOC ATIVA RET TOTAL	IPCA	6,30%	65,00%	65,00%	20,00%	5,86%	R\$219.965.874,75	
<b>Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior</b>		<b>0,05%</b>	<b>5,00%</b>	<b>0,50%</b>	<b>20,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>R\$1.711.674,18</b>	
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA -	CDI	0,05%	5,00%	0,50%	20,00%	3,64%	R\$1.711.674,18	
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>3,87%</b>	<b>35,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$135.140.823,40</b>	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE F	IBOVESPA	0,40%	35,00%	35,00%	20,00%	9,05%	R\$14.119.379,98	
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,41%	35,00%	35,00%	20,00%	5,67%	R\$14.473.491,04	
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,44%	35,00%	35,00%	20,00%	4,04%	R\$15.216.159,09	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	0,97%	35,00%	35,00%	20,00%	2,16%	R\$33.871.338,62	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	0,39%	35,00%	35,00%	20,00%	1,37%	R\$13.637.881,29	
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	0,11%	35,00%	35,00%	20,00%	1,28%	R\$3.671.527,19	
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	0,34%	35,00%	35,00%	20,00%	1,93%	R\$11.917.721,46	
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	0,38%	35,00%	35,00%	20,00%	2,09%	R\$13.448.225,33	
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	0,42%	35,00%	35,00%	20,00%	3,41%	R\$14.785.099,40	
<b>Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior</b>		<b>0,88%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$30.631.273,85</b>	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	0,43%	10,00%	10,00%	20,00%	1,15%	R\$15.092.881,12	
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	0,44%	10,00%	10,00%	20,00%	11,08%	R\$15.538.392,73	
<b>Art. 9º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>3,72%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$130.090.832,09</b>	
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,27%	10,00%	10,00%	20,00%	3,19%	R\$44.312.472,46	
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS - BDR ETF NÍVEL I	MSCI EUROPE	0,49%	10,00%	10,00%	20,00%	11,40%	R\$16.962.067,69	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO - BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	0,73%	10,00%	10,00%	20,00%	4,78%	R\$25.604.633,14	
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	1,24%	10,00%	10,00%	20,00%	1,94%	R\$43.211.658,80	
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>3,79%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$132.468.885,88</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO MULT ALOCAÇÃO	CDI	0,10%	10,00%	10,00%	20,00%	3,02%	R\$3.566.872,53	
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIME	CDI	2,03%	10,00%	10,00%	20,00%	2,88%	R\$70.997.457,95	
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRAT LIVRE	CDI	0,68%	10,00%	10,00%	20,00%	8,59%	R\$23.594.691,39	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA	CDI	0,98%	10,00%	10,00%	20,00%	1,66%	R\$34.309.864,01	
<b>Total:</b>							<b>R\$3.494.027.826,53</b>	



#### 4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

##### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

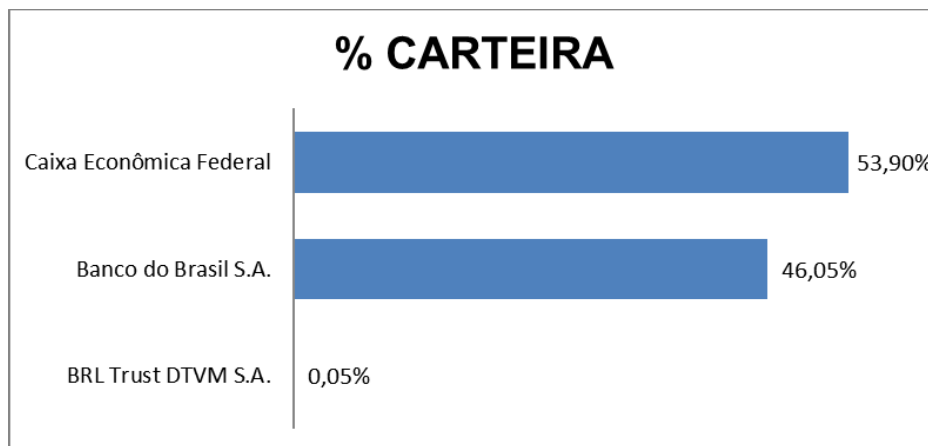
Indicador	Saldo em 30/06/2022	Participação
IPCA+5	R\$829.933.132,90	23,75%
CDI	R\$736.096.551,70	21,07%
IDKA IPCA 2A	R\$464.259.931,65	13,29%
IPCA+6	R\$396.630.741,72	11,35%
IMA-B 5	R\$290.362.254,68	8,31%
IPCA	R\$219.965.874,75	6,30%
IMA-B	R\$178.112.526,27	5,10%
IBOVESPA	R\$89.351.763,32	2,56%
IRF-M 1	R\$55.127.709,94	1,58%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$44.312.472,46	1,27%
BDRX	R\$43.211.658,80	1,24%
S&P 500	R\$33.871.338,62	0,97%
MSCI WORLD	R\$30.631.273,85	0,88%
MSCI ACWI	R\$25.604.633,14	0,73%
IRF-M 1+	R\$27.676.173,58	0,79%
MSCI EUROPE	R\$16.962.067,69	0,49%
SMLL	R\$11.917.721,46	0,34%
<b>Total</b>	<b>R\$3.494.027.826,53</b>	<b>100,00%</b>



#### 4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

##### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Rentabilidade	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$1.711.674,18	0,42%	0,05%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.609.064.398,26	-0,46%	46,05%
Caixa Econômica Federal	R\$1.883.251.754,09	-0,11%	53,90%



## 5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

### MOVIMENTAÇÕES

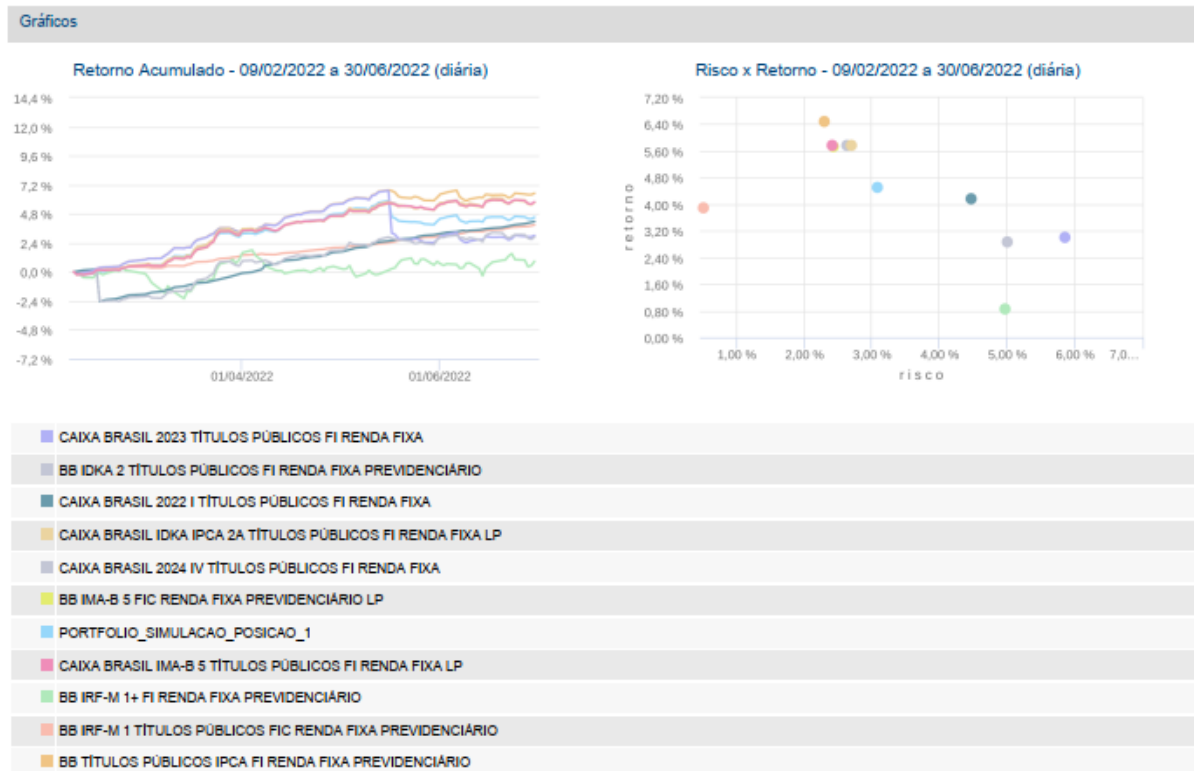
APLICAÇÕES			RESGATES		
Data	Valor	Ativo	Data	Valor	Ativo
01/06/2022	R\$5.241,62	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	02/06/2022	R\$5.897,83	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
03/06/2022	R\$227.530,37	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	02/06/2022	R\$247.440,09	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
06/06/2022	R\$31.652,89	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	03/06/2022	R\$682.637,53	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
07/06/2022	R\$983,06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	06/06/2022	R\$227.530,37	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
08/06/2022	R\$1.308,67	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	14/06/2022	R\$4.411.841,86	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
09/06/2022	R\$4.162.195,16	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	23/06/2022	R\$10.410.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC
10/06/2022	R\$8.895,81	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	24/06/2022	R\$10.722.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
13/06/2022	R\$2.064,54	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	27/06/2022	R\$8.219,13	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
14/06/2022	R\$4.435.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC			
20/06/2022	R\$170,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
22/06/2022	R\$308.360,24	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
23/06/2022	R\$9.200.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC			
23/06/2022	R\$11.566.344,40	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
28/06/2022	R\$18.167,91	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
29/06/2022	R\$473,95	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
30/06/2022	R\$2.533,33	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$29.970.921,95
Resgates	-R\$26.715.566,81
Saldo	R\$3.255.355,14

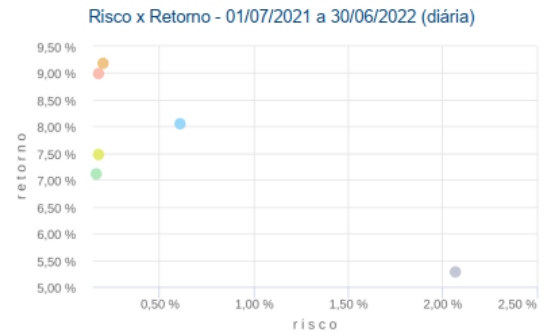
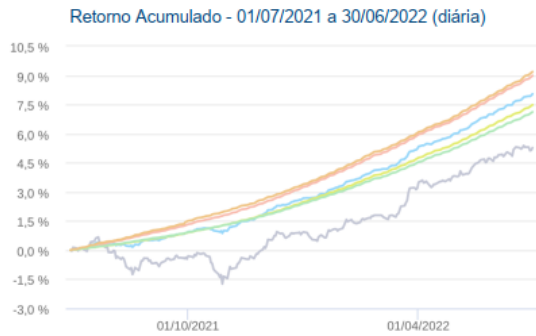
## 6. MONITORAMENTO DE RISCOS

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



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

### Gráficos



BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP

PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1

BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

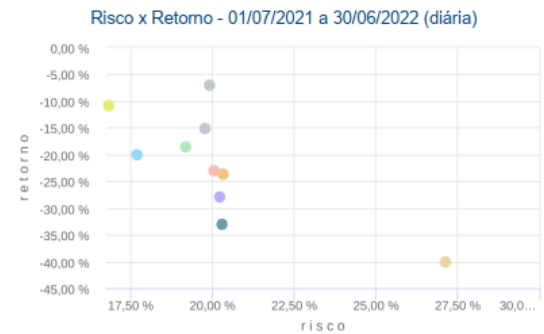
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO

CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA

CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP

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

### Gráficos



CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES

CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES

BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES

BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES

BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES

PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1

BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES

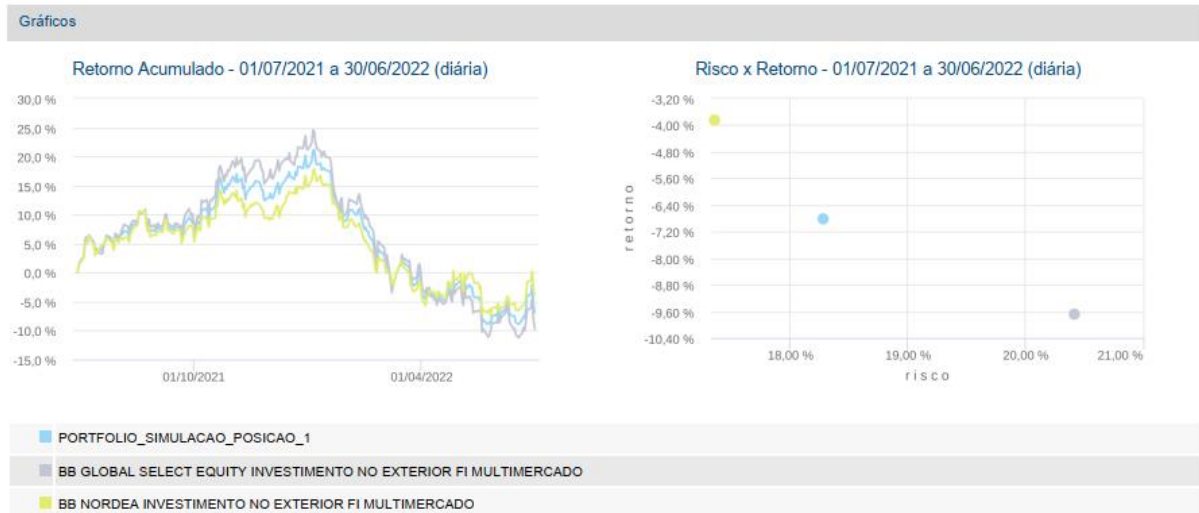
BB AGRO FIC AÇÕES

CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES

BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES



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



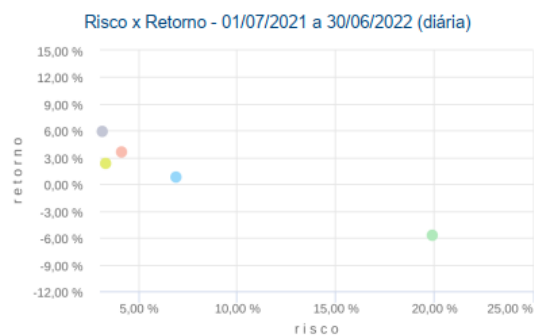
#### 6.5. ART. 9º, INCISO III – FUNDOS DE AÇÕES – BDR NÍVEL I





## 6.6. ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO

### Gráficos

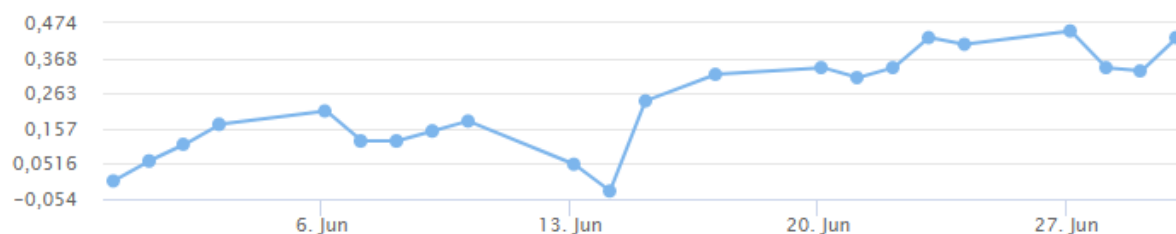


CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP
PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO

## 7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

### 7.1. RENTABILIDADE

A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,43% no mês de junho, totalizando um saldo de R\$ 197.073.945,55 (cento e noventa e sete milhões e setenta e três mil e novecentos e quarenta e cinco reais e cinquenta e cinco centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira ao longo do mês.

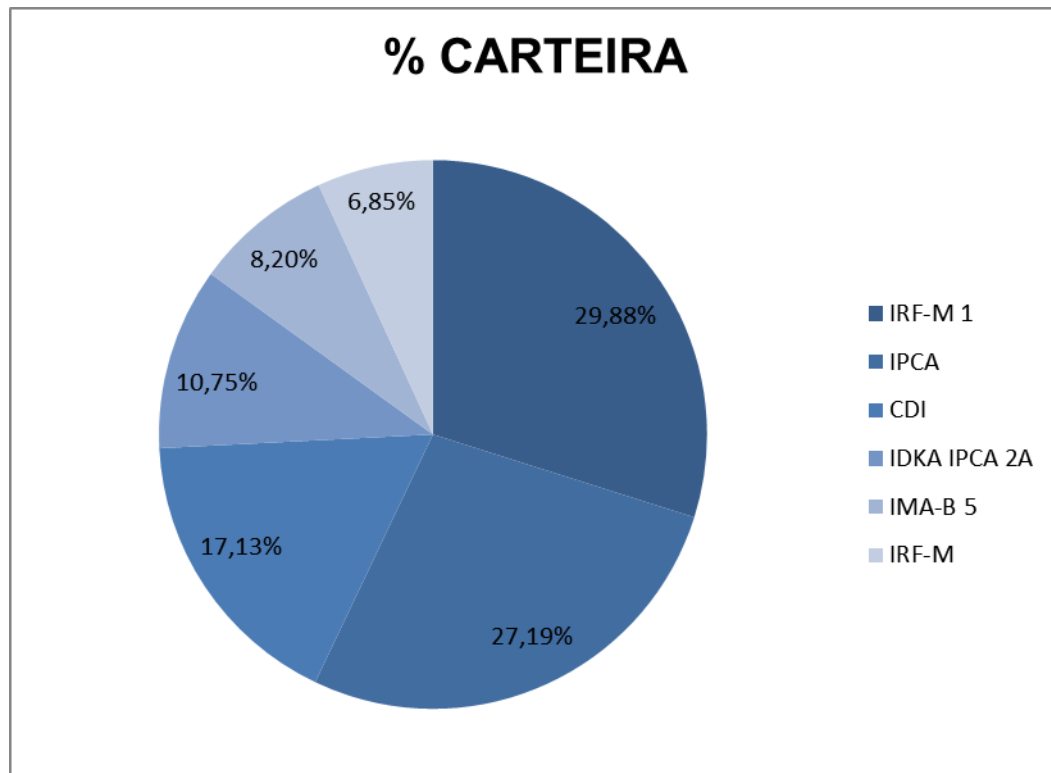




## 7.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

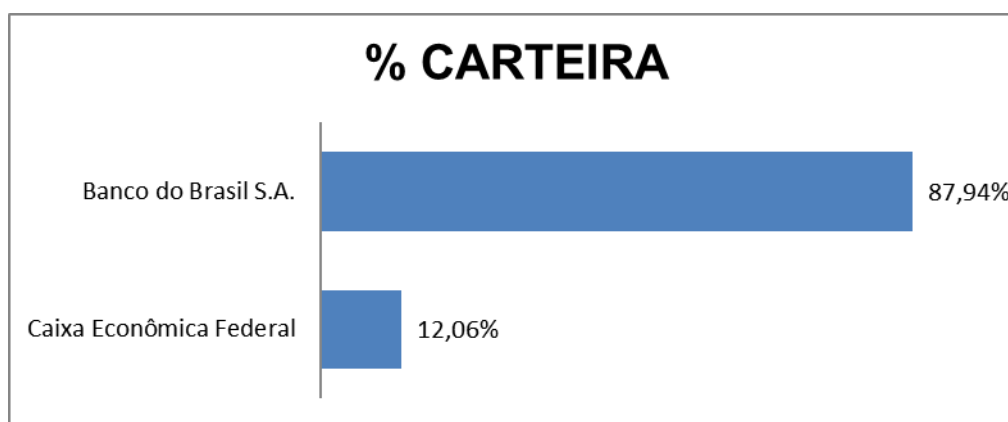
Indicador	Saldo em 30/06/2022	Participação
IRF-M 1	R\$58.892.745,64	29,88%
IPCA	R\$53.577.452,38	27,19%
CDI	R\$33.765.396,38	17,13%
IDKA IPCA 2A	R\$21.188.462,59	10,75%
IMA-B 5	R\$16.156.674,04	8,20%
IRF-M	R\$13.493.214,52	6,85%
	<b>R\$197.073.945,55</b>	<b>100,00%</b>



### 7.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

#### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

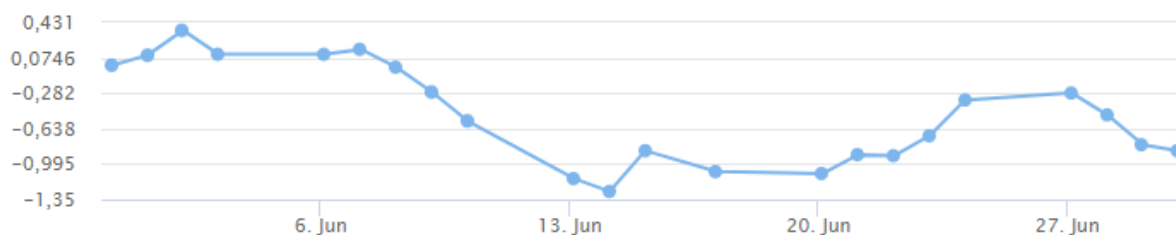
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$23.762.111,92	12,06%
Banco do Brasil S.A.	R\$173.311.833,63	87,94%



## 8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

### 8.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado negativo de -0,86% e fechou o mês com o saldo de R\$ 23.033.120,20 (vinte e três milhões e trinta e três mil e cento e vinte reais e vinte centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de junho.

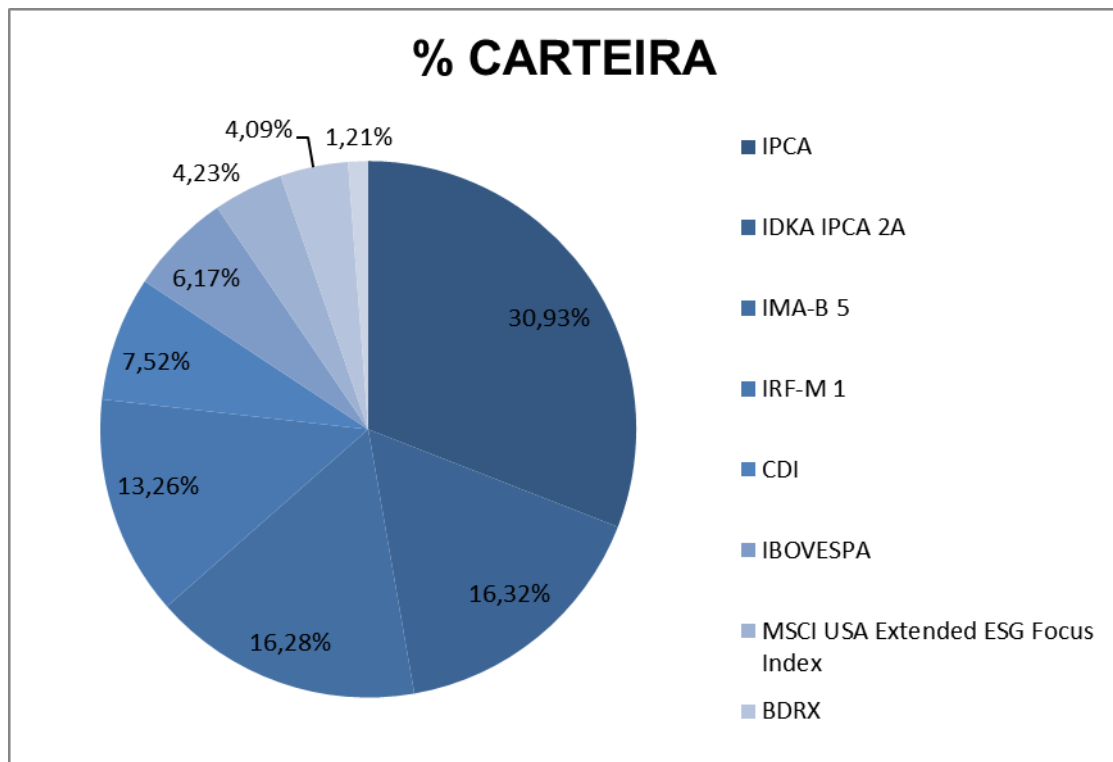




## 8.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/06/2022	Participação
IPCA	R\$7.123.339,39	30,93%
IDKA IPCA 2A	R\$3.759.272,14	16,32%
IMA-B 5	R\$3.748.967,79	16,28%
IRF-M 1	R\$3.054.748,24	13,26%
CDI	R\$1.731.461,73	7,52%
IBOVESPA	R\$1.420.605,77	6,17%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$973.643,76	4,23%
BDRX	R\$943.175,34	4,09%
SMLL	R\$277.906,04	1,21%
	<b>R\$23.033.120,20</b>	<b>100,00%</b>

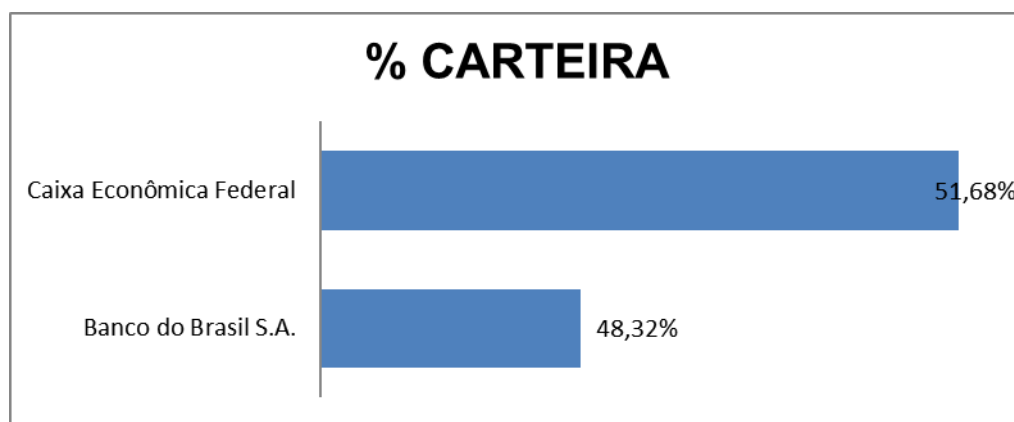




### 8.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

#### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

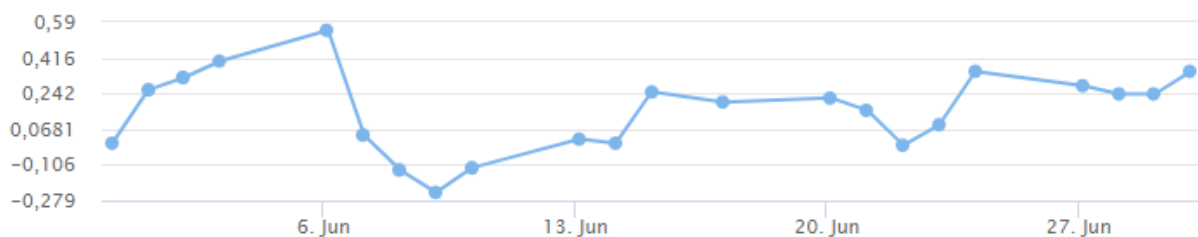
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$11.129.379,52	48,32%
Caixa Econômica Federal	R\$11.903.740,68	51,68%



## 9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

### 9.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de 0,35% e fechou o mês com o saldo de R\$ 16.391.683,99 (dezesseis milhões e trezentos e noventa e um mil e seiscentos e oitenta e três reais e noventa e nove centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de junho.

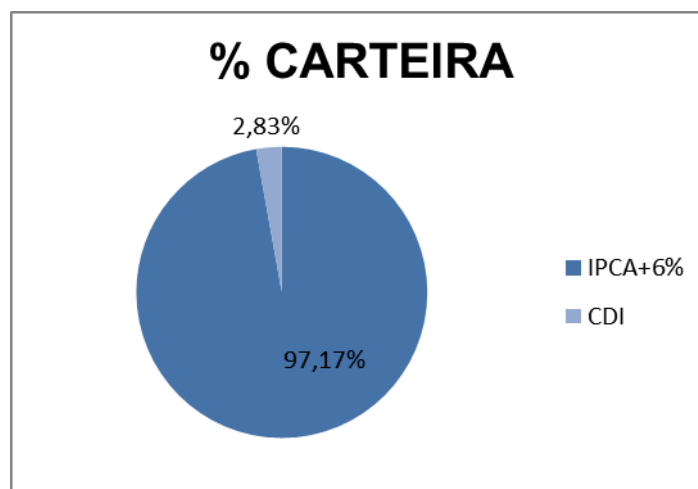




## 9.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

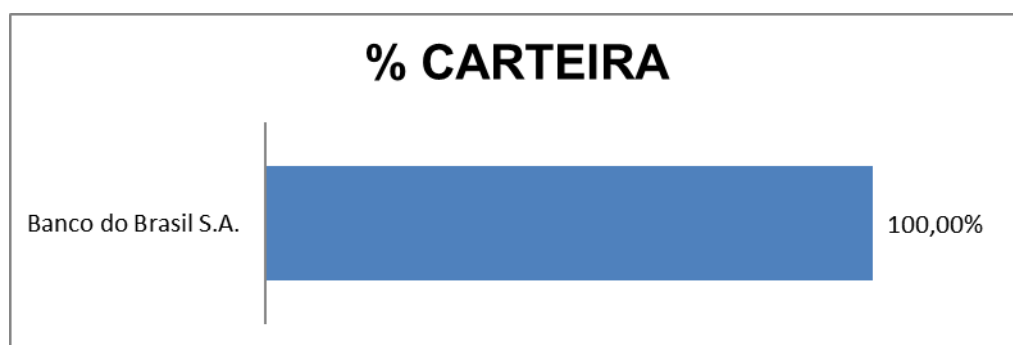
Indicador	Saldo em 30/06/2022	Participação
IPCA+6%	R\$15.927.168,22	97,17%
CDI	R\$464.515,77	2,83%
	<b>R\$16.391.683,99</b>	<b>100,00%</b>



## 9.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$16.391.683,99	100,00%





## 10. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES

### 10.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS 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 EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	0,85%	0,00%
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 MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	1,35%	20% do que excede 100% do CDI
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	1,00%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	0,10%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	0,30%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	0,20%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	0,50%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	0,15%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,80%	0,00%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,20%	0,00%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	2,00%	0,00%
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	0,20%	0,00%
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	0,20%	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 ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	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%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	2,00%	0,00%
FIDC MULTISECTORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	0,20%	0,00%





## 11. CONCLUSÃO

O Macaeprev encerrou o mês de junho de 2022 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 3.730.526.576,27 (três bilhões e setecentos e trinta milhões e quinhentos e vinte e seis mil e quinhentos e setenta e seis reais e vinte e sete centavos).

Macaé, 25 de julho de 2022.

*Erenildo Motta da Silva Júnior*  
**Erenildo Motta da Silva Júnior**  
Gestor de Recursos  
MACAEPREV



## PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e oito dias do mês de julho de 2022, o Comitê de Investimentos, ordinariamente, reuniu-se via plataforma de reunião *Google Hangouts Meet*, para apresentação e análise dos investimentos, acompanhamento da rentabilidade, dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS, da aderência das alocações, processos decisórios de investimentos e políticas de investimentos referentes ao mês de **junho de 2022**.

Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos o qual segue na íntegra na ata do dia de hoje, 28 de julho de 2022.

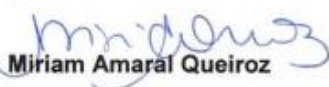
Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de Junho de 2022, e que foram devidamente fundamentadas e registradas nas atas de reunião do Comitê.

Considerando, por fim, que os investimentos são aderentes à Política Anual de Investimentos do Macaeprev de 2022 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução CMN 4.963, **APROVAMOS** o relatório apresentado referente à **JUNHO de 2022**, o qual segue para aprovação do Conselho Fiscal. É o parecer.

  
Alfredo Tanos Filho

  
Erenildo Motta da Silva Júnior

  
José Eduardo da Silva Guinâncio

  
Miriam Amaral Queiroz

  
Claudio de Freitas Duarte

  
Isabella Felix Viana

  
Maria Auxiliadora de Moura Ferreira

  
Patric Alves de Vasconcellos



## RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS


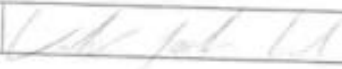

JUNHO DE 2022

### TERMO DE APROVAÇÃO CONSELHO FISCAL

Ao dia 18/08/2022, 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 **JUNHO de 2022**. Considerando todas as informações constantes no presente relatório, **APROVAMOS** o relatório de investimentos referente à **JUNHO DE 2022**.

*Macaé, 18 de agosto de 2022.*

#### CONSELHO FISCAL

JÚLIO CÉSAR VIANA CARLOS	PRESIDENTE	
UELITON MACHADO PINTO	MEMBRO	
MARCELO P. TAVARES	MEMBRO	
SUSAN C. V. FERRAZ	MEMBRO	