

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



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



JULHO - 2022



SUMÁRIO

1. INTRODUÇÃO	3
2. CENÁRIO ECONÔMICO	3
3. RESULTADO DA CARTEIRA	7
4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA	12
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
5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES	15
6. MONITORAMENTO DE RISCOS	16
6.1. ART. 7º, INCISO I, “B” – FUNDOS DE RENDA FIXA 100% EM TP	16
6.2. ART. 7º, INCISO III, “A” – FUNDOS DE RENDA FIXA CVM	16
6.3. ART. 8º, INCISO I – FUNDOS DE AÇÕES	17
6.4. ART. 9º, INCISO II – FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17
6.5. ART. 9º, INCISO III – FUNDOS DE AÇÕES – BDR NÍVEL I.....	18
6.6. ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO.....	18
7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	19
7.1. RENTABILIDADE	19
7.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA	19
7.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	20
8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021	21
8.1. RENTABILIDADE	21
8.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA	21
8.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	22
9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022	23
9.1. RENTABILIDADE	23
9.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA	23
9.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	24
10. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES	25
10.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS	25
11. CONCLUSÃO	26



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 julho 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

Em julho, a inflação continuou sendo o monstro que assombra as principais economias globais. Como forma de combate à inflação, os principais bancos centrais do mundo iniciaram o ciclo de alta de taxa de juros. Entretanto, a cautela dos investidores com esses aumentos se dá por conta da já conhecida consequência dessa ação: desaceleração econômica.

Na China, o Produto Interno Bruto (PIB) no 2T22 desacelerou de 4,8% para 0,4% (A/A), desempenho abaixo da mediana das projeções de mercado. O severo lockdown adotado em Xangai, além de restrições importantes à mobilidade em outras localidades, como Pequim, deprimiu atividades industriais e os gastos das famílias. Notícias do mercado imobiliário levaram a um aumento da preocupação com esse setor. Nota-se um crescimento da inadimplência, em protesto contra o atraso nesses empreendimentos, o que pode gerar problemas de liquidez para as construtoras, caso esse movimento aumente. Acerca da atividade, a reunião do Comitê Político do Partido Comunista de julho reiterou o apoio à atividade no 2º semestre, mas anunciou que o objetivo é “manter o crescimento econômico em uma faixa razoável”, deixando assim de afirmar que buscará um crescimento do PIB de 5,5% em 2022.

As exportações da China cresceram acima do esperado em julho, oferecendo um impulso encorajador à economia, que luta para se recuperar de uma queda induzida pela Covid-19. No entanto, o enfraquecimento da demanda global pode começar a prejudicar os



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



embarques nos próximos meses. As exportações subiram 18% em julho em relação ao mesmo período do ano anterior, o ritmo mais rápido deste ano, mostraram dados oficiais da alfândega, em comparação com um aumento de 17,9% em junho e superando as expectativas dos analistas de alta de 15%.

Os Estados Unidos bateram a maior inflação dos últimos 41 anos ao registrar alta de 9,1% no acumulado em 12 meses terminados em junho, sendo que o setor de combustíveis foi o destaque negativo do período. O Índice de Preços ao Consumidor (CPI) dos EUA acelerou de 1,0% para 1,3% em junho (M/M).

Os investidores globais estavam de olho, na última semana do mês, na decisão de política monetária do Federal Reserve (Fed, o banco central norte-americano). Conforme já era amplamente esperado, o Fed aumentou em 0,75% a taxa básica de juros, levando-a para a faixa de 2,25% a 2,50% ao ano.

Entretanto, mais importante que a decisão em si foi o comunicado. O presidente da instituição, Jerome Powell, indicou que as decisões seguintes serão pautadas nos próximos dados econômicos e que provavelmente os novos ajustes terão que ser mais moderados para não causar recessão econômica no país. O Fed também mostrou em sua ata um aumento na confiança de que o aperto moderado dos juros será suficiente para aproximar a inflação de sua meta de 2%. Seu discurso mais brando animou o mercado, fazendo com que as taxas de juros globais caíssem acentuadamente e as moedas emergentes se valorizassem.

O comunicado e a ata trouxeram alívio aos mercados, embora o dado de PIB tenha registrado queda no segundo trimestre. Como o PIB do 1T22 já tinha sido de queda de 1,6%, os Estados Unidos já estão na chamada recessão técnica. E alguns dados predecessores, como o Índice dos Gerentes de Compras (PMI) e a pesquisa do Fed Filadélfia, já indicaram um enfraquecimento econômico em julho. Embora configure uma recessão técnica, o resultado não deve ser classificado como recessão pela datação dos ciclos econômicos, por não atender o critério de abrangência.

A leitura do mercado após a divulgação dos dados e o posterior posicionamento do banco central norte-americano fornece indícios de que não será necessário um aperto tão duro como se esperava, uma vez que os dados mostram que na margem a economia americana já está enfraquecendo no atual ritmo de elevação de juros.

Os Estados Unidos criaram 528 mil vagas de trabalho fora do setor agrícola em julho, e com isso o número de desempregados caiu para 5,7 milhões e a taxa de desemprego,



para 3,5%, de acordo com dados do Payroll. Com isso, tanto o número de empregos não agrícolas quanto a taxa de desemprego voltaram aos níveis pré-pandemia, de fevereiro de 2020, segundo a Secretaria de Estatísticas Trabalhistas, órgão ligado ao Departamento de Trabalho americano.

Na Zona do Euro, o índice de inflação foi de 8,9% nos últimos 12 meses terminados em julho, registrando a máxima histórica da série. Além da pressão do aumento de preços advindo do setor de combustíveis, a situação tem sido agravada pelo conflito entre Rússia e Ucrânia.

Assim como o Fed, o Banco Central Europeu (BCE) elevou juros pela primeira vez em 11 anos, também na tentativa de contenção da inflação. O percentual subiu de -0,5% para 0%, surpreendendo os mercados que esperavam uma alta mais modesta de 0,25%. Já a taxa de empréstimo subiu de 0,25% para 0,75%. O BCE disse que novos reajustes dos juros devem ser feitos nas próximas reuniões. A Zona do Euro também convive com temores sobre a crise energética e a preocupação em relação ao crescimento econômico.

Outra decisão importante foi o anúncio da ferramenta para conter a elevação de spreads entre os títulos dos diferentes países do bloco (risco de fragmentação). O TPI (sigla em inglês), aprovado por unanimidade, visa assegurar que a orientação da política monetária seja transmitida uniformemente em todos os países da Zona do Euro e pode ser ativado a fim de corrigir dinâmicas de mercado desordenadas ou injustificadas.

A atividade empresarial na Zona do Euro contraiu ligeiramente em julho pela primeira vez desde o início do ano passado, à medida que os consumidores seguraram os gastos em meio a uma crise do custo de vida, de acordo com uma pesquisa que sugere que as perspectivas para a economia são sombrias. O Índice de Gerentes de Compras (PMI) composto final da S&P Global, visto como um bom indicador da saúde econômica, caiu para uma mínima de 17 meses, de 49,9 em julho em relação aos 52,0 de junho, embora ainda acima da preliminar de 49,4. Cabe ressaltar que leitura abaixo de 50 indica contração.

No Brasil, houve a aprovação da PEC dos Benefícios, que instaurou estado de emergência no país até o fim do ano de 2022 e permite a ampliação dos gastos além da lei do Teto dos Gastos. A previsão é que sejam gastos em benefícios sociais algo em torno de R\$ 41,2 bilhões para: (i) aumentar o Auxílio Brasil para R\$ 600/família; (ii) Auxílio Gás; e (iii) auxílio para caminhoneiros e taxistas. A aprovação dessa PEC aumentou o já conhecido risco fiscal do Brasil, dado que a probabilidade de que esses auxílios não terminem em 2022 é alta.



Os indicadores de atividade divulgados em julho, referentes a maio, apresentaram os seguintes resultados: A produção industrial avançou 0,3% (M/M), o que representou a 4ª alta seguida. Sobre o resultado da indústria geral, destaque para a de transformação (0,8%). O varejo restrito de maio cresceu 0,1% (M/M), o que correspondeu à 5ª elevação consecutiva. Destaque positivo para itens ligados à renda das famílias. O volume de serviços cresceu 0,9% (M/M), com destaque para atividades turísticas (2,6%) e Serviços prestados às famílias (1,9%), sendo puxado por serviços de alojamento e alimentação (1,1%).

O Ministério da Economia divulgou a atualização das projeções de estatísticas macroeconômicas. Dentre as revisões, a pasta projeta agora um crescimento de 2% do PIB de 2022, ante 1,5% na projeção anterior. Com a revisão, o número volta para o patamar do que era esperado para a atividade econômica de 2022 no fim do ano passado. O valor é melhor que a estimativa do mercado financeiro. Para este ano, a expectativa é que a inflação medida pelo Índice de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) termine em 7,2%. Como já admitido pelo Banco Central, a previsão da equipe econômica para a inflação sinaliza que este será o segundo ano consecutivo que o IPCA vai superar o teto da meta estipulada pelo Conselho Monetário Nacional (CMN). Enquanto o centro da meta de inflação este ano é de 3,5%, o intervalo de tolerância de 1,5 ponto percentual deixa uma margem para que o índice varie entre 2% e 5%. Também como justificativa para as revisões, o Ministério da Economia cita as alterações observadas no mercado de trabalho e na massa de rendimento real.

Acerca do mercado de trabalho, mesmo com a taxa de participação aumentando (62,5% para 62,6%), a taxa de desemprego (IBGE/PNAD Contínua) recuou de 9,8% para 9,3% em junho, em razão da forte elevação de vagas no setor de serviços. O saldo de empregos formais de junho (MTE-Ministério do Trabalho e Emprego/CAGED-Cadastro Geral de Empregados e Desempregados) saiu de 277.018 para 277.944.

Vimos ao longo do mês de julho uma oscilação dos mercados, passando do campo negativo para o positivo, o que impulsionou não somente o cenário externo, mas também o nosso. As bolsas internacionais refletiram a leitura dos dados de atividade e de inflação, o posicionamento mais brando do Fed e os bons resultados dos negócios no segundo trimestre, que contribuíram para o ganho do mercado acionário. A B3 acompanhou a valorização das bolsas internacionais. Além disso, fatores domésticos contribuíram para a alta das ações locais, com destaque para a queda do desemprego e os resultados surpreendentes de ações



ligadas a commodities, que puxaram o índice pra cima. O Ibovespa, principal índice da bolsa brasileira, subiu 4,69% em julho.

O Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA), considerado a inflação oficial do país, ficou em -0,68% em julho, após a variação de 0,67% em junho, pressionado pela queda nos preços dos combustíveis, em particular da gasolina e do etanol, e da energia elétrica. Foi a menor taxa registrada desde o início da série histórica, iniciada em janeiro de 1980. No ano, a inflação acumulada é de 4,77% e, nos últimos 12 meses, de 10,07%.

O gerente da pesquisa, Pedro Kislánov, explicou o seguinte: “A Petrobras no dia 20 de julho anunciou uma redução de 20 centavos no preço médio do combustível vendido para as distribuidoras. Além disso, nós tivemos também a Lei Complementar 194/22, sancionada no final de junho, que reduziu o ICMS sobre combustíveis, energia elétrica e comunicações. Essa redução afetou não só o grupo de transportes (-4,51%), mas também o de habitação (-1,05%), por conta da energia elétrica (-5,78%). Foram esses dois grupos, os únicos com variação negativa do índice, que puxaram o resultado para baixo”. Os preços da gasolina caíram 15,48% e os do etanol, 11,38%. A gasolina, individualmente, contribuiu com o impacto negativo mais intenso entre os 377 subitens que compõem o IPCA, com -1,04 p.p. Além disso, também foi registrada queda no preço do gás veicular, com -5,67%. O pesquisador também destaca que além da redução da alíquota de ICMS cobrada sobre os serviços de energia elétrica, outro fator que influenciou o recuo do grupo habitação foi a aprovação, pela Agência Nacional de Energia Elétrica (ANEEL), das Revisões Tarifárias Extraordinárias de dez distribuidoras espalhadas pelo país, o que acarretou redução nas tarifas a partir de 13 de julho.

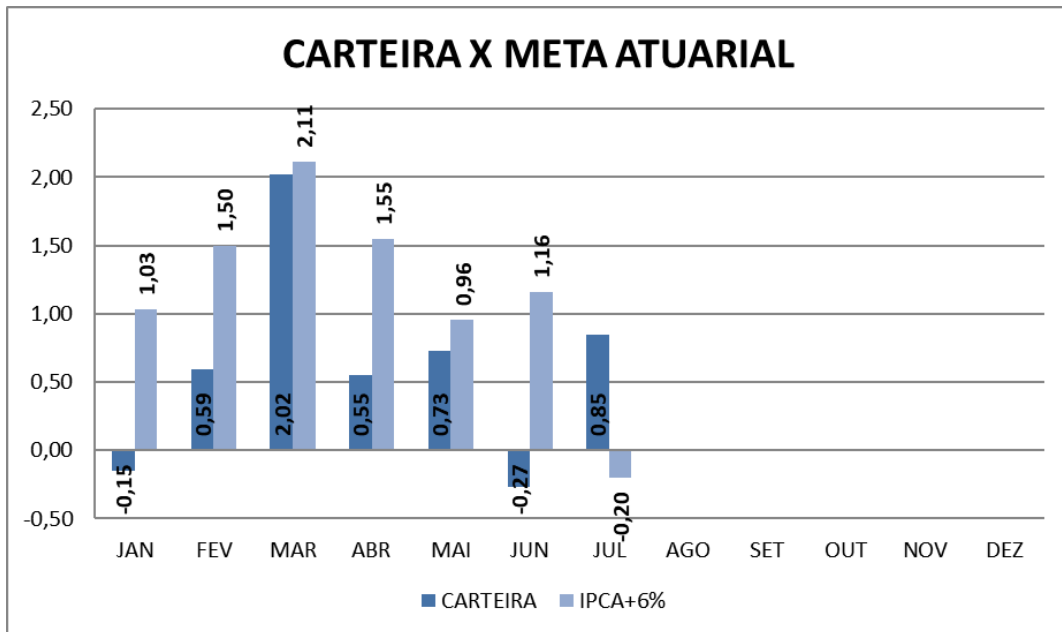
3. RESULTADO DA CARTEIRA

No mês de julho, nosso portfólio teve desempenho superior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com alta de 0,85%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 6%, foi de -0,20%. Superamos com folga a meta para esse período. Nos quadros a seguir pode-se observar o desempenho da Carteira em 2022.

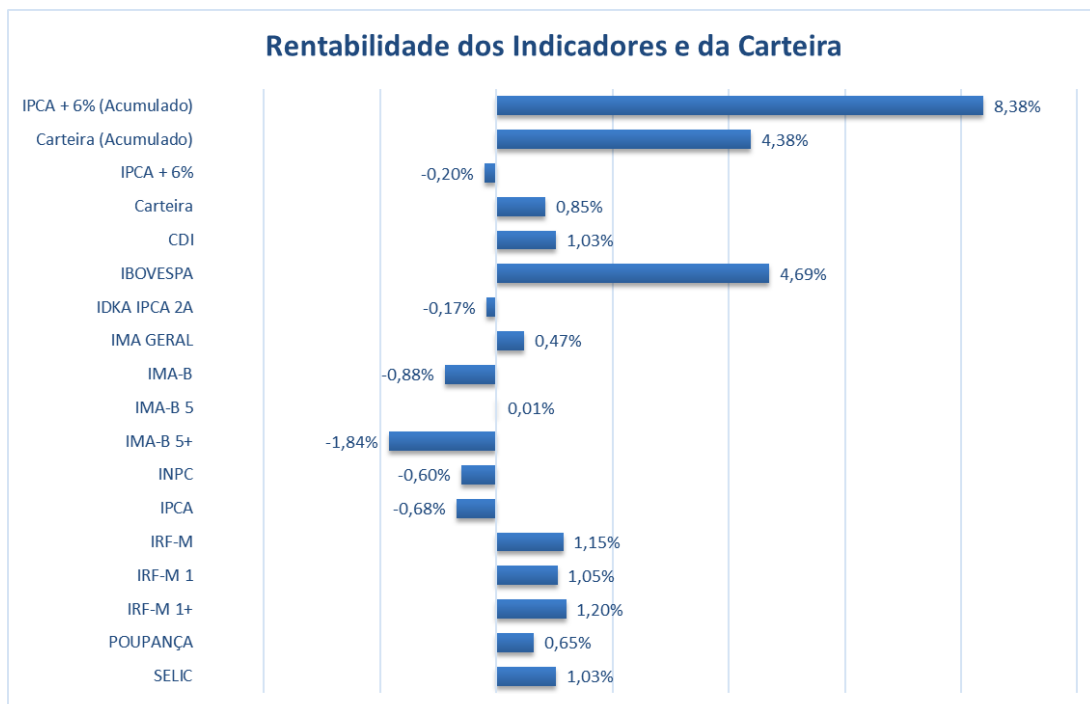


HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

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	0,85						4,38
IPCA+6%	1,03	1,50	2,11	1,55	0,96	1,16	-0,20						8,38

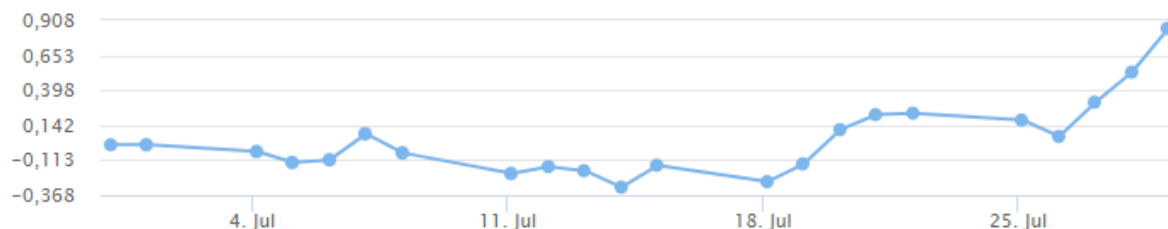


A seguir, apresento o quadro com o comportamento da Carteira, Meta Atuarial e diversos índices do mercado.





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



Apenas três fundos da carteira não bateram a meta atuarial no mês de julho. Mesmo com a deflação apresentada neste mês, alguns ativos de renda fixa não ajudaram na melhora dos saldos dos investimentos. No campo positivo, os maiores destaques foram os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial, Caixa Indexa Bolsa Americana Multimercado LP e BB Ações Bolsa Americana FIA, que renderam, respectivamente, 10,11% e 9,29%.

Os fundos de ações brasileiras tiveram uma boa performance com rentabilidade média de 4,46%. Os fundos com BDRs na carteira também tiveram uma boa performance com retorno médio de 6,78%. Os fundos de investimento no exterior tiveram uma rentabilidade de 5,10%. Os fundos multimercado tiveram uma rentabilidade média de 0,86%.

O fundo de vértice Caixa FI Brasil 2022 I TP RF teve um retorno de 0,50%, o fundo Caixa FI Brasil 2023 TP RF rendeu 0,07%, o fundo BB Previdenciário RF TP IPCA FI rendeu 0,08%, o fundo BB Previdenciário RF TP XXI FI rendeu -0,04%, enquanto o Caixa FI Brasil 2024 IV TP RF rendeu -0,32%.

Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,74%. O fundo de renda fixa com gestão ativa apresentou uma rentabilidade de -0,01%.

Os fundos IMA-B 5 tiveram um retorno de 0,01%. O fundo IMA-B 5+ teve retorno de 0,92%. O fundo indexado ao IRF-M 1+ teve um retorno de 1,18%. O fundo IRF-M 1 teve um retorno de 1,04%. Enquanto os fundos IDKA 2A tiveram rendimento negativo de -0,44%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade de -0,11%. Até 31/07/2022 foram resgatados o total de R\$ 9.621.929,37 (nove milhões e seiscentos e vinte e um mil e novecentos e vinte e nove reais e trinta e sete centavos), cerca de 96% do total investido. Em julho, o fundo apresentou resultado negativo de -R\$ 1.858,60 (mil e oitocentos e cinquenta e

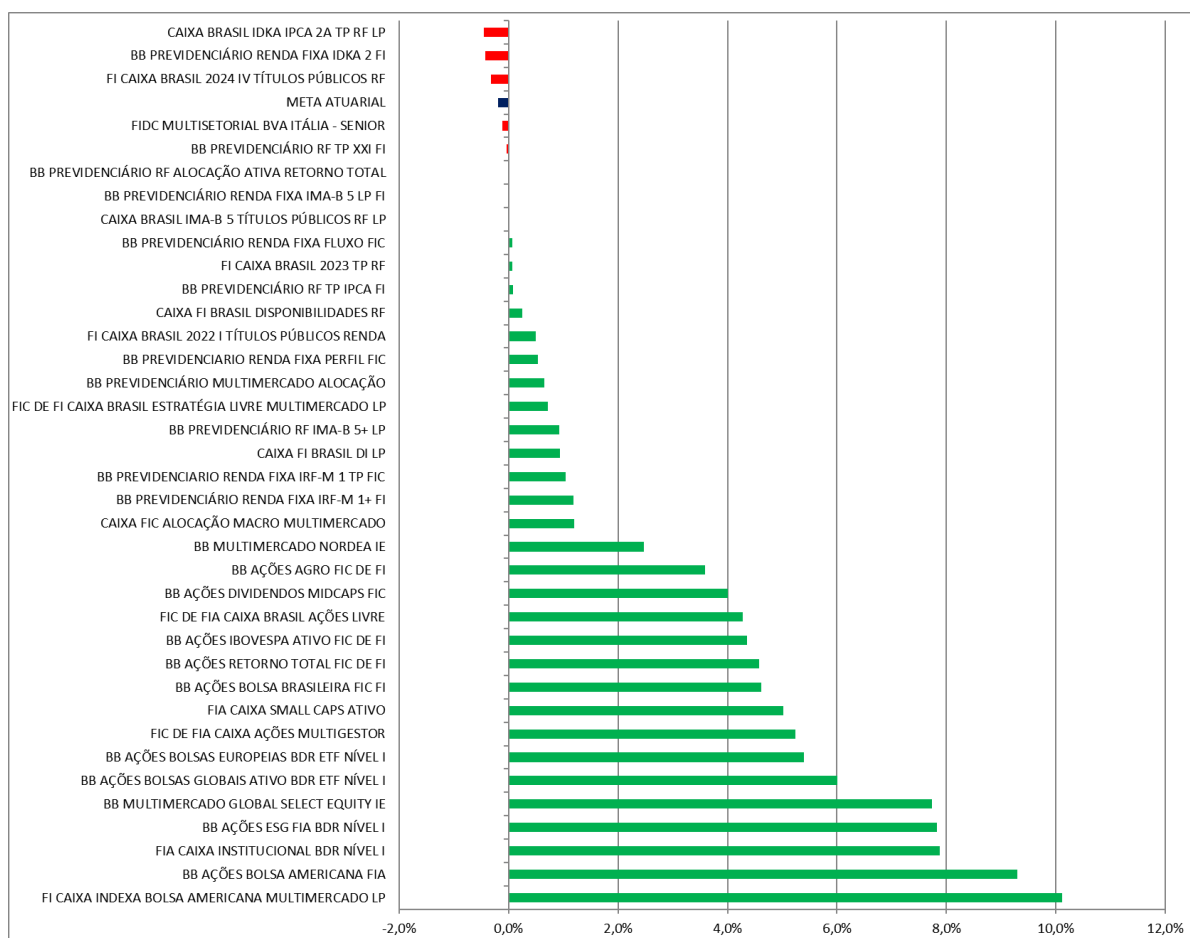


Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social



oito reais e sessenta centavos) e teve uma amortização no valor de R\$ 911.118,39 (novecentos e onze mil e cento e dezoito reais e trinta e nove centavos). O saldo em 31 de julho estava em R\$ 798.697,19 (setecentos e noventa e oito mil e seiscentos e noventa e sete reais e dezenove 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, enquanto os fundos na cor vermelha apresentaram resultado negativo.



O rendimento de julho da Carteira do Instituto foi de R\$ 29.678.374,54 (vinte e nove milhões e seiscentos e setenta e oito mil e trezentos e setenta e quatro reais e cinquenta e quatro centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de julho em R\$ 3.529.326.658,75 (três bilhões e quinhentos e vinte e nove milhões e trezentos e vinte e seis mil e seiscentos e cinquenta e oito reais e setenta e cinco centavos).



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



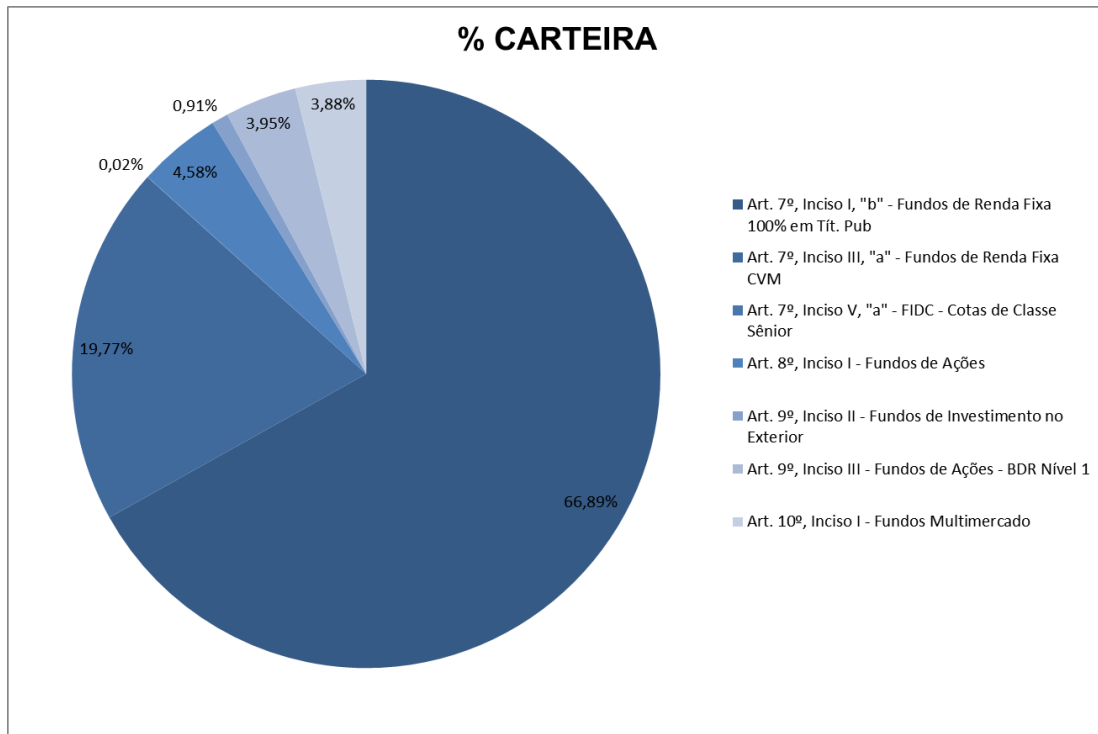
SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS

Fundo de Investimento	Saldo em 30/06/2022	Saldo em 31/07/2022	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	R\$219.965.874,75	R\$0,00	-R\$219.951.027,48	-R\$14.847,27	-0,01%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$4.987,03	R\$103,97	-R\$4.897,83	R\$14,75	0,25%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$1.711.674,18	R\$798.697,19	R\$0,00	-R\$1.858,60	-0,11%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$1.208.443,33	R\$1.256.932,53	R\$36.473,88	R\$12.015,32	0,06%
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	R\$3.566.872,53	R\$3.590.041,59	R\$0,00	R\$23.169,06	0,65%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$3.671.527,19	R\$6.938.941,20	R\$3.000.000,00	R\$267.414,01	4,01%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$14.119.379,98	R\$14.733.678,70	R\$0,00	R\$614.298,72	4,35%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$14.473.491,04	R\$15.140.313,56	R\$0,00	R\$666.822,52	4,61%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$11.917.721,46	R\$15.666.480,51	R\$3.000.000,00	R\$748.759,05	5,02%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$15.538.392,73	R\$15.921.959,42	R\$0,00	R\$383.566,69	2,47%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$15.092.881,12	R\$16.259.785,00	R\$0,00	R\$1.166.903,88	7,73%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$13.448.225,33	R\$17.309.459,63	R\$3.000.000,00	R\$861.234,30	5,24%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$13.637.881,29	R\$17.399.426,61	R\$3.000.000,00	R\$761.545,32	4,58%
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	R\$17.388.590,00	R\$17.475.181,30	R\$0,00	R\$86.591,30	0,50%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	R\$16.962.067,69	R\$17.876.086,25	R\$0,00	R\$914.018,56	5,39%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$14.785.099,40	R\$18.546.800,96	R\$3.000.000,00	R\$761.701,56	4,28%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$15.216.159,09	R\$18.869.381,34	R\$3.000.000,00	R\$653.222,25	3,59%
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	R\$23.594.691,39	R\$23.765.179,65	R\$0,00	R\$170.488,26	0,72%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$25.604.633,14	R\$27.142.891,12	R\$0,00	R\$1.538.257,98	6,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$27.676.173,58	R\$28.002.244,27	R\$0,00	R\$326.070,69	1,18%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	R\$0,00	R\$35.322.521,44	R\$35.000.000,00	R\$322.521,44	0,92%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$33.871.338,62	R\$37.017.585,33	R\$0,00	R\$3.146.246,71	9,29%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$34.309.864,01	R\$37.777.096,01	R\$0,00	R\$3.467.232,00	10,11%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$43.211.658,80	R\$46.615.459,05	R\$0,00	R\$3.403.800,25	7,88%
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	R\$44.312.472,46	R\$47.780.500,59	R\$0,00	R\$3.468.028,13	7,83%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	R\$55.127.709,94	R\$55.702.214,11	R\$0,00	R\$574.504,17	1,04%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	R\$70.997.457,95	R\$71.847.821,96	R\$0,00	R\$850.364,01	1,20%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	R\$133.138.310,48	R\$133.134.301,17	R\$0,00	-R\$4.009,31	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	R\$224.111.667,36	R\$138.143.086,36	-R\$85.000.000,00	-R\$968.581,00	-0,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$157.223.944,20	R\$157.256.458,88	R\$0,00	R\$32.514,68	0,02%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$178.112.526,27	R\$177.541.029,15	R\$0,00	-R\$571.497,12	-0,32%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	R\$240.148.264,29	R\$189.072.847,41	-R\$50.000.000,00	-R\$1.075.416,88	-0,45%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$0,00	R\$218.919.189,09	R\$219.000.000,00	-R\$80.810,91	-0,04%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$248.175.591,06	R\$291.885.061,79	R\$41.000.000,00	R\$2.709.470,73	0,94%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	R\$379.242.151,72	R\$379.537.340,10	R\$0,00	R\$295.188,38	0,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$352.526.970,22	R\$404.528.559,91	R\$48.451.027,48	R\$3.550.562,21	0,53%
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	R\$829.933.132,90	R\$830.552.001,60	R\$0,00	R\$618.868,70	0,07%
TOTAL	R\$3.494.027.826,53	R\$3.529.326.658,75	R\$6.531.576,05	R\$29.678.374,54	0,85%

4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

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

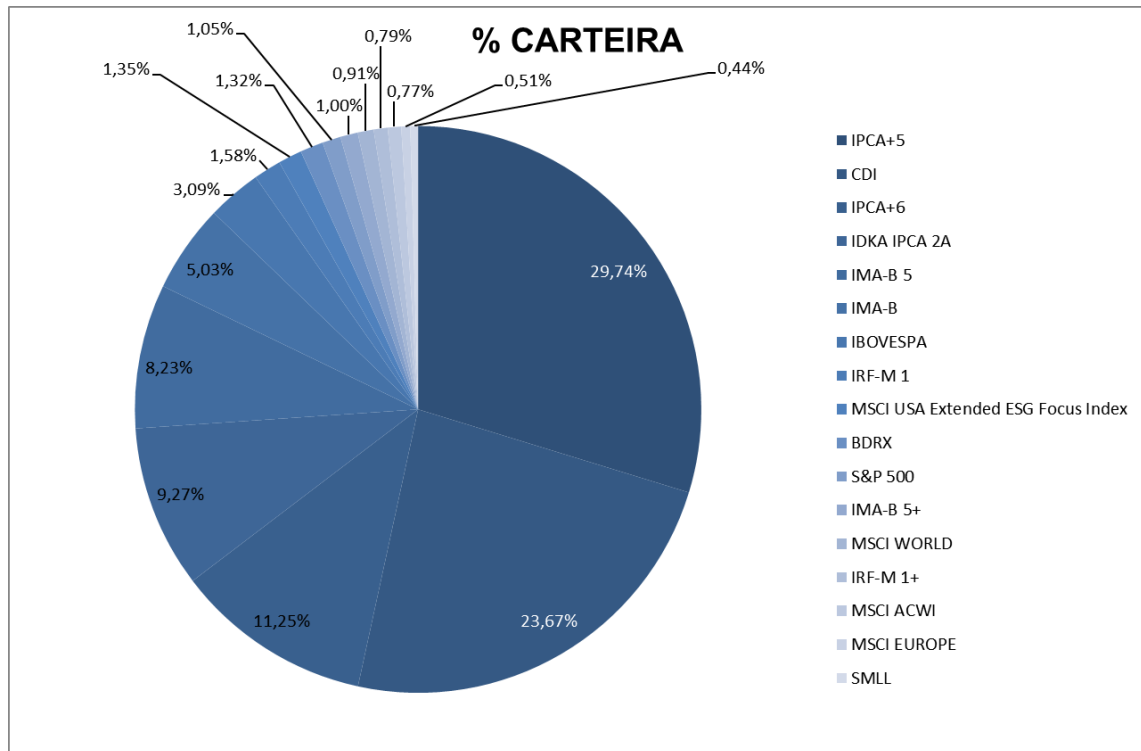
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022								
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2022	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total	
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		66,89%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$2.360.658.414,88	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	1,58%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	1,12% ✓	R\$55.702.214,11	
BB PREVID RF IDKA 2 FI	IDKA 2A	3,91%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	1,45% ✓	R\$138.143.086,36	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF	IDKA 2A	5,36%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	1,80% ✓	R\$189.072.847,41	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	IMA-B 5	3,77%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	2,03% ✓	R\$133.134.301,17	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	IMA-B 5	4,46%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	1,51% ✓	R\$157.256.458,88	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	IMA-B 5+	1,00%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	4,71% ✓	R\$35.322.521,44	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	IPCA+6%	10,75%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	12,37% ✓	R\$379.537.340,10	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	6,20%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	11,07% ✓	R\$218.919.189,09	
FI CAIXA BRASIL 2022 I TP RF	IPCA+6%	0,50%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	17,22% ✓	R\$17.475.181,30	
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	IPCA+5%	23,53%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	22,16% ✓	R\$830.552.001,60	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	IMA-B	5,03%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	6,83% ✓	R\$177.541.029,15	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+	IRF-M 1+	0,79%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	22,23% ✓	R\$28.002.244,27	
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		19,77%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$697.670.658,20	
BB PREVID RF PERFIL FI EM COTAS	CDI	11,46%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	3,95% ✓	R\$404.528.559,91	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO	CDI	0,04%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,04% ✓	R\$1.256.932,53	
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	8,27%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	2,25% ✓	R\$291.885.061,79	
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$103,97	
Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior		0,02%	5,00% ✓	0,50% ✓	20,00% ✓	5,00% ✓	R\$798.697,19	
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA -	CDI	0,02%	5,00% ✓	0,50% ✓	20,00% ✓	3,64% ✓	R\$798.697,19	
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		4,58%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$161.622.067,84	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE F	IBOVESPA	0,42%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	9,22% ✓	R\$14.733.678,70	
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,43%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	5,82% ✓	R\$15.140.313,56	
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,53%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	4,76% ✓	R\$18.869.381,34	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	1,05%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	2,34% ✓	R\$37.017.585,33	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	0,49%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	1,73% ✓	R\$17.399.426,61	
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	0,20%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	2,30% ✓	R\$6.938.941,20	
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	0,44%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	2,60% ✓	R\$15.666.480,51	
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	0,49%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	2,61% ✓	R\$17.309.459,63	
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	0,53%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	3,97% ✓	R\$18.546.800,96	
Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior		0,91%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$32.181.744,42	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	0,46%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	1,19% ✓	R\$16.259.785,00	
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	0,45%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	11,08% ✓	R\$15.921.959,42	
Art. 9º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		3,95%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$139.414.937,01	
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,35%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	3,22% ✓	R\$47.780.500,59	
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS - BDR ETF NÍVEL I	MSCI EUROPE	0,51%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	11,75% ✓	R\$17.876.086,25	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO - BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	0,77%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	5,28% ✓	R\$27.142.891,12	
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	1,32%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	1,99% ✓	R\$46.615.459,05	
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		3,88%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$136.980.139,21	
BB PREVIDENCIÁRIO MULT ALOCAÇÃO	CDI	0,10%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	3,02% ✓	R\$3.590.041,59	
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIME	CDI	2,04%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	3,18% ✓	R\$71.847.821,96	
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRAT LIVRE	CDI	0,67%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	8,88% ✓	R\$23.765.179,65	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA	CDI	1,07%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	1,73% ✓	R\$37.777.096,01	
Total:							R\$3.529.326.658,75	



4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

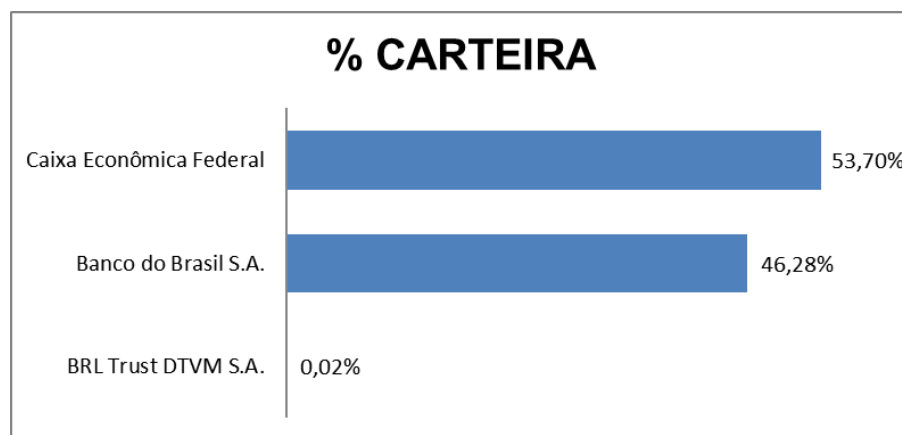
Indicador	Saldo em 31/07/2022	Participação
IPCA+5	R\$1.049.471.190,69	29,74%
CDI	R\$835.449.494,60	23,67%
IPCA+6	R\$397.012.521,40	11,25%
IDKA IPCA 2A	R\$327.215.933,77	9,27%
IMA-B 5	R\$290.390.760,05	8,23%
IMA-B	R\$177.541.029,15	5,03%
IBOVESPA	R\$108.938.002,00	3,09%
IRF-M 1	R\$55.702.214,11	1,58%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$47.780.500,59	1,35%
BDRX	R\$46.615.459,05	1,32%
S&P 500	R\$37.017.585,33	1,05%
IMA-B 5+	R\$35.322.521,44	1,00%
MSCI WORLD	R\$32.181.744,42	0,91%
IRF-M 1+	R\$28.002.244,27	0,79%
MSCI ACWI	R\$27.142.891,12	0,77%
MSCI EUROPE	R\$17.876.086,25	0,51%
SMLL	R\$15.666.480,51	0,44%
Total	R\$3.529.326.658,75	100,00%



4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Rentabilidade	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$798.697,19	-0,11%	0,02%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.633.216.979,69	1,09%	46,28%
Caixa Econômica Federal	R\$1.895.310.981,87	0,64%	53,70%





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



5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

MOVIMENTAÇÕES

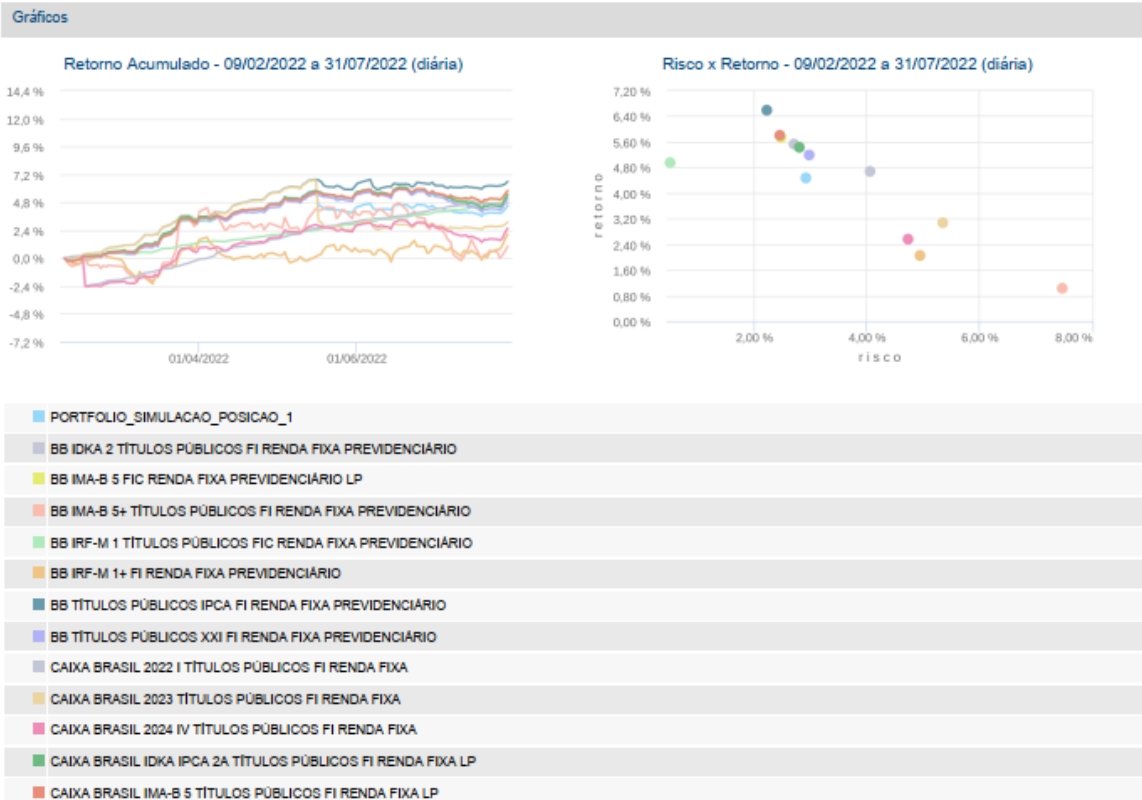
APLICAÇÕES		
Data	Valor	Ativo
01/07/2022	R\$1.983,52	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
04/07/2022	R\$219.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI
05/07/2022	R\$227.454,61	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
05/07/2022	R\$1.000,00	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
06/07/2022	R\$1.160.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
07/07/2022	R\$213.244.650,38	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
07/07/2022	R\$6.719.406,28	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
08/07/2022	R\$4.170.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
08/07/2022	R\$6.706.377,10	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
11/07/2022	R\$2.493,70	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
12/07/2022	R\$603,61	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
12/07/2022	R\$35.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5+ LP
13/07/2022	R\$35.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
13/07/2022	R\$393,03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
14/07/2022	R\$3.000.000,00	BB AÇÕES AGRO FIC DE FI
14/07/2022	R\$3.000.000,00	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC
14/07/2022	R\$699,29	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
14/07/2022	R\$41.000.000,00	CAIXA FI BRASIL DI LP
15/07/2022	R\$50.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
15/07/2022	R\$26.965,06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
15/07/2022	R\$3.000.000,00	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI
15/07/2022	R\$3.000.000,00	FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR
15/07/2022	R\$3.000.000,00	FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE
15/07/2022	R\$3.000.000,00	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO
19/07/2022	R\$1.481,11	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
20/07/2022	R\$288.347,71	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
22/07/2022	R\$3.283,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
25/07/2022	R\$10.285.257,03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
26/07/2022	R\$1.170.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
28/07/2022	R\$103.932,09	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

RESGATES		
Data	Valor	Ativo
04/07/2022	R\$219.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
04/07/2022	R\$267.603,73	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
06/07/2022	R\$1.159.500,75	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
07/07/2022	R\$219.951.027,48	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL
08/07/2022	R\$6.719.855,27	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
08/07/2022	R\$5.897,83	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
12/07/2022	R\$35.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
13/07/2022	R\$35.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI
14/07/2022	R\$9.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
14/07/2022	R\$50.000.000,00	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP
15/07/2022	R\$50.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI
26/07/2022	R\$9.470.586,42	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
27/07/2022	R\$8.279,99	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

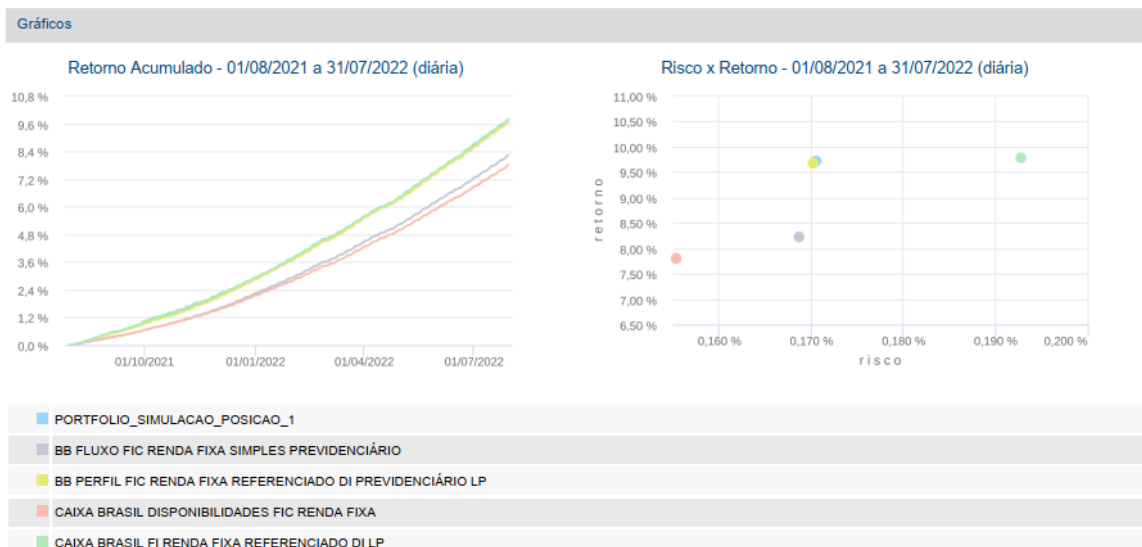
TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$642.114.327,52
Resgates	-R\$635.582.751,47
Saldo	R\$6.531.576,05

6. MONITORAMENTO DE RISCOS

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

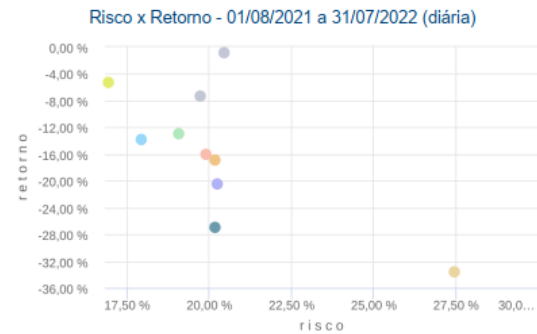


6.2. ART. 7º, INCISO III, “A” – FUNDOS DE RENDA FIXA CVM



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

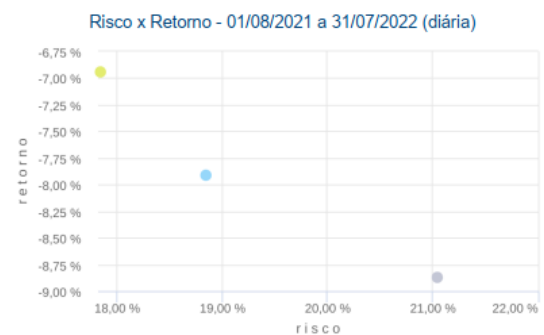
Gráficos



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES
BB AGRO FIC AÇÕES
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES

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

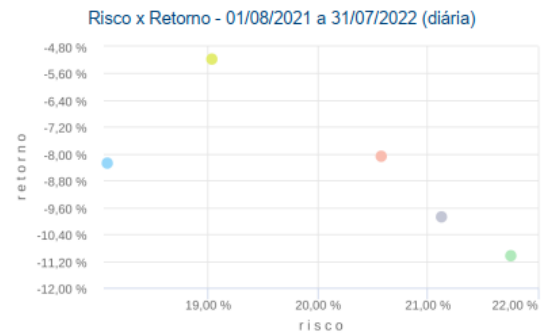
Gráficos



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO
BB NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO

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

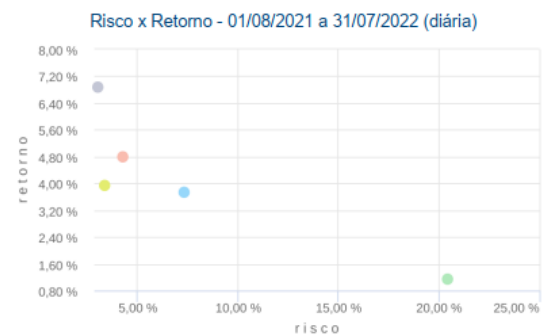
Gráficos



PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I

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

Gráficos



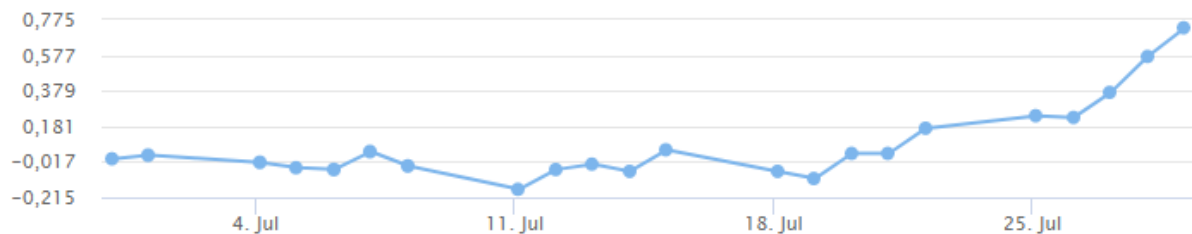
PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP



7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

7.1. RENTABILIDADE

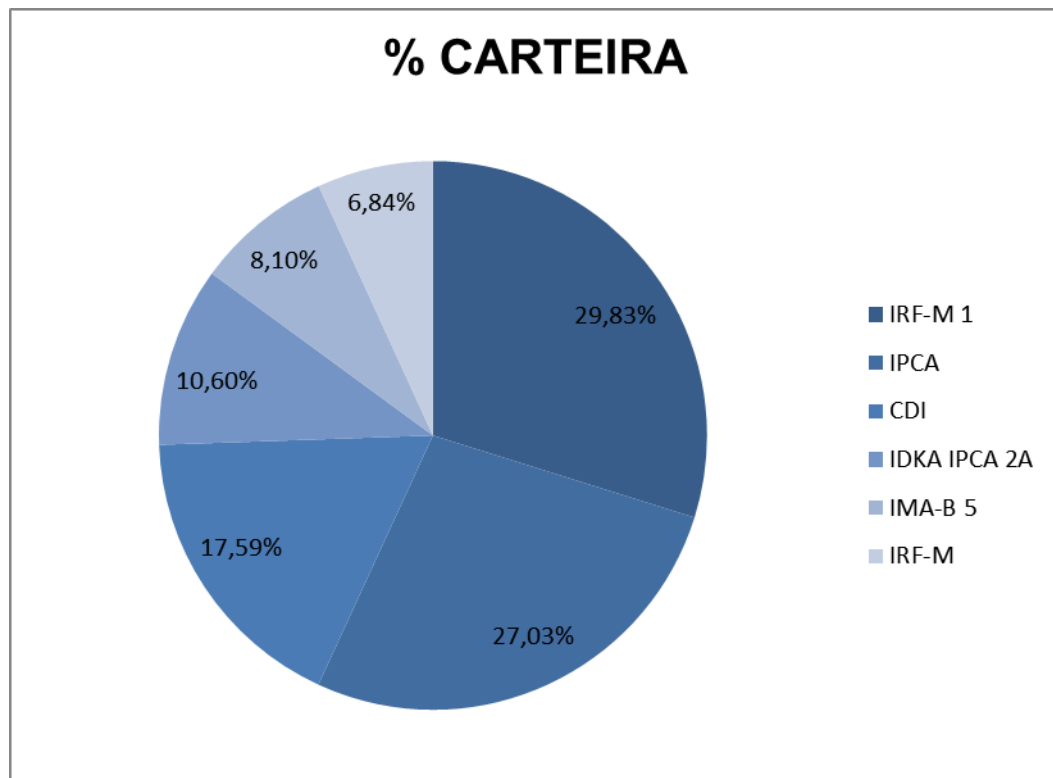
A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,73% no mês de julho, totalizando um saldo de R\$ 199.456.260,85 (cento e noventa e nove milhões e quatrocentos e cinquenta e seis mil e duzentos e sessenta reais e oitenta e cinco centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira ao longo do mês.



7.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

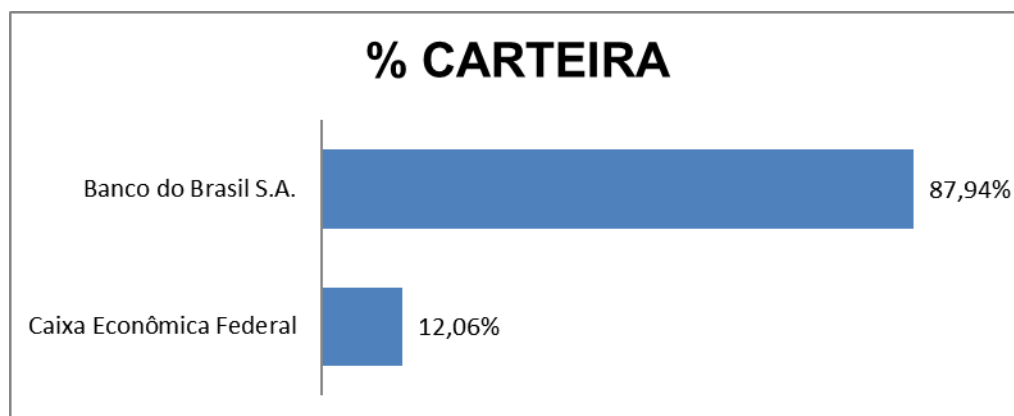
Indicador	Saldo em 31/07/2022	Participação
IRF-M 1	R\$59.506.467,74	29,83%
IPCA	R\$53.919.711,57	27,03%
CDI	R\$35.086.376,38	17,59%
IDKA IPCA 2A	R\$21.141.658,72	10,60%
IMA-B 5	R\$16.156.187,50	8,10%
IRF-M	R\$13.645.858,94	6,84%
	R\$199.456.260,85	100,00%



7.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$24.046.418,93	12,06%
Banco do Brasil S.A.	R\$175.409.841,92	87,94%





8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

8.1. RENTABILIDADE

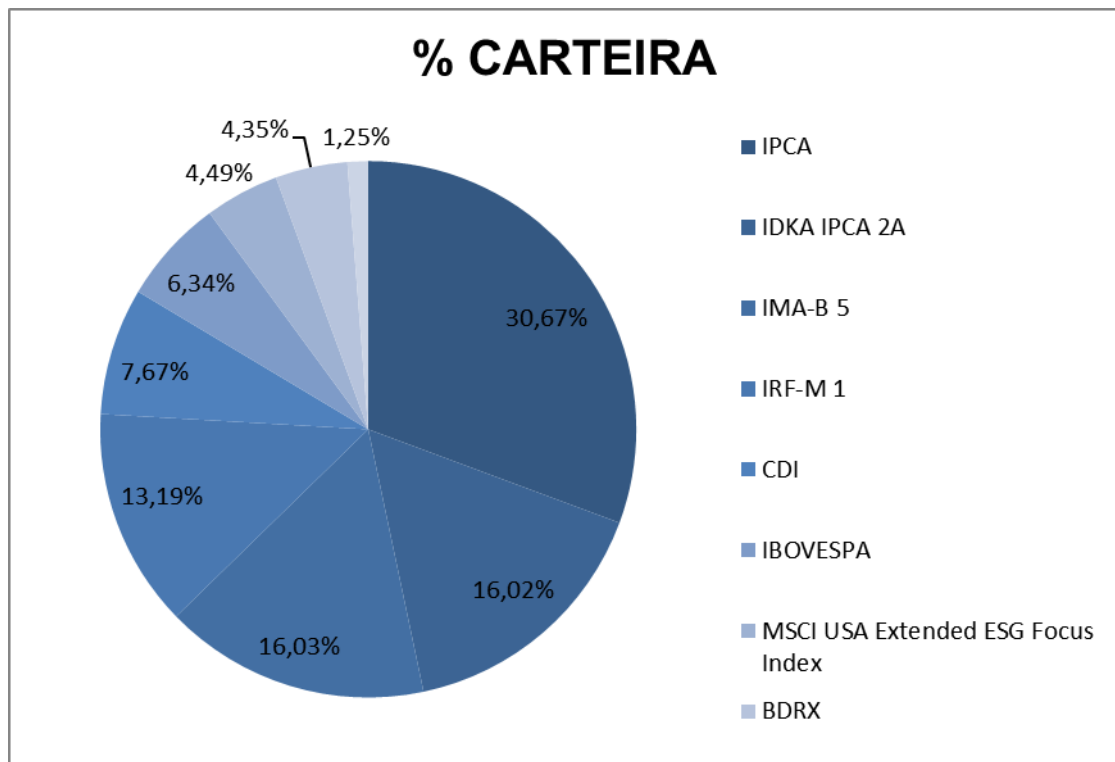
A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado de 1,57% e fechou o mês com o saldo de R\$ 23.393.750,97 (vinte e três milhões e trezentos e noventa e três mil e setecentos e cinquenta reais e noventa e sete centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de julho.



8.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

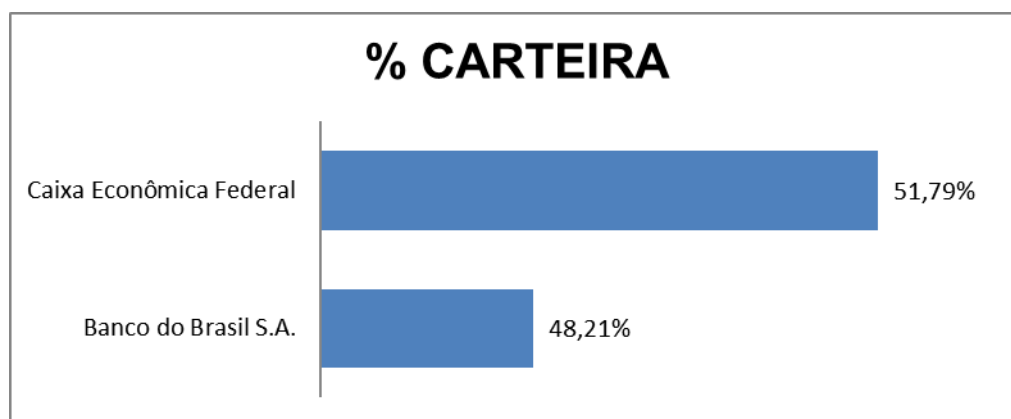
Indicador	Saldo em 31/07/2022	Participação
IPCA	R\$7.174.034,71	30,67%
IDKA IPCA 2A	R\$3.748.277,83	16,02%
IMA-B 5	R\$3.748.854,89	16,03%
IRF-M 1	R\$3.086.421,07	13,19%
CDI	R\$1.793.687,63	7,67%
IBOVESPA	R\$1.483.412,40	6,34%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.049.844,06	4,49%
BDRX	R\$1.017.469,63	4,35%
SMLL	R\$291.748,75	1,25%
	R\$23.393.750,97	100,00%



8.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

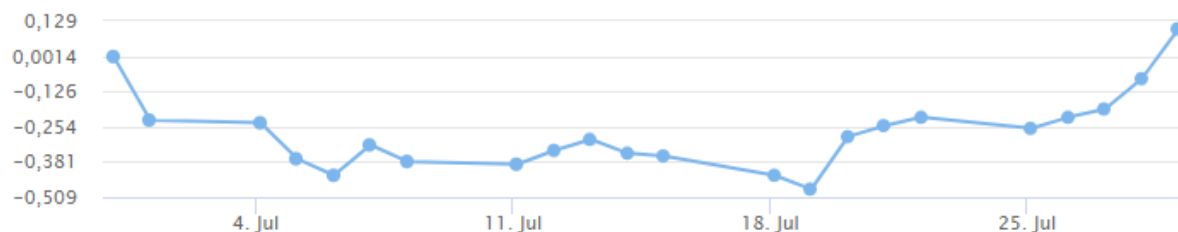
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$11.277.452,13	48,21%
Caixa Econômica Federal	R\$12.116.298,84	51,79%



9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

9.1. RENTABILIDADE

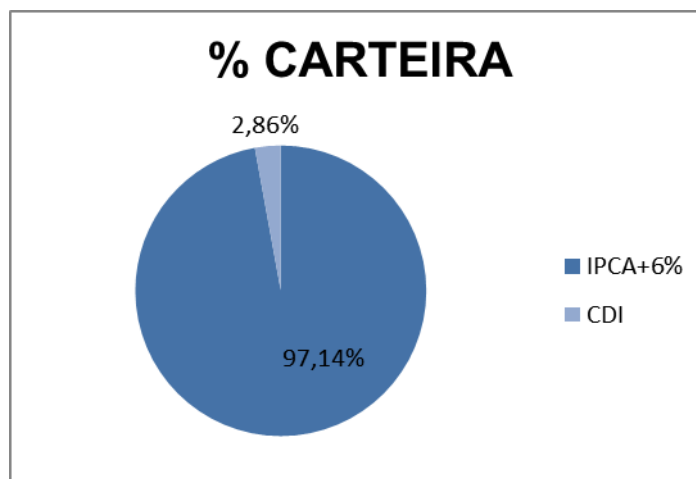
A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de 0,10% e fechou o mês com o saldo de R\$ 16.408.894,50 (dezesesseis milhões e quatrocentos e oito mil e oitocentos e noventa e quatro reais e cinquenta centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de julho.



9.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 31/07/2022	Participação
IPCA+6%	R\$15.939.565,35	97,14%
CDI	R\$469.329,15	2,86%
	R\$16.408.894,50	100,00%

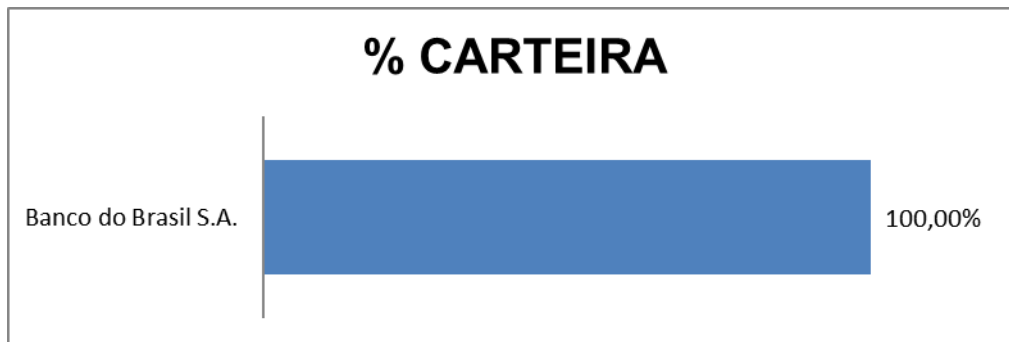




9.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$16.408.894,50	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 IMA-B 5+ LP	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 TP XXI FI	0,20%	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 MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	0,20%	0,00%



11. CONCLUSÃO

O Macaeprev encerrou o mês de julho de 2022 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 3.768.585.565,07 (três bilhões e setecentos e sessenta e oito milhões e quinhentos e oitenta e cinco mil e quinhentos e sessenta e cinco reais e sete centavos).

Macaé, 24 de agosto de 2022.

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



MACAEPREV
Processo Nº 311231/22
Fls Nº 71
Rubrica


PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

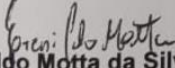
Aos vinte e quatro dias do mês de agosto de 2022, o Comitê de Investimentos, ordinariamente, reuniu-se via plataforma de reunião *Google Hangouts Meet*, para apresentação e análise dos investimentos, acompanhamento da rentabilidade, dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação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

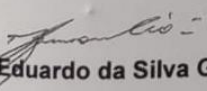
Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos o qual segue na íntegra na ata do dia de hoje, 24 de agosto de 2022.

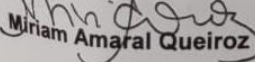
Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de Julho de 2022, e que foram devidamente fundamentadas e registradas nas atas de reunião do Comitê.


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 **JULHO de 2022**, o qual segue para aprovação do Conselho Fiscal. É o parecer.

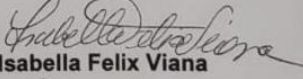

Alfredo Tanhos Filho

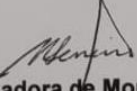

Erenildo Motta da Silva Júnior

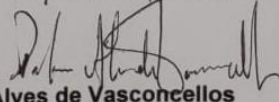

José Eduardo da Silva Guinâncio


Miriam Amaral Queiroz


Claudio de Freitas Duarte


Isabella Felix Viana


Maria Auxiliadora de Moura Ferreira


Patric Alves de Vasconcellos




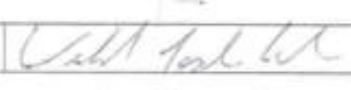

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
JULHO DE 2022

TERMO DE APROVAÇÃO CONSELHO FISCAL

Ao dia 08/09/2022, 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 **JULHO de 2022**. Considerando todas as informações constantes no presente relatório, **APROVAMOS** o relatório de investimentos referente à **JULHO DE 2022**.

Macaé, 08 de setembro de 2022.

CONSELHO FISCAL

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