

# RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



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



**AGOSTO - 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 .....	13
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 .....	19
<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 agosto 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 agosto, o cenário internacional continuou desafiador. As taxas de inflação nos países desenvolvidos continuam em elevação e as políticas monetárias dos bancos centrais continuam atrasadas. Este fator foi agravado pela invasão da Ucrânia pela Rússia, dois grandes produtores e exportadores de commodities alimentares e energéticas. Com isto, a expectativa é de aumentos das taxas de juros e desaceleração da economia global nos próximos meses.

Na China, a situação continua crítica em relação à política de Covid zero, e o fim do crescimento do setor imobiliário tem trazido muita volatilidade, com boicote de compradores ao pagamento de hipotecas, devido aos atrasos nas entregas de novas residências, que representa 25% do PIB do país. Adicionalmente, em razão das altas temperaturas e secas registradas, o país também está com problemas sérios na produção de energia elétrica. Entretanto, o governo chinês tem buscado implementar políticas de estímulos econômicos, na tentativa de estimular a economia.

A produção industrial na China desacelerou de 3,9% para 3,8% (A/A) em julho (divulgado em agosto). Com o dado, o setor industrial acumulou alta de 3,5% no ano. Já o varejo desacelerou de 3,1% para 2,7% (A/A). Quanto à política monetária, no mês, o PBoC (People's Bank of China) informou a redução da taxa de referência para empréstimos – LPR (loan prime rate) de 1 ano, de 3,70% para 3,65%; e de 5 anos, de 4,45% para 4,30%. A



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



medida visa contribuir com a estabilização da economia chinesa, diante da frustração com os principais indicadores econômicos.

O crescimento das exportações chinesas desacelerou acentuadamente em agosto. As exportações da China cresceram 7,1% em agosto, em relação ao mesmo mês no ano anterior, mas abaixo do crescimento de 18% em julho, de acordo a Administração Geral de Alfândegas da China. As importações cresceram 0,3%, ante 2,3% em julho. A desaceleração do comércio, acima das previsões dos analistas, ocorreu em meio a uma queda na demanda global por produtos chineses devido à ameaça de recessão nos Estados Unidos e uma recuperação nos preços da energia.

No fim do mês de agosto, aconteceu nos Estados Unidos o simpósio de Jackson Hole, conferência anual de política monetária em que dirigentes do Federal Reserve (Fed), economistas, empresários e políticos tentam esclarecer os rumos da principal economia do mundo nos próximos meses e anos. O discurso mais aguardado era o do presidente do Fed, Jerome Powell, que permaneceu com uma postura hawkish, ou seja, mais firme e forte no enfrentamento da inflação (mais alta dos últimos 40 anos), mesmo que isso cause uma desaceleração econômica no país. Essas declarações mais duras geraram uma aversão ao risco de forma generalizada nos mercados e trouxeram muita volatilidade, principalmente para as Bolsas norte-americanas.

Acerca dos indicadores divulgados no mês, a inflação medida pelo índice CPI mostrou desaceleração relevante, passando de 1,3% em junho para 0,0% em julho. Com isso, o índice acumulado em 12 meses também desacelerou de maneira importante, de 9,1% para 8,5%. Já a produção industrial passou de 0,0 M/M em junho para um avanço de 0,6% em julho. Quanto ao mercado de trabalho, a economia norte-americana criou 528 mil vagas líquidas de emprego não-agrícola, mais que o dobro da expectativa de mercado que era de 250 mil.

Na Europa, o cenário não foi muito diferente. Ao registrar recorde histórico em termos de inflação, o Banco Central Europeu (BCE) também vem adotando postura mais hawkish para política monetária. O CPI de julho acelerou de 8,6% para 8,9% (A/A), representando a maior taxa da série histórica, após superar o indicador do mês passado. Entre os vetores altistas, destaque, mais uma vez, para “energia” (5,40%), além do grupo “Alimentos, Bebidas e Tabaco” (8,90% para 9,80%). Além da inflação, a região também vem



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



sofrendo com relação ao fornecimento de gás russo para a produção de energia, além do próprio conflito armado, que traz repercussões econômicas e geopolíticas.

A produção industrial cresceu 0,7% (M/M) no mês de junho, com revisão nos dados de maio de 0,8% para 2,1%. Em relação a junho de 2021, o indicador registrou crescimento de 2,4%. Entre as maiores economias do bloco, houve crescimento do setor na Alemanha (0,6% ante 0,1% M/M), na França (1,3% ante 0,3% M/M), na Itália (1,2% ante 0,4% M/M) e na Espanha (1,0% ante 0,0% M/M).

Por outro lado, o volume de vendas do comércio varejista recuou 1,2% (M/M). Já no indicador anualizado, o volume de vendas no varejo do Bloco variou -3,7% (A/A) no dado ajustado pelo calendário, vindo significativamente abaixo da expectativa de mercado (-1,7%). Entre as maiores economias do bloco, destaque para variação do indicador na Alemanha em -8,8% (A/A) após -2,9% A/A do mês anterior, enquanto a França registrou alta de 0,6% ante avanço de 5,1% (A/A) no último mês.

Apesar deste cenário internacional desafiador, a economia brasileira tem se mostrado bastante resiliente. Após um período de aceleração da taxa de inflação, que forçou o Banco Central do Brasil a iniciar o processo de ajuste da taxa de juros, levando-a de 2,0% para 13,75% ao ano entre março de 2021 e agosto de 2022. Agora, os sinais de arrefecimento da taxa de inflação começam a aparecer. Sinais estes reforçados pela queda dos preços das commodities e pela redução das alíquotas de ICMS de energia elétrica, telecomunicações, transporte coletivo e combustíveis, aprovadas pelo Congresso.

A economia brasileira cresceu 1,2% no segundo trimestre de 2022, apontou o Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE), e o número está acima da expectativa que os economistas tinham no começo do ano, que era de 0,5%. Hoje, as apostas estão por volta de 2%. Alguns dos motivadores para o resultado do PIB foram: a política de expansionismo fiscal, ou seja, a PEC dos precatórios; e as medidas com relação ao fundo de garantia, como a antecipação do décimo terceiro salário.

A balança comercial brasileira fechou o mês de agosto com superávit de US\$ 4,16 bilhões, o que elevou o saldo positivo acumulado no ano para US\$ 44,05 bilhões, segundo dados divulgados pela Secretaria de Comércio Exterior (Secex) do Ministério da Economia. O resultado do mês representa uma queda de 48% em relação a agosto de 2021 e de 15,8% sobre o período de janeiro a agosto do ano passado, pela média diária. Já a corrente de comércio aumentou 17,6% em agosto e alcançou US\$ 57,51 bilhões, refletindo a soma das exportações,



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



que cresceram 8,4% e chegaram a US\$ 30,84 bilhões, e das importações, que subiram 30,5% e totalizaram US\$ 26,68 bilhões no mês. Segundo a Secex, esse foi o maior valor das exportações para o mês de agosto. Também foram os maiores valores de importação e de corrente de comércio para todos os meses, desde o início da série histórica, em 1997. No acumulado dos oito meses, a corrente de comércio cresceu 23,9%, atingindo US\$ 406,13 bilhões. As exportações no período cresceram 18,4% e somaram US\$ 225,09 bilhões, enquanto as importações aumentaram 31,5% e totalizaram US\$ 181,04 bilhões. Esses valores de corrente, exportações e importações também foram os maiores da série histórica para o período de janeiro a agosto, de acordo com a Secex.

Os indicadores de atividade divulgados em agosto, referentes a junho, apresentaram os seguintes resultados: A produção industrial recuou 0,4% (M/M), interrompendo a sequência das quatro altas seguidas. O varejo restrito recuou 1,4% (M/M), ante -0,4% (M/M) em maio, desempenho significativamente abaixo da média para o mês. Por outro lado, o volume de serviços cresceu 0,7% (M/M), resultado positivo que foi disseminado, com 4 das 6 atividades avançando.

Acerca do mercado de trabalho, o saldo de empregos formais do CAGED foi de 218.902 vagas, puxado, mais uma vez, por Serviços (80.873). Os saldos positivos e significativos dos contratos de trabalhos intermitentes (não contínuos) vêm chamando a atenção nesse segmento, refletindo os efeitos da reforma trabalhista. Além disso, o setor de comércio (38.574), mais uma vez, deu sustentação adicional ao resultado.

O Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA), considerado a inflação oficial do país, fechou o mês de agosto com queda de 0,36%. No acumulado de 12 meses, a inflação ficou em 8,73%, fazendo o Brasil voltar a um dígito de inflação, o que não ocorria desde setembro de 2021. Nos oito meses deste ano até agosto, a alta acumulada é de 4,39%.

Usualmente, uma deflação acontece quando a economia está desacelerada. Mas, no caso do Brasil, as quedas têm sido puxadas sobretudo pelas desonerações de insumos como combustíveis e energia elétrica, aprovadas em junho no Congresso, além de preços menores do petróleo no mercado internacional.

Em agosto, o maior impacto negativo sobre o IPCA veio novamente dos combustíveis, que tiveram queda de 10,82% no mês. Apesar das quedas, o gerente de pesquisa do IBGE, Pedro Kislakov, aponta que houve uma deflação menos intensa em agosto do que em julho. “Alguns fatores explicam a queda menor em relação a julho. Um deles é a



retração menos intensa da energia elétrica (-1,27%), que havia sido de 5,78% no mês anterior, em consequência da redução das alíquotas de ICMS", disse em nota. "Também houve aceleração de alguns grupos, como saúde e cuidados pessoais (1,31%) e vestuário (1,69%), e a queda menos forte do grupo de transportes em agosto. No mês anterior, o preço da gasolina, que é o item de maior peso no grupo, tinha caído 15,48% e, em agosto, a retração foi menor (-11,64%)."

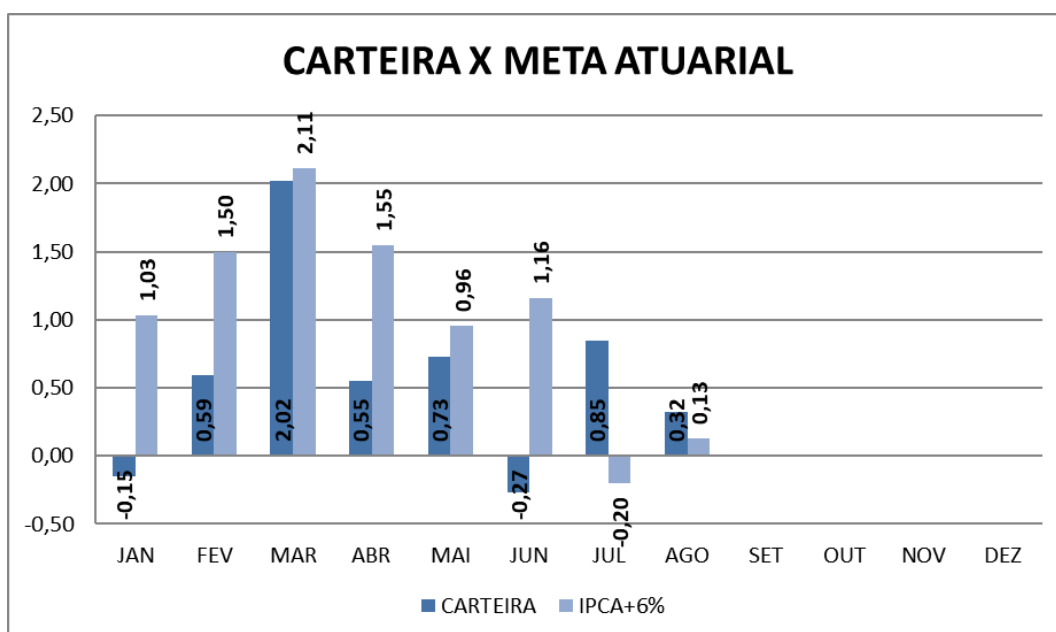
Assim, apesar de o IPCA ter mostrado a direção esperada, a parte estrutural permanece indicando um processo de desinflação lento, após dissipados os efeitos baixistas das reduções tributárias recentes.

### 3. RESULTADO DA CARTEIRA

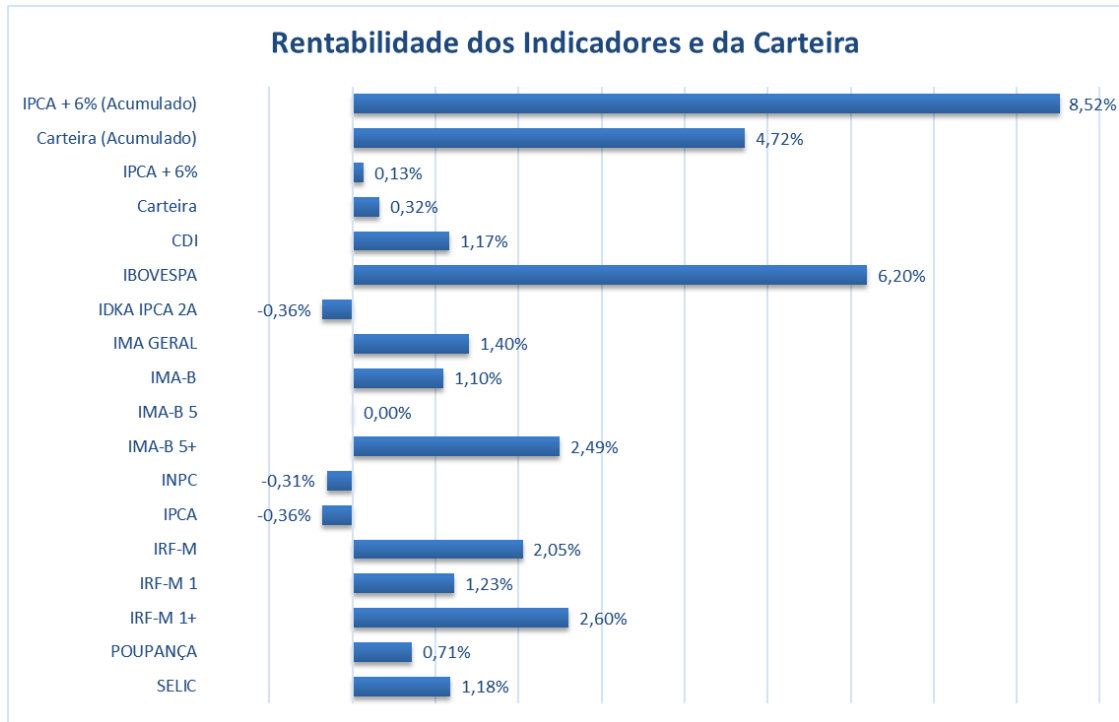
No mês de agosto, nosso portfólio teve desempenho superior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com alta de 0,32%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 6%, foi de 0,13%. Superamos com folga a meta para esse período. Nos quadros a seguir pode-se observar o desempenho da Carteira em 2022.

#### HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

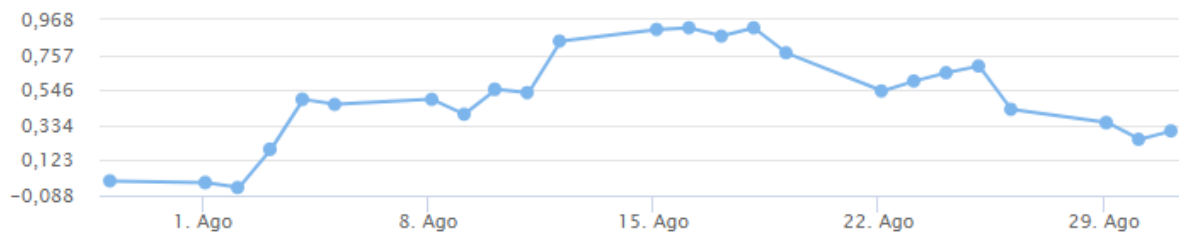
2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
CARTEIRA	-0,15	0,59	2,02	0,55	0,73	-0,27	0,85	0,32					4,72
IPCA+6%	1,03	1,50	2,11	1,55	0,96	1,16	-0,20	0,13					8,52



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 agosto.



Os destaques do mês foram os fundos de ações brasileiras com os fundos Caixa Small Caps Ativo e BB Ações Retorno Total que renderam, respectivamente, 10,67% e 8,77%. Em média, os fundos de ações brasileiras apresentaram rentabilidade de 7,28%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno negativo médio de -3,29%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno negativo de -4,45%. Os fundos de investimento no exterior caíram, em média, -2,18%. Os fundos multimercado tiveram uma rentabilidade de 2,27%.





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



O fundo de vértice Caixa FI Brasil 2022 I TP RF teve um retorno de -0,06%, o fundo Caixa FI Brasil 2023 TP RF rendeu -0,14%, o fundo BB Previdenciário RF TP IPCA FI rendeu -0,14%, o fundo BB Previdenciário RF TP XXI FI rendeu -0,16%, enquanto o Caixa FI Brasil 2024 IV TP RF rendeu -0,18%.

Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 1,17%. Os fundos IMA-B 5 tiveram um retorno de 0,03%. O fundo IMA-B 5+ teve retorno de 2,45%. O fundo indexado ao IRF-M 1+ teve um retorno de 2,60%. O fundo IRF-M 1 teve um retorno de 1,20%. Enquanto os fundos IDKA 2A tiveram rendimento negativo de -0,08%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade de 0,42%. Até 31/08/2022 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 agosto, o fundo apresentou resultado de R\$ 3.335,55 (três mil e trezentos e trinta e cinco reais e cinquenta e cinco centavos). O saldo em 31 de agosto estava em R\$ 802.032,70 (oitocentos e dois mil e trinta e dois reais e setenta 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.



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



O rendimento de agosto da Carteira do Instituto foi de R\$ 10.578.337,30 (dez milhões e quinhentos e setenta e oito mil e trezentos e trinta e sete reais e trinta centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de agosto em R\$ 3.548.708.747,00 (três bilhões e quinhentos e quarenta e oito milhões e setecentos e oito mil e setecentos e quarenta e sete reais).



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



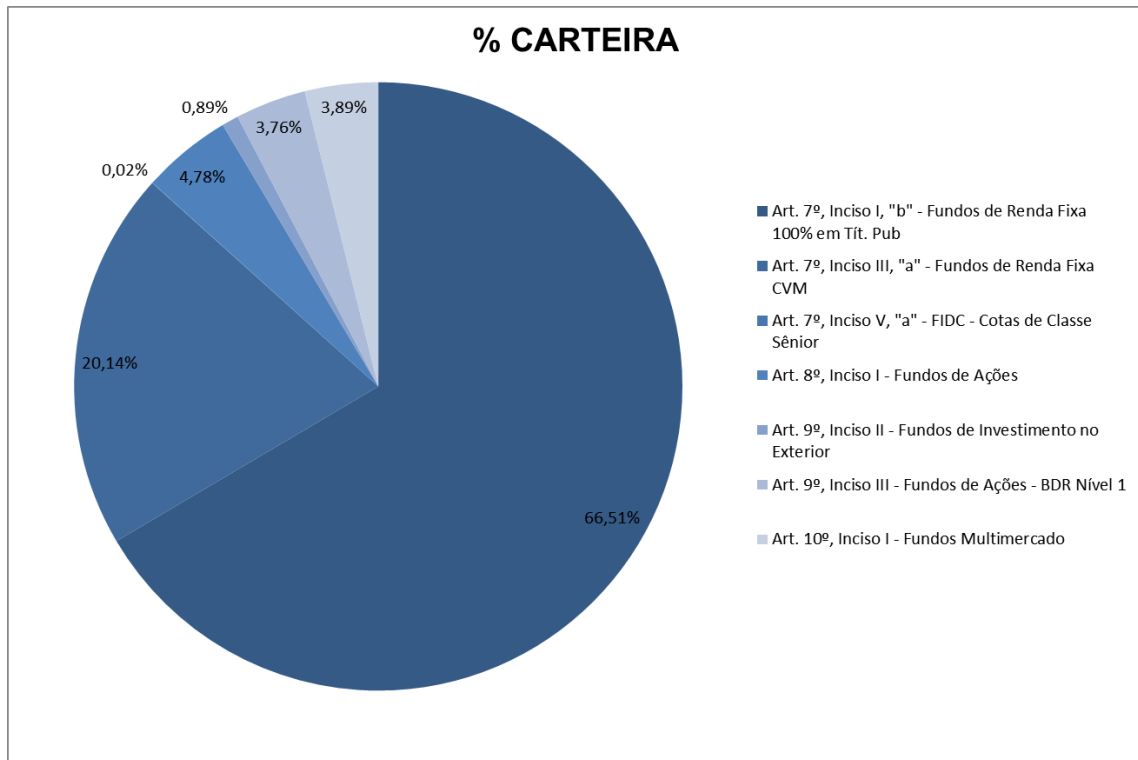
**SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS**

Fundo de Investimento	Saldo em 31/07/2022	Saldo em 31/08/2022	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	R\$17.475.181,30	R\$0,00	-R\$17.464.595,90	-R\$10.585,40	-0,06%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$103,97	R\$10.262,48	R\$2,17	R\$10.156,34	0,04%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$798.697,19	R\$802.032,74	R\$0,00	R\$3.335,55	0,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$1.256.932,53	R\$1.193.141,22	-R\$74.204,95	R\$10.413,64	0,10%
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	R\$3.590.041,59	R\$3.629.086,41	R\$0,00	R\$39.044,82	1,09%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$6.938.941,20	R\$7.370.225,00	R\$0,00	R\$431.283,80	6,22%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$15.921.959,42	R\$15.484.095,33	R\$0,00	-R\$437.864,09	-2,75%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$14.733.678,70	R\$15.665.530,86	R\$0,00	R\$931.852,16	6,32%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$16.259.785,00	R\$15.999.001,74	R\$0,00	-R\$260.783,26	-1,60%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$15.140.313,56	R\$16.053.793,35	R\$0,00	R\$913.479,79	6,03%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	R\$17.876.086,25	R\$16.713.398,63	R\$0,00	-R\$1.162.687,62	-6,50%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$15.666.480,51	R\$17.338.579,27	R\$0,00	R\$1.672.098,76	10,67%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$17.309.459,63	R\$18.501.905,87	R\$0,00	R\$1.192.446,24	6,89%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$17.399.426,61	R\$18.925.189,19	R\$0,00	R\$1.525.762,58	8,77%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$18.546.800,96	R\$19.728.497,54	R\$0,00	R\$1.181.696,58	6,37%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$18.869.381,34	R\$20.181.408,88	R\$0,00	R\$1.312.027,54	6,95%
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	R\$23.765.179,65	R\$24.596.017,30	R\$0,00	R\$830.837,65	3,50%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$27.142.891,12	R\$26.227.282,06	R\$0,00	-R\$915.609,06	-3,37%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$28.002.244,27	R\$28.729.626,44	R\$0,00	R\$727.382,17	2,60%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$37.017.585,33	R\$35.780.324,49	R\$0,00	-R\$1.237.260,84	-3,34%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	R\$35.322.521,44	R\$36.186.827,72	R\$0,00	R\$864.306,28	2,45%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$37.777.096,01	R\$36.553.432,33	R\$0,00	-R\$1.223.663,68	-3,24%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$46.615.459,05	R\$44.790.411,31	R\$0,00	-R\$1.825.047,74	-3,92%
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	R\$47.780.500,59	R\$45.858.065,35	R\$0,00	-R\$1.922.435,24	-4,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	R\$55.702.214,11	R\$56.373.019,18	R\$0,00	R\$670.805,07	1,20%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	R\$71.847.821,96	R\$73.437.664,98	R\$0,00	R\$1.589.843,02	2,21%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	R\$133.134.301,17	R\$133.142.441,61	R\$0,00	R\$8.140,44	0,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	R\$138.143.086,36	R\$138.081.529,73	R\$0,00	-R\$61.556,63	-0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$157.256.458,88	R\$157.331.329,58	R\$0,00	R\$74.870,70	0,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	R\$189.072.847,41	R\$188.867.228,97	R\$0,00	-R\$205.618,44	-0,11%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$177.541.029,15	R\$194.646.185,28	R\$22.772.131,98	-R\$359.439,77	-0,18%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$218.919.189,09	R\$218.550.633,09	R\$953,73	-R\$369.509,73	-0,16%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$291.885.061,79	R\$295.350.428,88	R\$0,00	R\$3.465.367,09	1,19%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	R\$379.537.340,10	R\$379.001.270,24	R\$0,00	-R\$536.069,86	-0,14%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$404.528.559,91	R\$418.236.618,88	R\$8.877.000,00	R\$4.831.058,97	1,15%
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	R\$830.552.001,60	R\$829.372.261,07	R\$0,00	-R\$1.179.740,53	-0,14%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$3.529.326.658,75</b>	<b>R\$3.548.708.747,00</b>	<b>R\$14.111.287,03</b>	<b>R\$10.578.337,30</b>	<b>0,32%</b>

#### 4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

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

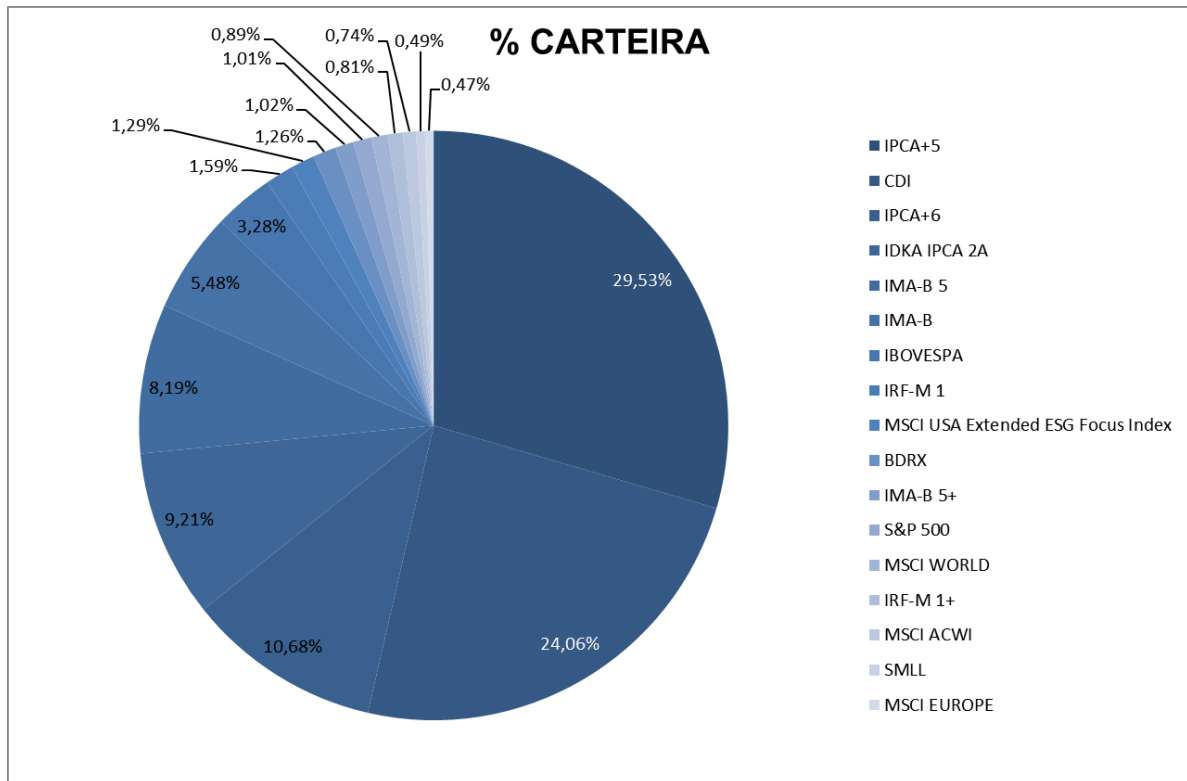
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022								
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2022	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total	
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub</b>		<b>66,51%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$2.360.282.352,91</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	IRF-M 1	1,59%	100,00%	100,00%	100,00%	0,96%	R\$56.373.019,18	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	IDKA 2A	3,89%	100,00%	100,00%	100,00%	1,52%	R\$138.081.529,73	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	5,32%	100,00%	100,00%	100,00%	1,93%	R\$188.867.228,97	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	IMA-B 5	3,75%	100,00%	100,00%	100,00%	2,06%	R\$133.142.441,61	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	4,43%	100,00%	100,00%	100,00%	1,63%	R\$157.331.329,58	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	IMA-B 5+	1,02%	100,00%	100,00%	100,00%	4,62%	R\$36.186.827,72	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	IPCA+6%	10,68%	100,00%	100,00%	100,00%	11,07%	R\$379.001.270,24	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	6,16%	100,00%	100,00%	100,00%	10,10%	R\$218.550.633,09	
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	IPCA+5%	23,37%	100,00%	100,00%	100,00%	21,44%	R\$829.372.261,07	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	5,48%	100,00%	100,00%	100,00%	7,01%	R\$194.646.185,28	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	IRF-M 1+	0,81%	100,00%	100,00%	100,00%	21,50%	R\$28.729.626,44	
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>20,14%</b>	<b>65,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$714.790.451,46</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	11,79%	65,00%	65,00%	20,00%	3,69%	R\$418.236.618,88	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,03%	65,00%	65,00%	20,00%	0,04%	R\$1.193.141,22	
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	8,32%	65,00%	65,00%	20,00%	2,07%	R\$295.350.428,88	
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$10.262,48	
<b>Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior</b>		<b>0,02%</b>	<b>5,00%</b>	<b>0,50%</b>	<b>20,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>R\$802.032,74</b>	
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,02%	5,00%	0,50%	20,00%	3,64%	R\$802.032,74	
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>4,78%</b>	<b>35,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$169.545.454,45</b>	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,44%	35,00%	35,00%	20,00%	9,72%	R\$15.665.530,86	
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,45%	35,00%	35,00%	20,00%	5,99%	R\$16.053.793,35	
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,57%	35,00%	35,00%	20,00%	4,83%	R\$20.181.408,88	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	1,01%	35,00%	35,00%	20,00%	2,42%	R\$35.780.324,49	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	0,53%	35,00%	35,00%	20,00%	1,76%	R\$18.925.189,19	
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	0,21%	35,00%	35,00%	20,00%	2,33%	R\$7.370.225,00	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	0,49%	35,00%	35,00%	20,00%	2,62%	R\$17.338.579,27	
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	0,52%	35,00%	35,00%	20,00%	2,70%	R\$18.501.905,87	
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	0,56%	35,00%	35,00%	20,00%	3,95%	R\$19.728.497,54	
<b>Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior</b>		<b>0,89%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$31.483.097,07</b>	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	0,45%	10,00%	10,00%	20,00%	1,24%	R\$15.999.001,74	
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	0,44%	10,00%	10,00%	20,00%	11,08%	R\$15.484.095,33	
<b>Art. 9º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>3,76%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$133.589.157,35</b>	
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,29%	10,00%	10,00%	20,00%	3,20%	R\$45.858.065,35	
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	MSCI EUROPE	0,47%	10,00%	10,00%	20,00%	11,84%	R\$16.713.398,63	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	0,74%	10,00%	10,00%	20,00%	5,55%	R\$26.227.282,06	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,26%	10,00%	10,00%	20,00%	1,99%	R\$44.790.411,31	
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>3,89%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$138.216.201,02</b>	
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	0,10%	10,00%	10,00%	20,00%	3,02%	R\$3.629.086,41	
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	2,07%	10,00%	10,00%	20,00%	3,30%	R\$73.437.664,98	
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	CDI	0,69%	10,00%	10,00%	20,00%	9,47%	R\$24.596.017,30	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,03%	10,00%	10,00%	20,00%	1,85%	R\$36.553.432,33	
<b>Total:</b>							<b>R\$3.548.708.747,00</b>	



#### 4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

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

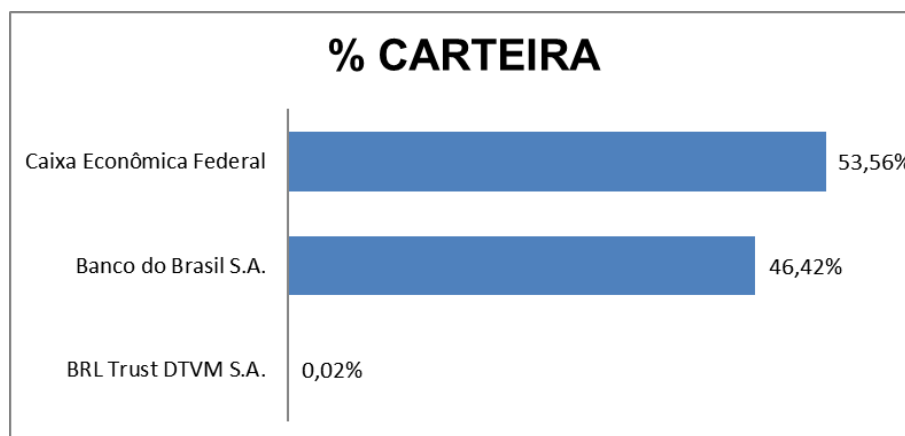
Indicador	Saldo em 31/08/2022	Participação
IPCA+5	R\$1.047.922.894,16	29,53%
CDI	R\$853.808.685,22	24,06%
IPCA+6	R\$379.001.270,24	10,68%
IDKA IPCA 2A	R\$326.948.758,70	9,21%
IMA-B 5	R\$290.473.771,19	8,19%
IMA-B	R\$194.646.185,28	5,48%
IBOVESPA	R\$116.426.550,69	3,28%
IRF-M 1	R\$56.373.019,18	1,59%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$45.858.065,35	1,29%
BDRX	R\$44.790.411,31	1,26%
IMA-B 5+	R\$36.186.827,72	1,02%
S&P 500	R\$35.780.324,49	1,01%
MSCI WORLD	R\$31.483.097,07	0,89%
IRF-M 1+	R\$28.729.626,44	0,81%
MSCI ACWI	R\$26.227.282,06	0,74%
SMLL	R\$17.338.579,27	0,49%
MSCI EUROPE	R\$16.713.398,63	0,47%
<b>Total</b>	<b>R\$3.548.708.747,00</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\$802.032,74	0,42%	0,02%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.647.382.509,40	0,33%	46,42%
Caixa Econômica Federal	R\$1.900.524.204,86	0,31%	53,56%



## 5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

### MOVIMENTAÇÕES

APLICAÇÕES		
Data	Valor	Ativo
01/08/2022	R\$1.983,52	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
02/08/2022	R\$437.363,76	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
03/08/2022	R\$7.299,69	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
05/08/2022	R\$5.900,00	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
08/08/2022	R\$2.777,46	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
09/08/2022	R\$4.600.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
10/08/2022	R\$34.323,28	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
11/08/2022	R\$66.259,17	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
12/08/2022	R\$1.613,09	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
15/08/2022	R\$6.182.046,27	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/08/2022	R\$6.183.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI
16/08/2022	R\$22.772.131,98	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
17/08/2022	R\$3.184,06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
17/08/2022	R\$22.772.131,98	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF
18/08/2022	R\$510.713,98	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
22/08/2022	R\$1.798,48	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
23/08/2022	R\$316.105,31	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
25/08/2022	R\$10.077.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
25/08/2022	R\$1.171.173,37	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
26/08/2022	R\$862,57	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
29/08/2022	R\$509,11	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
30/08/2022	R\$497,65	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

RESGATES		
Data	Valor	Ativo
04/08/2022	R\$709.181,85	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
05/08/2022	R\$689.885,92	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
09/08/2022	R\$290.035,97	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
09/08/2022	R\$5.897,83	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
15/08/2022	R\$6.182.046,27	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI
16/08/2022	R\$6.161.352,86	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/08/2022	R\$17.464.595,90	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA
17/08/2022	R\$22.772.131,98	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
24/08/2022	R\$5.800.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
24/08/2022	R\$962.259,12	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

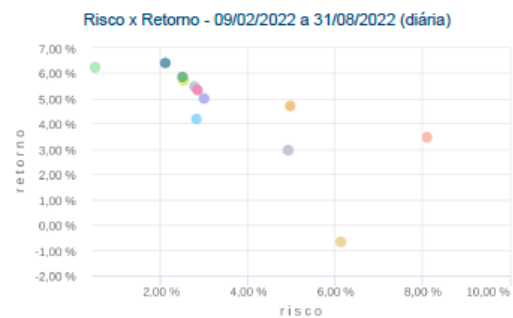
AMORTIZAÇÕES		
Data	Valor	Ativo
16/08/2022	R\$5.307.536,08	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$75.148.674,73
Resgates	-R\$61.037.387,70
Saldo	R\$14.111.287,03

## 6. MONITORAMENTO DE RISCOS

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

#### Gráficos

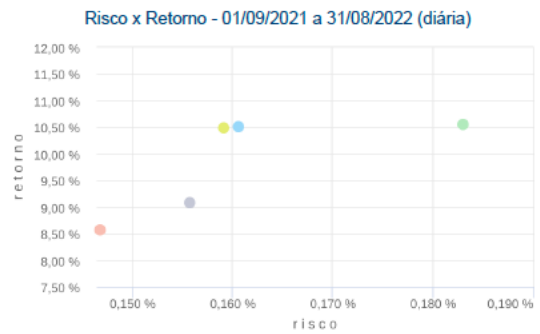
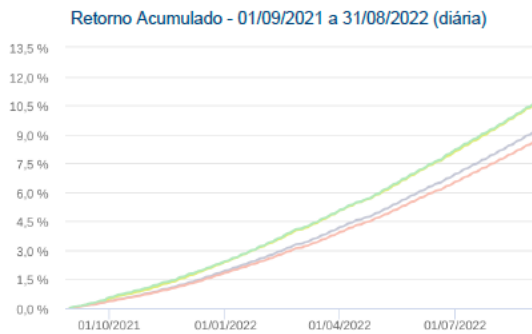


PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP



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

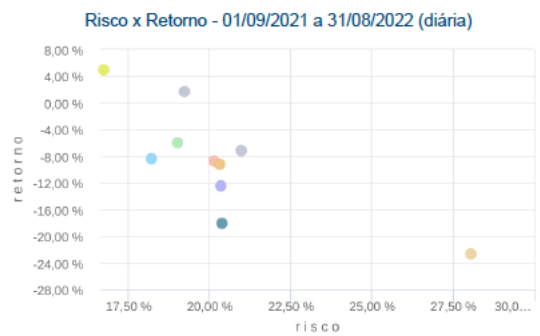
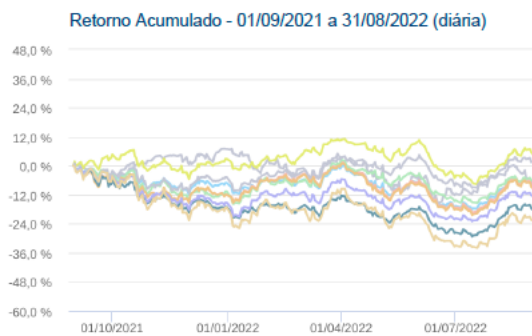
### Gráficos



- PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1
- BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO
- BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP
- CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA
- CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP

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

### Gráficos

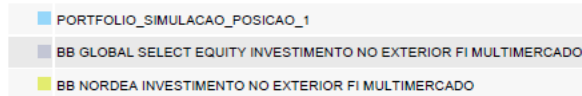
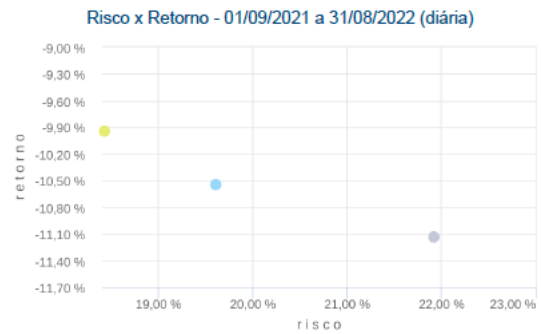


- PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1
- BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES
- BB AGRO FIC AÇÕES
- BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES
- BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES
- BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES
- BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES
- CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES
- CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES
- CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES



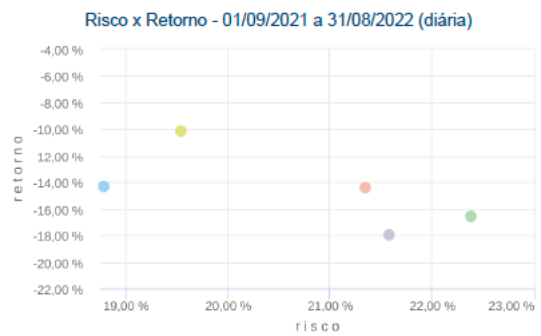
#### 6.4. ART. 9º, INCISO II – FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

##### Gráficos



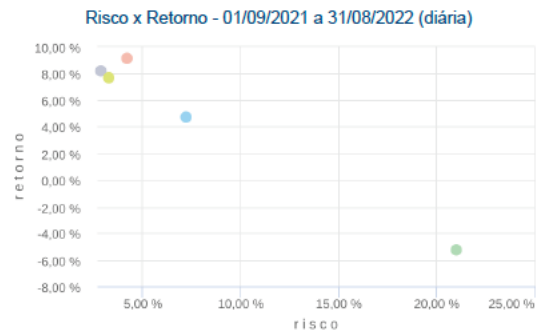
#### 6.5. ART. 9º, INCISO III – FUNDOS DE AÇÕES – BDR NÍVEL I

##### Gráficos



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

### Gráficos

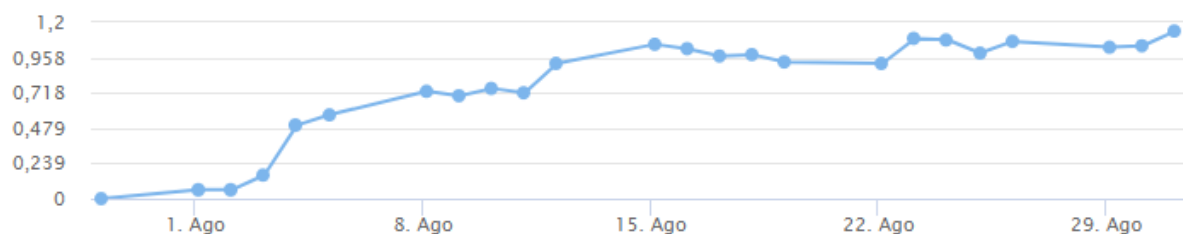


PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP

## 7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

### 7.1. RENTABILIDADE

A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 1,14% no mês de agosto, totalizando um saldo de R\$ 201.087.062,55 (duzentos e um milhões e oitenta e sete mil e sessenta e dois reais e cinquenta e cinco centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira ao longo do mês.

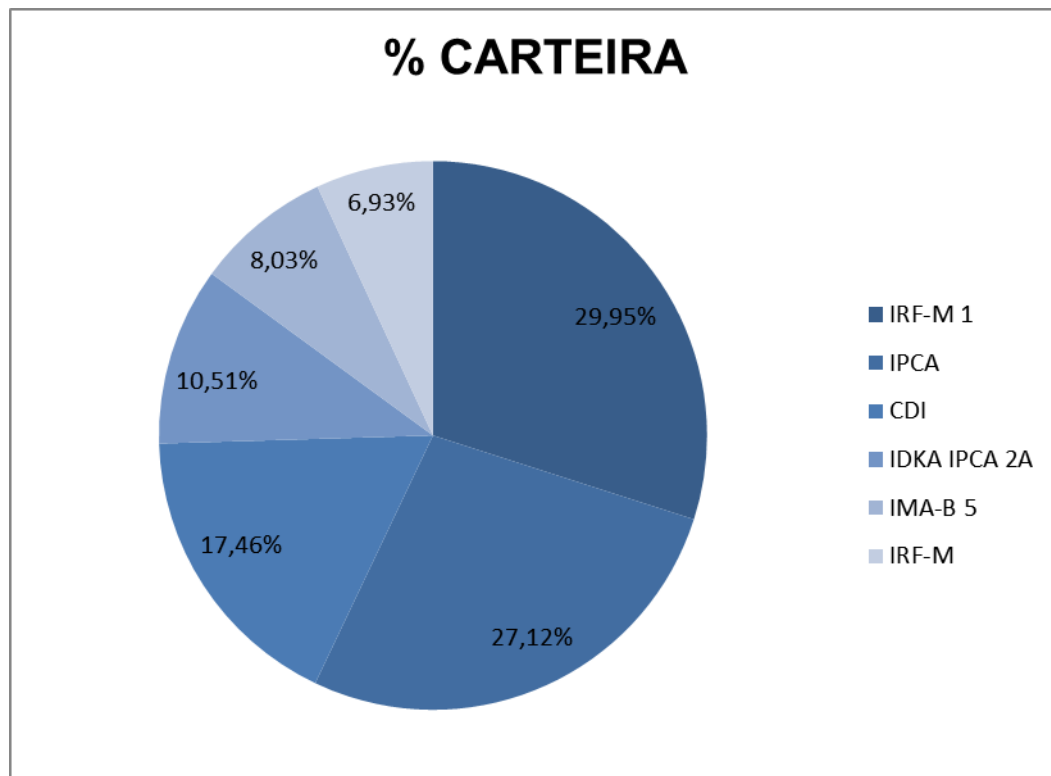




## 7.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

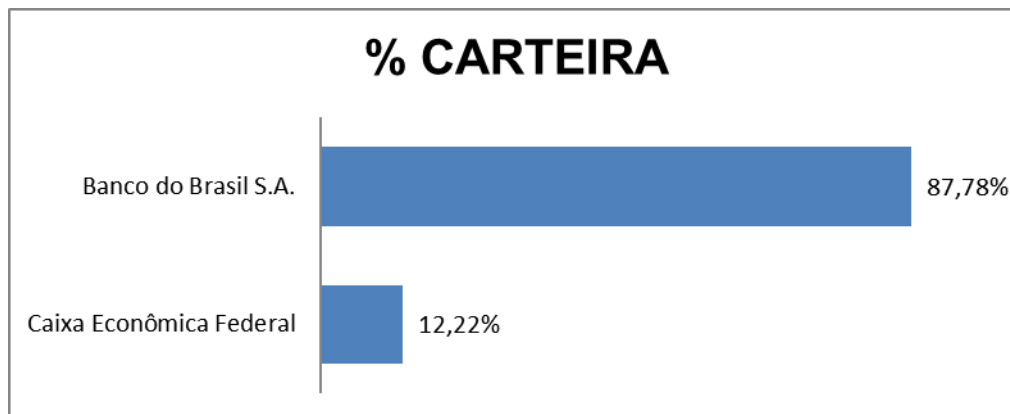
Indicador	Saldo em 31/08/2022	Participação
IRF-M 1	R\$60.223.097,94	29,95%
IPCA	R\$54.538.590,81	27,12%
CDI	R\$35.110.108,26	17,46%
IDKA IPCA 2A	R\$21.132.237,98	10,51%
IMA-B 5	R\$16.157.175,36	8,03%
IRF-M	R\$13.925.852,20	6,93%
	<b>R\$201.087.062,55</b>	<b>100,00%</b>



## 7.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

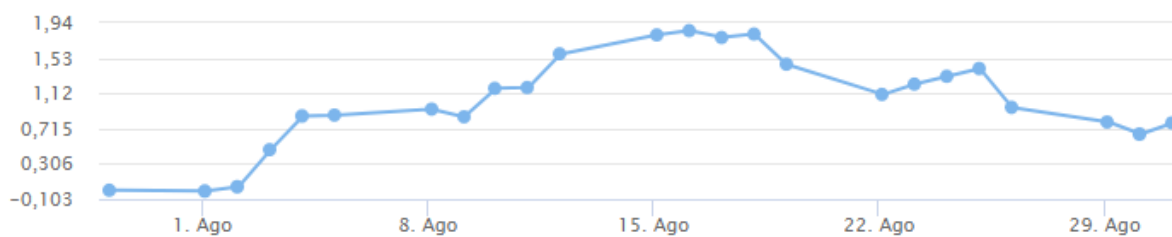
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$24.576.687,85	12,22%
Banco do Brasil S.A.	R\$176.510.374,70	87,78%



## 8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

### 8.1. RENTABILIDADE

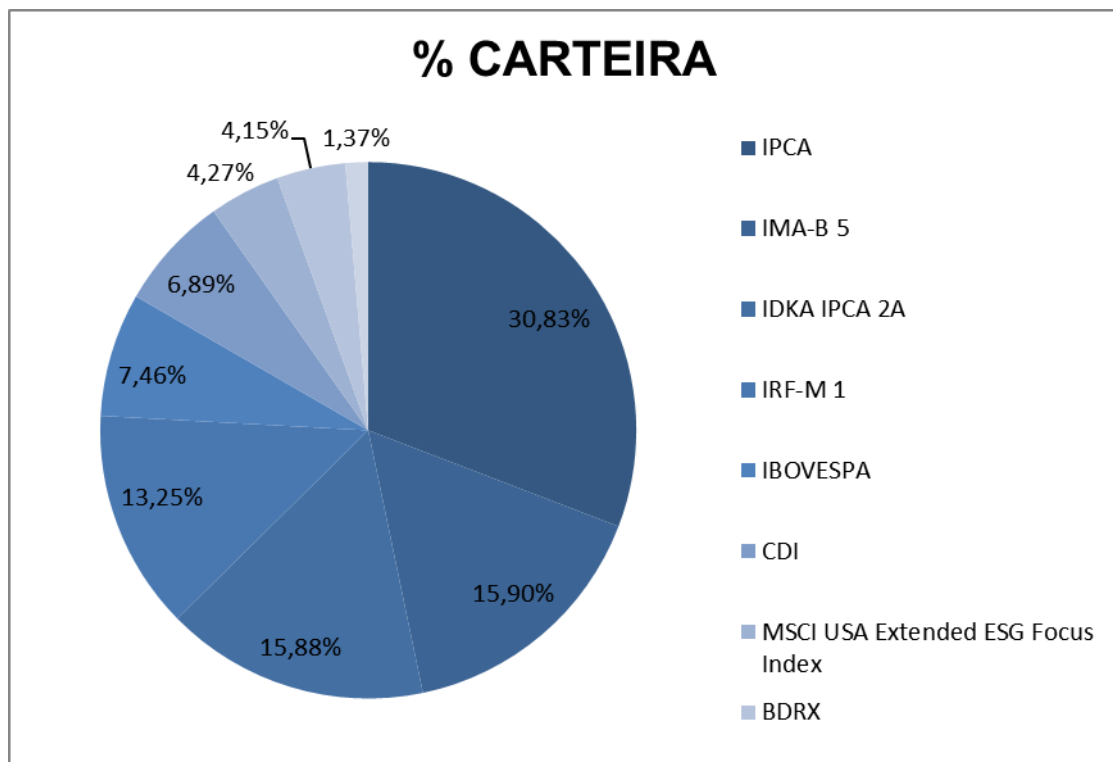
A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado de 0,78% e fechou o mês com o saldo de R\$ 23.576.036,54 (vinte e três milhões e quinhentos e setenta e seis mil e trinta e seis reais e cinquenta e quatro centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de agosto.



## 8.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

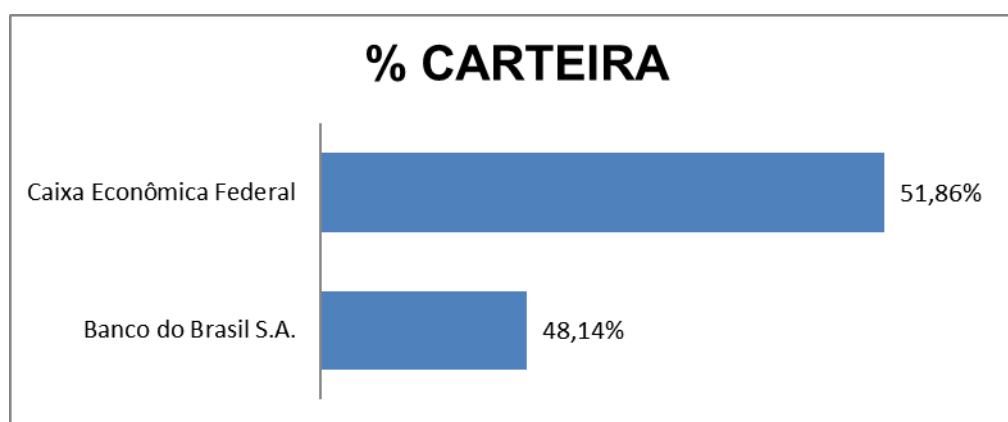
Indicador	Saldo em 31/08/2022	Participação
IPCA	R\$7.267.913,76	30,83%
IMA-B 5	R\$3.749.084,12	15,90%
IDKA IPCA 2A	R\$3.744.201,54	15,88%
IRF-M 1	R\$3.123.690,20	13,25%
IBOVESPA	R\$1.759.770,64	7,46%
CDI	R\$1.623.250,45	6,89%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.007.603,88	4,27%
BDRX	R\$977.634,56	4,15%
SMLL	R\$322.887,39	1,37%
	<b>R\$23.576.036,54</b>	<b>100,00%</b>



### 8.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

#### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

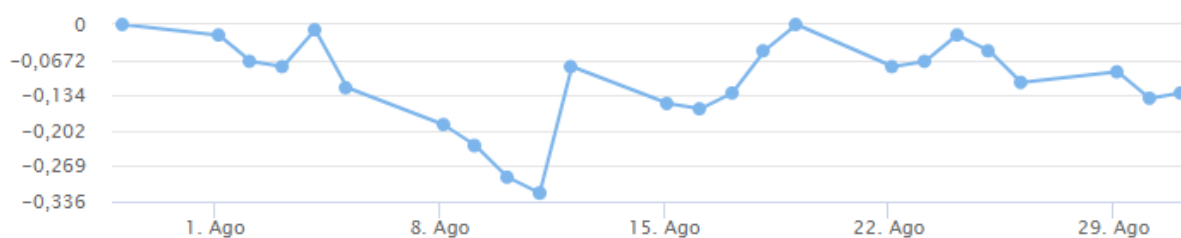
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$11.349.179,62	48,14%
Caixa Econômica Federal	R\$12.226.856,92	51,86%



## 9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

### 9.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de -0,13% e fechou o mês com o saldo de R\$ 16.824.978,33 (dezesesse milhões e oitocentos e vinte e quatro mil e novecentos e setenta e oito reais e trinta e três centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de agosto.

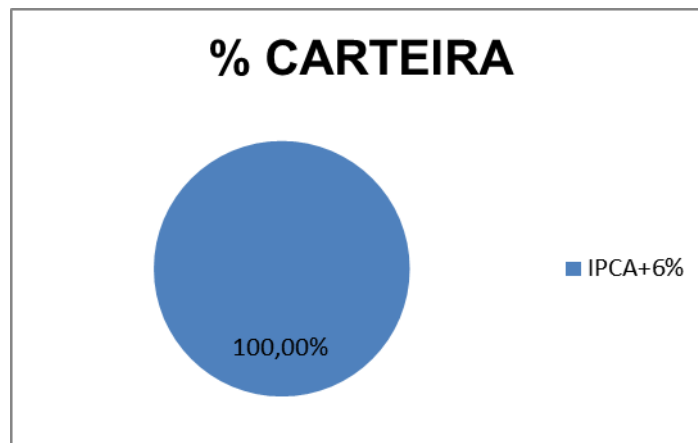




## 9.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

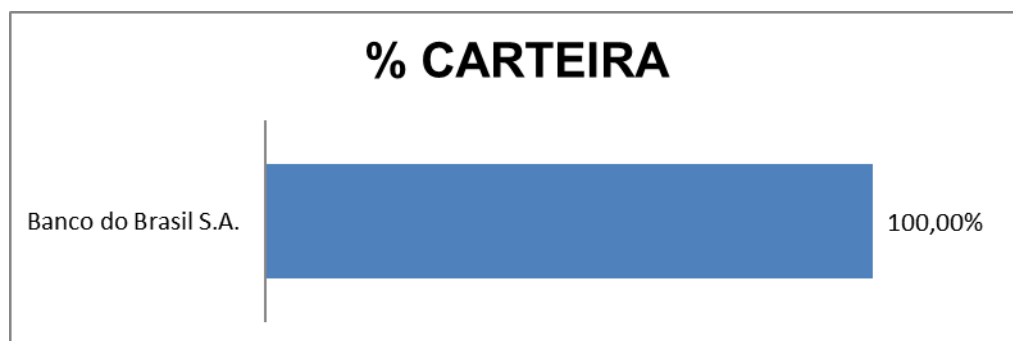
Indicador	Saldo em 31/08/2022	Participação
IPCA+6%	R\$16.824.978,33	100,00%
	<b>R\$16.824.978,33</b>	<b>100,00%</b>



## 9.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$16.824.978,33	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 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 agosto de 2022 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 3.790.196.824,42 (três bilhões e setecentos e noventa milhões e cento e noventa e seis mil e oitocentos e vinte e quatro reais e quarenta e dois centavos).

Macaé, 26 de setembro de 2022.

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



## 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 **agosto de 2022**.

Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos o qual segue na íntegra na ata do dia de hoje, 26 de setembro de 2022.

Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de Agosto 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 **AGOSTO de 2022**, o qual segue para aprovação do Conselho Fiscal. É o parecer.

  
Alfredo Danos Filho

  
Claudio de Freitas Duarte

  
Erenildo Motta da Silva Júnior

  
Isabella Felix Viana

  
José Eduardo da Silva Guinâncio

  
Maria Auxiliadora de Moura Ferreira

  
Miriam Amaral Queiroz

  
Patric Alves de Vasconcellos





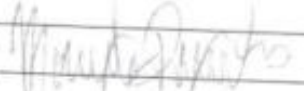
RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS  
AGOSTO DE 2022

TERMO DE APROVAÇÃO CONSELHO FISCAL

Ao dia 27/09/2022, 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 **AGOSTO de 2022**. Considerando todas as informações constantes no presente relatório, **APROVAMOS** o relatório de investimentos referente à **AGOSTO DE 2022**.

*Macaé, 27 de setembro de 2022.*

CONSELHO FISCAL

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