

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



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



SETEMBRO - 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 setembro 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

Se tiver uma palavra que pode definir como foi o mês de setembro, sem dúvidas foi volatilidade. As projeções para o crescimento mundial mantiveram o viés baixista, mas sem contaminar de forma significativa o ano de 2024. Já a inflação manteve a tendência de alta, mas trazendo a expectativa de que o pico de 2022 tenha sido superado.

O mês foi marcado por decisões de aperto de política monetária ao redor do mundo. Praticamente todos os bancos centrais de economias importantes decidiram aumentar taxas de juros para controle da inflação, como Estados Unidos, países da zona do euro e Reino Unido.

As taxas de inflação nesses países seguem batendo recordes históricos, impulsionadas pela guerra entre Rússia e Ucrânia, escassez de energia na Europa e preços de commodities alimentares.

A China, enquanto isso, prossegue com a sua política de tolerância zero para novos casos de Covid, mas com ajustes em seus parâmetros. Sobre os dados, a produção industrial acelerou de 3,8% para 4,2% (A/A) em agosto. O setor acumulou alta de 3,6% no ano. Já o varejo acelerou de 2,7% para 5,4 % (A/A). Desse modo, quanto à política monetária e creditícia, o People's Bank of China (PBoC) informou a manutenção da taxa de referência para empréstimos de 1 ano em 3,65%, e de 5 anos em 4,30%.

Nos Estados Unidos, a inflação para o consumidor atingiu alta de 8,2% no acumulado em 12 meses. Tanto a medição mensal como a anual vieram acima da expectativa do mercado. O consenso do mercado apontava para alta de 0,2% ante agosto e de 8,1% em 12



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



meses. Os núcleos da inflação também vieram acima das estimativas: 0,6% na comparação mensal e 6,6% na anual, ante projeções de 0,5% e de 6,5%, respectivamente. 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.

O Índice de Preços ao Consumidor (CPI) na sigla em inglês, nos Estados Unidos subiu 0,4% em setembro na comparação com agosto, segundo dados divulgados pelo Departamento do Trabalho americano. O mesmo apontou também que o Índice de Preços ao Produtor (PPI) subiu 0,4% em setembro na comparação com agosto e 8,5% em relação a setembro de 2021, ambas as medições acima da expectativa de mercado.

Nesse contexto, em termos de política monetária, o FOMC elevou sua taxa básica de juros, Fed Funds Rate, em 0,75 p.p para o intervalo entre 3,00% e 3,25% de forma unânime, e em linha com o esperado pelo mercado. No comunicado, o FOMC sinalizou que os próximos passos da política monetária podem ser ajustados e serão definidos a cada reunião, levando-se em consideração as implicações de todo o conjunto de indicadores divulgados.

A Europa, especialmente, se encontra em uma situação delicada, dado que os indicadores de atividade econômica (PMI) já sinalizam uma possível recessão. No Reino Unido, a sinalização do novo governo para o maior corte de impostos dos últimos 50 anos trouxe uma turbulência para o país, com os investidores questionando como se daria a diminuição da arrecadação para as contas públicas. A libra teve uma desvalorização recorde em relação ao dólar e os preços dos títulos públicos despencaram, o que elevou os custos dos empréstimos, provocando caos no mercado hipotecário e deixando os fundos de pensão à beira da insolvência.

A crise energética, agravada de forma dramática pela guerra na Ucrânia, e seus efeitos para a segurança alimentar também continuam a pressionar os preços ao consumidor.

O setor de alimentos (medido em conjunto com álcool e tabaco) registrou um reajuste de 11,8% em setembro, contra o avanço de 10,6% em agosto. O setor de energia registrou alta de 40,8%, enquanto no mês anterior o aumento no setor foi de 38,6%, principal vetor da inflação geral. Vale destacar que para setembro a inflação alemã ao produtor saltou 45,8% na base anual, recorde desde 1949, replicando a marca de agosto e reforçando que as ondas de choque apresentaram contribuição marginal para cima.



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



A taxa na Zona do Euro ficou em 9,9% para setembro, acima dos 9,1% de agosto. Um ano antes, a taxa era de 3,4%. A inflação anual da União Europeia ficou em 10,9% para setembro de 2022, acima dos 10,1% em agosto. No mesmo período do ano passado, a taxa era de 3,6%. Os dados são do Eurostat.

O Banco Central Europeu (BCE) acelerou a intensificação de sua política monetária com o aumento de 0,75 ponto percentual nas taxas básicas de juros, justamente para tentar controlar a inflação.

Durante oito anos, as taxas de depósito permaneceram em terreno negativo, uma situação excepcional, que pretendia estimular os bancos da zona do euro a destinar sua liquidez para projetos produtivos em vez de retê-la nos cofres do BCE.

Apesar deste cenário internacional desafiador, a economia brasileira tem se mostrado bastante resiliente. O Ibovespa, principal índice da Bolsa brasileira, fechou setembro no verde, com leve alta de 0,47%.

O PIB do segundo trimestre de 2022 cresceu 1,2% (T/T). Na ótica da oferta, destaque para o desempenho da indústria (2,2%). O setor de serviços (1,3%) também teve um bom desempenho, embora mais moderado. Pela ótica da demanda, destaque para o desempenho dos investimentos (4,8%). As previsões para o PIB estão de forma sistemática aumentando, com projeção da última pesquisa Focus para terminar o ano com crescimento de 2,70%.

A balança comercial brasileira fechou o mês de setembro com superávit de US\$ 3,99 bilhões, o que elevou o saldo positivo acumulado no ano para US\$ 47,86 bilhões. Os dados foram divulgados pela Secretaria de Comércio Exterior (Secex) do Ministério da Economia, durante entrevista coletiva virtual.

Em setembro, as exportações somaram US\$ 28,95 bilhões e as importações, US\$ 24,95 bilhões, resultando no saldo positivo de US\$ 3,99 bilhões e corrente de comércio de US\$ 53,90 bilhões. No ano, as exportações totalizam US\$ 253,84 bilhões e as importações, US\$ 205,97 bilhões, com saldo positivo de US\$ 47,86 bilhões e corrente de comércio de US\$ 459,81 bilhões.

A Secex também divulgou novas estimativas para o resultado da balança comercial brasileira em todo o ano de 2022. A atual projeção indica superávit da balança comercial de US\$ 55,4 bilhões (ante R\$ 81,5 bilhões na previsão anterior), com US\$ 330,3 bilhões de exportações e US\$ 274,9 bilhões de importações, resultando em corrente de comércio de US\$ 605,2 bilhões.



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



Os indicadores de atividade divulgados em setembro, referentes a julho, apresentaram os seguintes resultados: A produção industrial cresceu 0,6% (M/M) em julho. Com isso, o setor mais que compensou a queda vista em junho (-0,3%). O volume de serviços cresceu 1,1% (M/M) em julho. As taxas positivas foram observadas em 3 das 5 atividades pesquisadas. Já o varejo restrito de junho recuou 0,8% (M/M), ante -1,4% (M/M) em junho. O resultado foi bastante disseminado, com queda em 9 das 10 atividades pesquisadas, com exceção de Combustíveis e Lubrificantes.

Acerca do mercado de trabalho, a taxa de desemprego ficou em 8,9% em agosto, a menor desde 2015. Em relação ao mesmo período em 2021 houve queda de 4,2 pontos percentuais.

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.

Na última reunião do Comitê de Política Monetária (Copom), o Banco Central decidiu manter a taxa inalterada em 13,75%, porém, ainda não sinalizou quando será o início do ciclo de queda de juros.

O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) de setembro de 2022, que fechou o mês com variação de -0,29%, após encerrar o mês anterior também com deflação, de -0,36%. Com isso, o IPCA acumulado de 12 meses fica em 7,17%, enquanto o acumulado no ano chega a 4,09%. Em setembro de 2021, a variação havia sido de 1,16%.

O grupo dos transportes (-1,98%) exerceu o maior impacto negativo sobre o índice geral, contribuindo com -0,41 ponto percentual (p.p.). Este é o terceiro mês consecutivo de queda nos transportes. “Os combustíveis e, principalmente, a gasolina têm um peso muito grande dentro do IPCA. Em julho, o efeito foi maior por conta da fixação da alíquota máxima de ICMS, mas, além disso, temos observado reduções no preço médio do combustível vendido para as distribuidoras, o que tem contribuído para a continuidade da queda dos preços”, explica o gerente da pesquisa, Pedro Kislanov. Em setembro, com queda de 8,33%, a gasolina exerceu o impacto negativo mais intenso no índice (-0,42 p.p.). Os outros três combustíveis pesquisados também tiveram queda nos preços: etanol (-12,43%), óleo diesel (-4,57%) e gás veicular (-0,23%). “O etanol, mesmo tendo um preço livre, acaba



acompanhando a gasolina, pois é um produto substituto”, acrescenta Kislanov. No grupo, houve ainda o recuo nos preços das motocicletas (-0,08%), dos automóveis novos (-0,15%) e dos automóveis usados (-0,38%), que haviam subido em agosto.

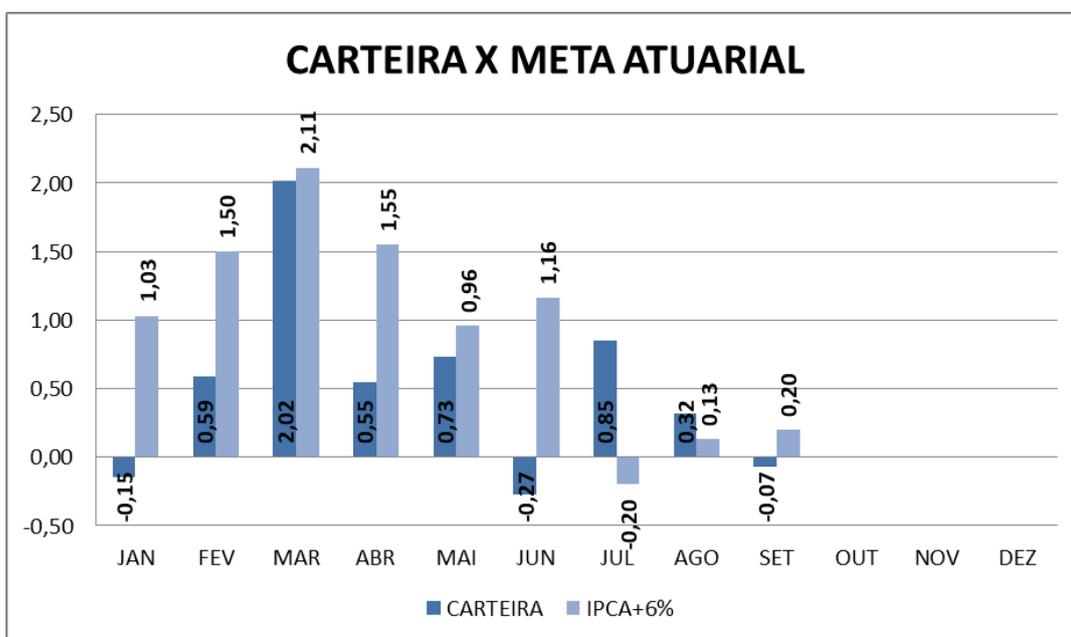
Os números de inflação estão negativos nas últimas três leituras, em função da redução de ICMS sobre combustíveis e energia, mas também a diminuição do preço do combustível (dada a queda do preço do petróleo).

3. RESULTADO DA CARTEIRA

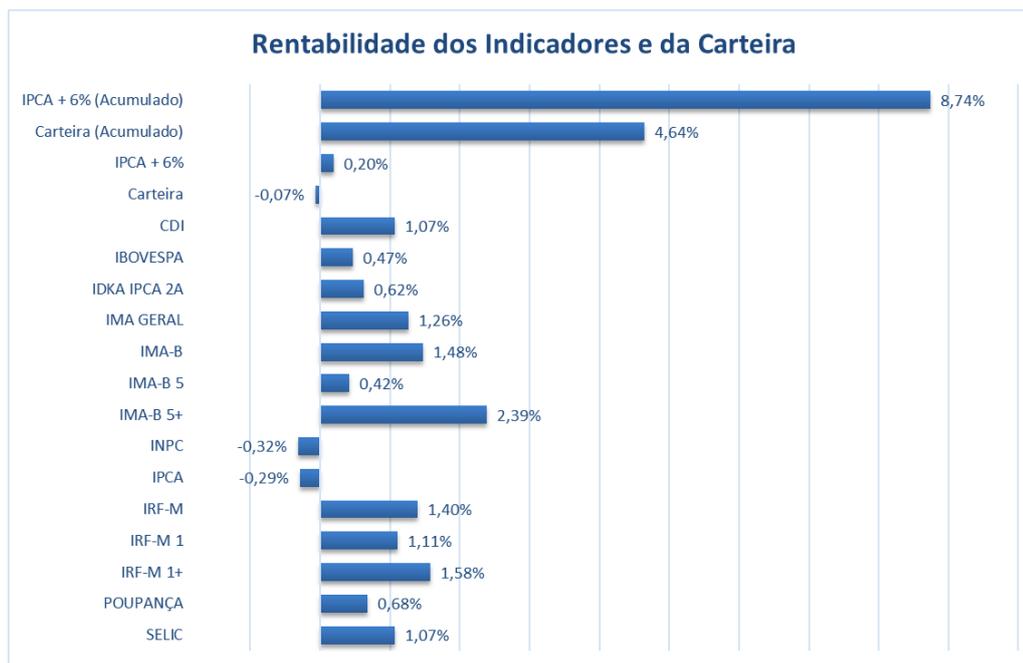
No mês de setembro, nosso portfólio teve desempenho inferior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com baixa de -0,07%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 6%, foi de 0,20%.

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

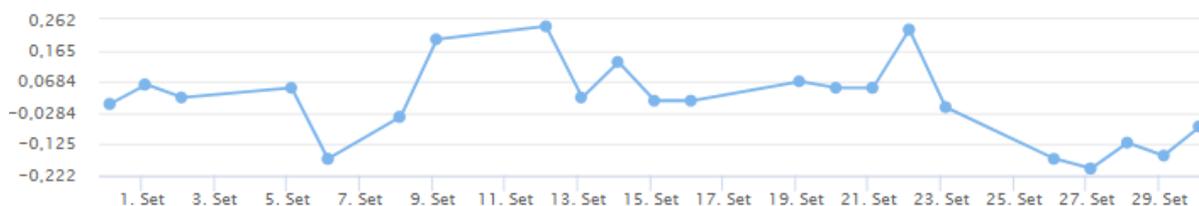
2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
CARTEIRA	-0,15	0,59	2,02	0,55	0,73	-0,27	0,85	0,32	-0,07				4,64
IPCA+6%	1,03	1,50	2,11	1,55	0,96	1,16	-0,20	0,13	0,20				8,74



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 setembro.



Os destaques do mês foram os fundos BB Previdenciário RF IMA-B 5+ LP e Caixa Brasil Estratégia Livre Multimercado que renderam, respectivamente, 2,36% e 2,23%. Isso mostra que, no Brasil, a renda fixa continua apresentando uma melhor performance em relação aos ativos globais, principalmente diante do cenário externo adverso.

Em média, os fundos de ações brasileiras apresentaram rentabilidade de -1,07%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno negativo médio de -8,33%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno negativo de -7,56%. Os fundos de investimento no exterior caíram, em média, -4,90%. Os fundos multimercado tiveram uma rentabilidade de 1,22%.



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



O fundo de vértice Caixa FI Brasil 2023 TP RF rendeu 0,08%, o fundo BB Previdenciário RF TP IPCA FI rendeu 0,08%, o fundo BB Previdenciário RF TP XXI FI rendeu 0,49%, enquanto o Caixa FI Brasil 2024 IV TP RF rendeu 0,49%.

Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 0,99%. Os fundos IMA-B 5 tiveram um retorno de 0,42%. O fundo IMA-B 5+ teve retorno de 2,36%. O fundo indexado ao IRF-M 1+ teve um retorno de 1,53%. O fundo IRF-M 1 teve um retorno de 1,09%. Enquanto os fundos IDKA 2A tiveram rendimento de 0,31%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade de 0,17%. Até 30/09/2022 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 setembro, o fundo apresentou resultado de R\$ 1.389,97 (Mil e trezentos e oitenta e nove reais e noventa e sete centavos). O saldo em 30 de setembro estava em R\$ 803.422,71 (oitocentos e três mil e quatrocentos e vinte e dois reais e setenta e um 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 setembro da Carteira do Instituto foi negativo de R\$ -2.654.188,69 (dois milhões e seiscentos e cinquenta e quatro mil e cento e oitenta e oito reais e sessenta e nove centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de setembro em R\$ 3.551.126.563,34 (três bilhões e quinhentos e cinquenta e um milhões e cento e vinte e seis mil e quinhentos e sessenta e três reais e trinta e quatro centavos).



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



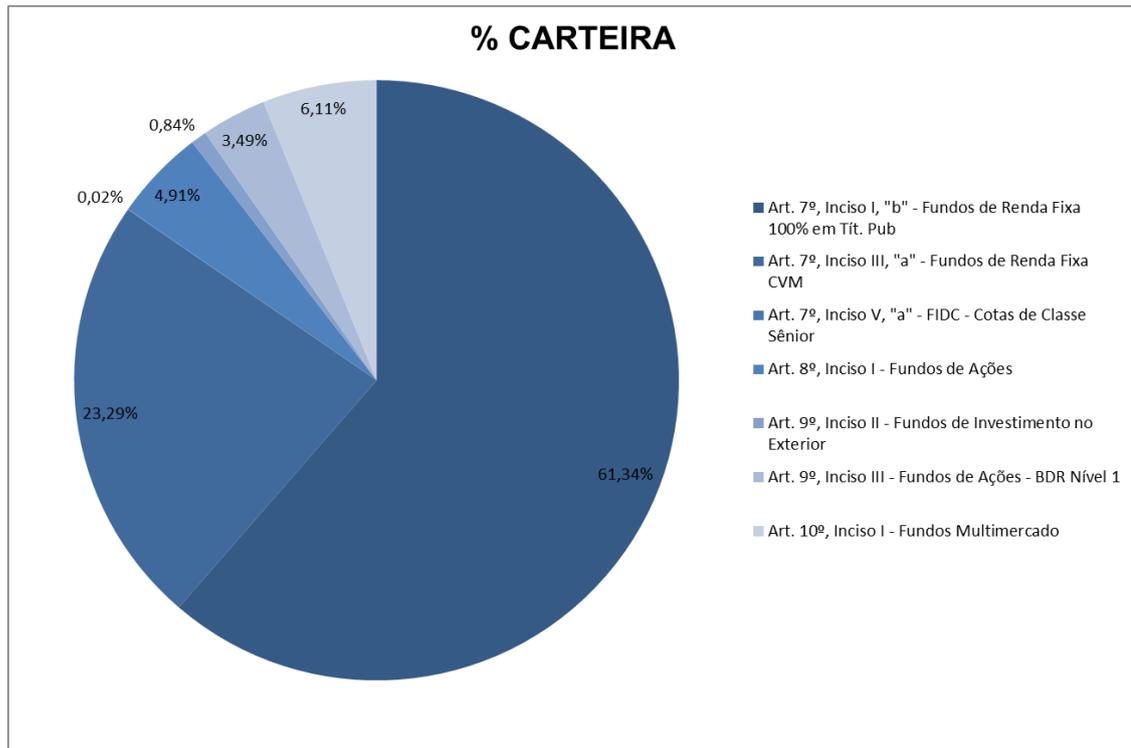
SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS

Fundo de Investimento	Saldo em 31/08/2022	Saldo em 30/09/2022	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	R\$188.867.228,97	R\$0,00	-R\$189.024.644,67	R\$157.415,70	0,08%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$10.262,48	R\$8.219,07	-R\$10.298,08	R\$8.254,66	0,04%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$802.032,74	R\$803.422,71	R\$0,00	R\$1.389,97	0,17%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$1.193.141,22	R\$1.253.359,94	R\$40.902,84	R\$19.315,86	0,13%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$0,00	R\$2.540.185,27	R\$2.500.000,00	R\$40.185,27	1,61%
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	R\$3.629.086,41	R\$3.666.937,48	R\$0,00	R\$37.851,07	1,04%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$7.370.225,00	R\$7.309.815,33	R\$0,00	-R\$60.409,67	-0,82%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$15.484.095,33	R\$14.831.566,78	R\$0,00	-R\$652.528,54	-4,21%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$15.999.001,74	R\$15.105.388,24	R\$0,00	-R\$893.613,50	-5,59%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	R\$16.713.398,63	R\$15.334.099,65	R\$0,00	-R\$1.379.298,98	-8,25%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$15.665.530,86	R\$15.701.203,87	R\$0,00	R\$35.673,01	0,23%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$16.053.793,35	R\$16.117.103,55	R\$0,00	R\$63.310,21	0,39%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$18.925.189,19	R\$18.383.888,13	R\$0,00	-R\$541.301,06	-2,86%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$20.181.408,88	R\$19.497.101,73	R\$0,00	-R\$684.307,15	-3,39%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$17.338.579,27	R\$19.529.032,66	R\$2.500.000,00	-R\$309.546,61	-1,56%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$18.501.905,87	R\$20.901.446,26	R\$2.500.000,00	-R\$100.459,61	-0,48%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$19.728.497,54	R\$21.619.974,02	R\$2.500.000,00	-R\$608.523,52	-2,74%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$26.227.282,06	R\$24.141.555,91	R\$0,00	-R\$2.085.726,15	-7,95%
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	R\$24.596.017,30	R\$25.143.841,30	R\$0,00	R\$547.823,99	2,23%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$28.729.626,44	R\$29.168.210,38	R\$0,00	R\$438.583,93	1,53%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$35.780.324,49	R\$32.906.578,73	R\$0,00	-R\$2.873.745,76	-8,03%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$36.553.432,33	R\$33.400.808,65	R\$0,00	-R\$3.152.623,69	-8,62%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	R\$36.186.827,72	R\$37.039.810,50	R\$0,00	R\$852.982,78	2,36%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$44.790.411,31	R\$41.332.672,12	R\$0,00	-R\$3.457.739,17	-7,72%
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	R\$45.858.065,35	R\$42.957.700,04	R\$0,00	-R\$2.900.365,31	-6,32%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	R\$56.373.019,18	R\$56.985.128,54	R\$0,00	R\$612.109,37	1,09%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	R\$73.437.664,98	R\$74.476.427,92	R\$0,00	R\$1.038.762,94	1,41%
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$0,00	R\$80.169.183,31	R\$80.000.000,00	R\$169.183,31	0,21%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	R\$133.142.441,61	R\$133.675.948,58	R\$0,00	R\$533.506,97	0,40%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	R\$138.081.529,73	R\$138.812.716,09	R\$0,00	R\$731.186,36	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$157.331.329,58	R\$158.003.350,97	R\$0,00	R\$672.021,38	0,43%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$194.646.185,28	R\$195.595.914,57	R\$0,00	R\$949.729,29	0,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$218.550.633,09	R\$219.611.256,30	R\$0,00	R\$1.060.623,21	0,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	R\$379.001.270,24	R\$379.318.262,49	R\$0,00	R\$316.992,24	0,08%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$295.350.428,88	R\$397.854.853,01	R\$99.029.044,93	R\$3.475.379,21	0,88%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$418.236.618,88	R\$427.869.434,17	R\$5.037.000,00	R\$4.595.815,30	1,09%
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	R\$829.372.261,07	R\$830.060.165,07	R\$0,00	R\$687.904,00	0,08%
TOTAL	R\$3.548.708.747,00	R\$3.551.126.563,34	R\$5.072.005,02	-R\$2.654.188,69	-0,07%

4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

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

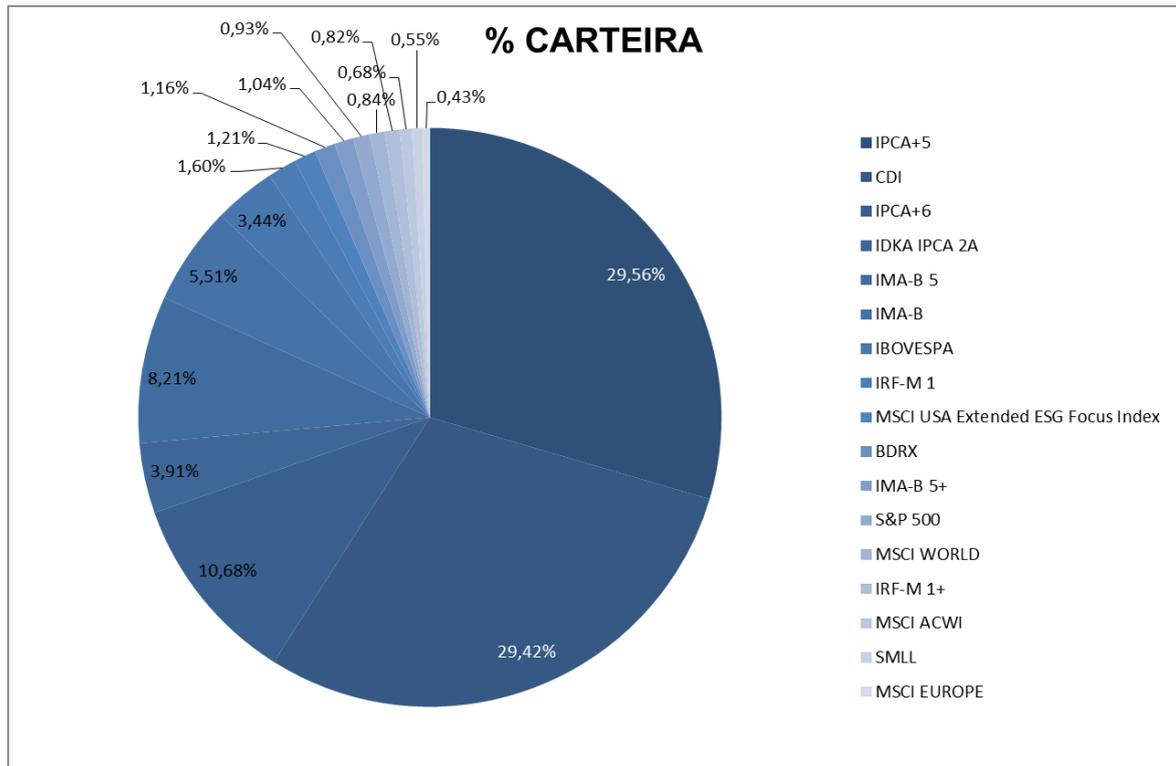
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022								
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2022	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total	
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		61,34%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$2.178.270.763,49	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	IRF-M 1	1,60%	100,00%	100,00%	100,00%	0,94%	R\$56.985.128,54	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	IDKA 2A	3,91%	100,00%	100,00%	100,00%	1,59%	R\$138.812.716,09	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	IMA-B 5	3,76%	100,00%	100,00%	100,00%	2,14%	R\$133.675.948,58	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	4,45%	100,00%	100,00%	100,00%	1,78%	R\$158.003.350,97	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	IMA-B 5+	1,04%	100,00%	100,00%	100,00%	4,48%	R\$37.039.810,50	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	IPCA+6%	10,68%	100,00%	100,00%	100,00%	10,53%	R\$379.318.262,49	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	6,18%	100,00%	100,00%	100,00%	9,88%	R\$219.611.256,30	
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	IPCA+5%	23,37%	100,00%	100,00%	100,00%	20,96%	R\$830.060.165,07	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	5,51%	100,00%	100,00%	100,00%	6,74%	R\$195.595.914,57	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	IRF-M 1+	0,82%	100,00%	100,00%	100,00%	20,79%	R\$29.168.210,38	
Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM		23,29%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$826.985.866,19	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	12,05%	65,00%	65,00%	20,00%	3,60%	R\$427.869.434,17	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,04%	65,00%	65,00%	20,00%	0,04%	R\$1.253.359,94	
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	11,20%	65,00%	65,00%	20,00%	2,85%	R\$397.854.853,01	
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$8.219,07	
Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior		0,02%	5,00% ✓	0,50% ✓	20,00% ✓	5,00% ✓	R\$803.422,71	
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,02%	5,00%	0,50%	20,00%	3,64%	R\$803.422,71	
Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações		4,91%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$174.506.329,55	
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,44%	35,00%	35,00%	20,00%	9,76%	R\$15.701.203,87	
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,45%	35,00%	35,00%	20,00%	6,03%	R\$16.117.103,55	
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,55%	35,00%	35,00%	20,00%	4,99%	R\$19.497.101,73	
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	0,93%	35,00%	35,00%	20,00%	2,50%	R\$32.906.578,73	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	0,52%	35,00%	35,00%	20,00%	1,81%	R\$18.383.888,13	
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	0,21%	35,00%	35,00%	20,00%	2,36%	R\$7.309.815,33	
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,07%	35,00%	35,00%	20,00%	6,52%	R\$2.540.185,27	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	0,55%	35,00%	35,00%	20,00%	3,04%	R\$19.529.032,66	
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	0,59%	35,00%	35,00%	20,00%	3,08%	R\$20.901.446,26	
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	0,61%	35,00%	35,00%	20,00%	4,22%	R\$21.619.974,02	
Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior		0,84%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$29.936.955,02	
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	0,43%	10,00%	10,00%	20,00%	1,30%	R\$15.105.388,24	
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	0,42%	10,00%	10,00%	20,00%	12,31%	R\$14.831.566,78	
Art. 9º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1		3,49%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$123.766.027,72	
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,21%	10,00%	10,00%	20,00%	3,29%	R\$42.957.700,04	
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	MSCI EUROPE	0,43%	10,00%	10,00%	20,00%	12,19%	R\$15.334.099,65	
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	0,68%	10,00%	10,00%	20,00%	5,76%	R\$24.141.555,91	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,16%	10,00%	10,00%	20,00%	2,01%	R\$41.332.672,12	
Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado		6,11%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	15,00% ✓	R\$216.857.198,66	
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	0,10%	10,00%	10,00%	20,00%	3,08%	R\$3.666.937,48	
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	2,10%	10,00%	10,00%	20,00%	3,42%	R\$74.476.427,92	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	CDI	2,26%	10,00%	10,00%	20,00%	7,18%	R\$80.169.183,31	
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	CDI	0,71%	10,00%	10,00%	20,00%	9,53%	R\$25.143.841,30	
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	0,94%	10,00%	10,00%	20,00%	1,94%	R\$33.400.808,65	
Total:							R\$3.551.126.563,34	



4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

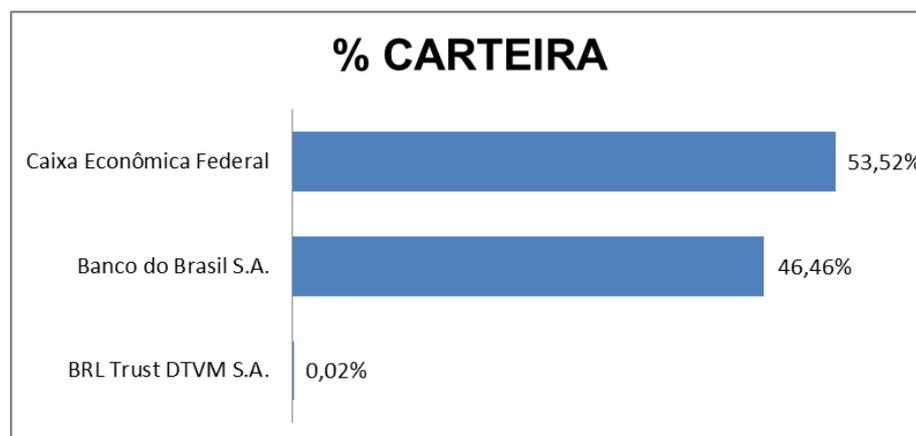
Indicador	Saldo em 30/09/2022	Participação
IPCA+5	R\$1.049.671.421,37	29,56%
CDI	R\$1.044.646.487,56	29,42%
IPCA+6	R\$379.318.262,49	10,68%
IDKA IPCA 2A	R\$138.812.716,09	3,91%
IMA-B 5	R\$291.679.299,55	8,21%
IMA-B	R\$195.595.914,57	5,51%
IBOVESPA	R\$122.070.718,16	3,44%
IRF-M 1	R\$56.985.128,54	1,60%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$42.957.700,04	1,21%
BDRX	R\$41.332.672,12	1,16%
IMA-B 5+	R\$37.039.810,50	1,04%
S&P 500	R\$32.906.578,73	0,93%
MSCI WORLD	R\$29.936.955,02	0,84%
IRF-M 1+	R\$29.168.210,38	0,82%
MSCI ACWI	R\$24.141.555,91	0,68%
SMLL	R\$19.529.032,66	0,55%
MSCI EUROPE	R\$15.334.099,65	0,43%
Total	R\$3.551.126.563,34	100,00%



4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Rentabilidade	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$803.422,71	0,42%	0,02%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.649.687.066,43	0,33%	46,46%
Caixa Econômica Federal	R\$1.900.636.074,20	0,31%	53,52%





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



5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

MOVIMENTAÇÕES

APLICAÇÕES		
Data	Valor	Ativo
05/09/2022	R\$4.079,71	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
06/09/2022	R\$1.699,80	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
08/09/2022	R\$1.566,92	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
09/09/2022	R\$4.244.440,81	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
12/09/2022	R\$301.107,91	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
13/09/2022	R\$2.016,63	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
15/09/2022	R\$611,88	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/09/2022	R\$4.750.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
20/09/2022	R\$2.584,54	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
21/09/2022	R\$16.002,08	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
22/09/2022	R\$1.018,22	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
23/09/2022	R\$9.606.610,53	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
23/09/2022	R\$287.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
26/09/2022	R\$18.544.430,95	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
26/09/2022	R\$80.000.000,00	CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO
26/09/2022	R\$80.484.612,03	CAIXA FI BRASIL DI LP
27/09/2022	R\$2.500.000,00	CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES
27/09/2022	R\$2.500.000,00	FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE
27/09/2022	R\$2.500.000,00	FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR
27/09/2022	R\$18.544.432,90	CAIXA FI BRASIL DI LP
27/09/2022	R\$2.500.000,00	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO
27/09/2022	R\$12.774,48	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
28/09/2022	R\$866,88	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
29/09/2022	R\$1.749,99	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
30/09/2022	R\$515,15	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC

RESGATES		
Data	Valor	Ativo
01/09/2022	R\$5.897,83	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
01/09/2022	R\$305.130,98	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
02/09/2022	R\$702.102,54	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/09/2022	R\$4.750.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
26/09/2022	R\$4.398,30	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
26/09/2022	R\$189.024.644,67	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP
26/09/2022	R\$8.399.509,17	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
27/09/2022	R\$18.544.432,90	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$226.808.121,41
Resgates	-R\$221.736.116,39
Saldo	R\$5.072.005,02



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 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 EXPERT CLARITAS VALOR 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



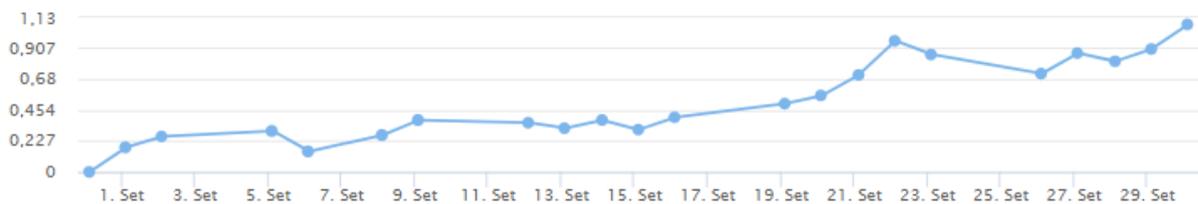
PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP



7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

7.1. RENTABILIDADE

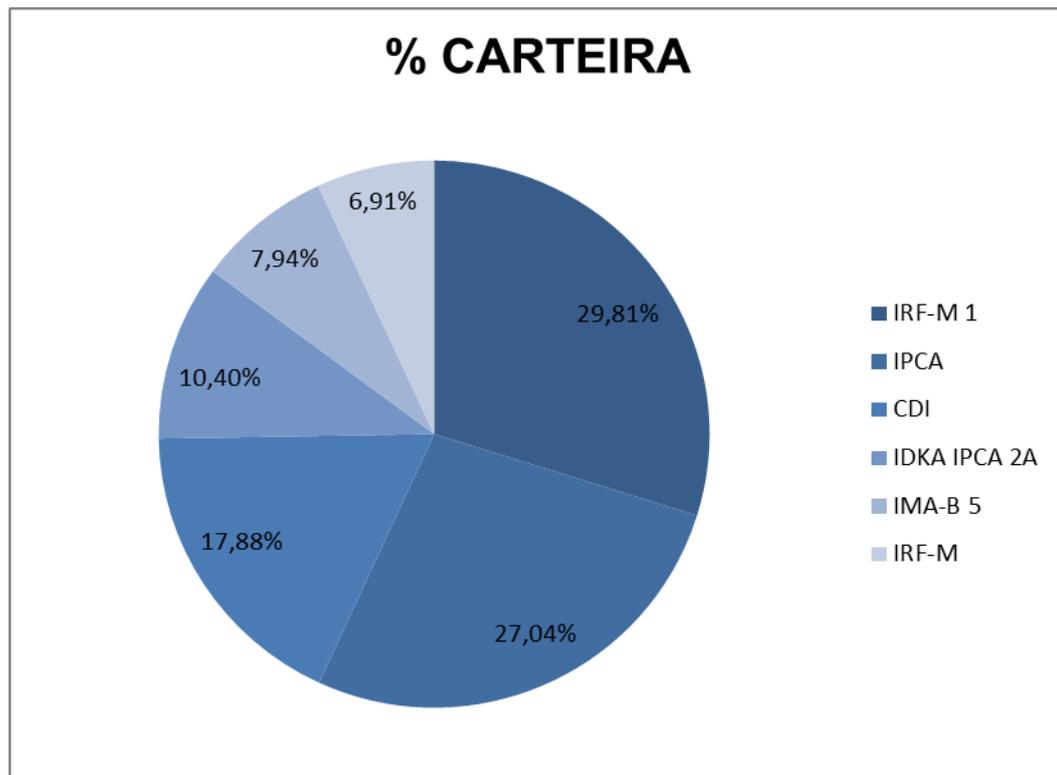
A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 1,07% no mês de setembro, totalizando um saldo de R\$ 204.221.446,68 (duzentos e quatro milhões e duzentos e vinte e um mil e quatrocentos e quarenta e seis reais e sessenta e oito centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira ao longo do mês.



7.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

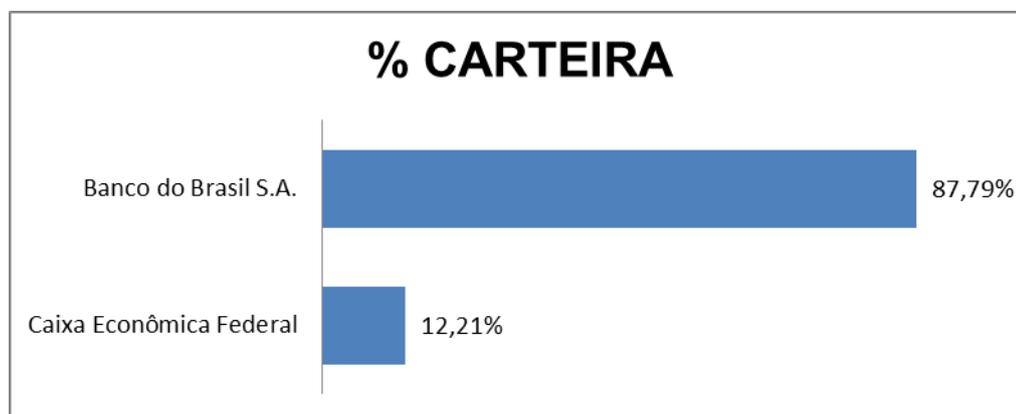
Indicador	Saldo em 30/09/2022	Participação
IRF-M 1	R\$60.877.015,94	29,81%
IPCA	R\$55.222.918,76	27,04%
CDI	R\$36.517.948,22	17,88%
IDKA IPCA 2A	R\$21.244.140,02	10,40%
IMA-B 5	R\$16.221.917,80	7,94%
IRF-M	R\$14.117.505,94	6,91%
	R\$204.201.446,68	100,00%



7.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$24.923.716,60	12,21%
Banco do Brasil S.A.	R\$179.277.730,08	87,79%

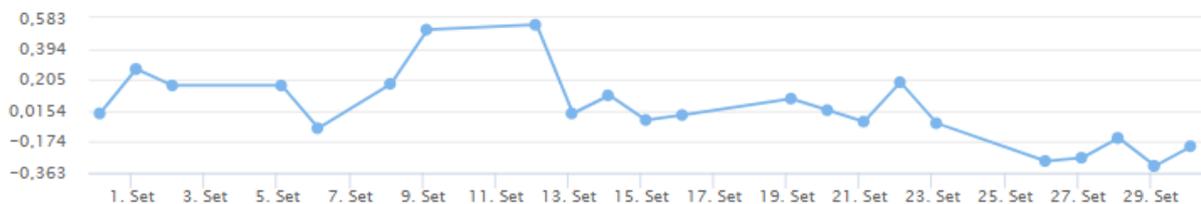




8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

8.1. RENTABILIDADE

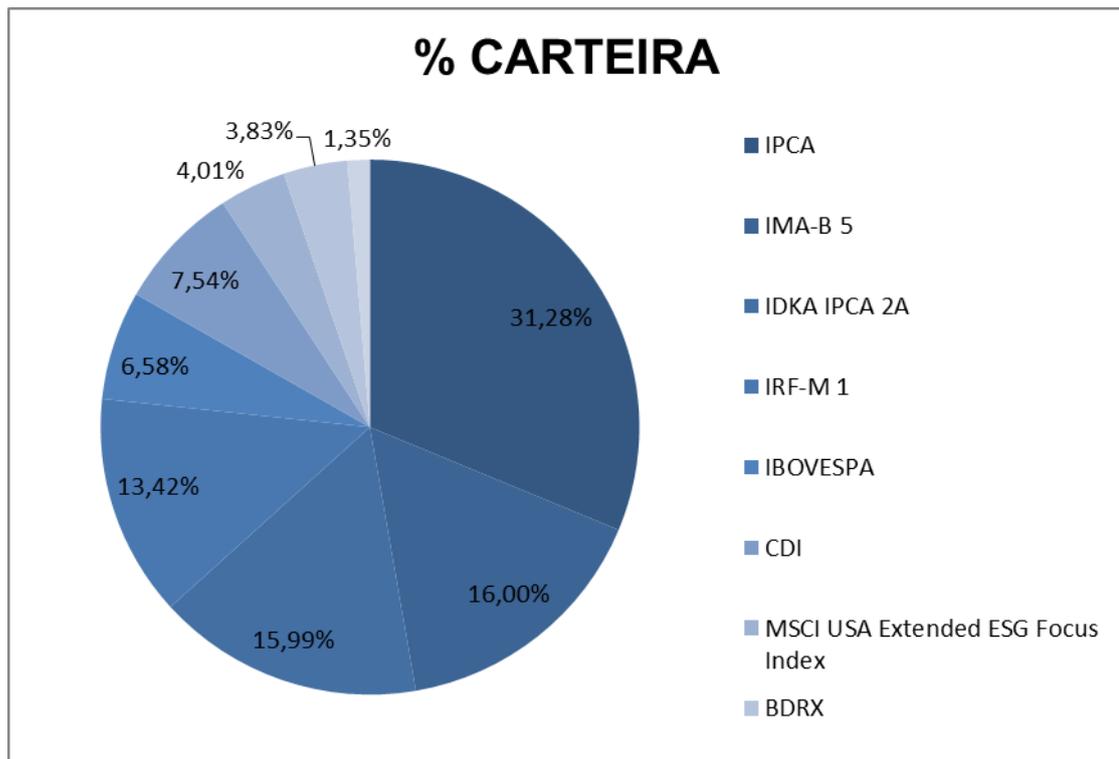
A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado negativo de -0,20% e fechou o mês com o saldo de R\$ 23.528.171,95 (vinte e três milhões e quinhentos e vinte e oito mil e cento e setenta e um reais e noventa e cinco centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de setembro.



8.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

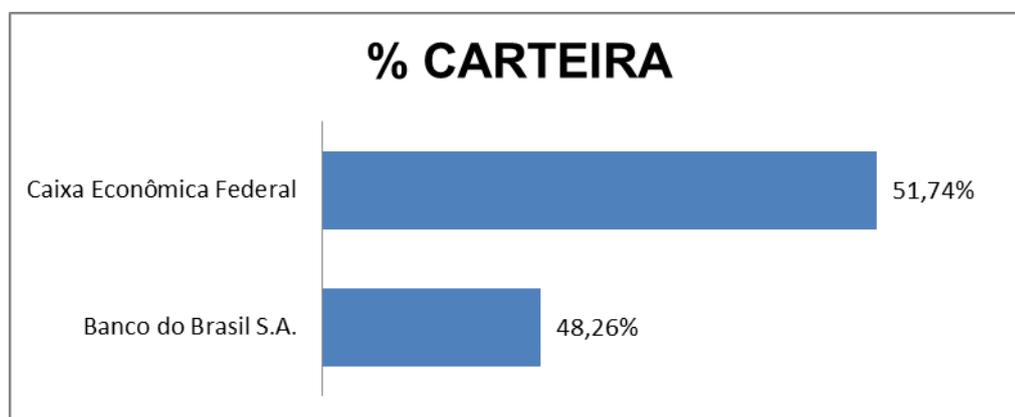
Indicador	Saldo em 30/09/2022	Participação
IPCA	R\$7.358.630,78	31,28%
IMA-B 5	R\$3.764.106,84	16,00%
IDKA IPCA 2A	R\$3.763.298,78	15,99%
IRF-M 1	R\$3.157.639,95	13,42%
IBOVESPA	R\$1.548.703,72	6,58%
CDI	R\$1.773.116,73	7,54%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$943.876,39	4,01%
BDRX	R\$902.162,93	3,83%
SMLL	R\$316.635,83	1,35%
	R\$23.528.171,95	100,00%



8.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

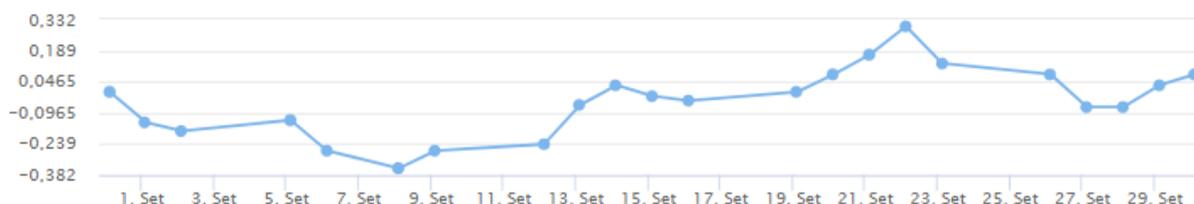
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$11.354.070,52	48,26%
Caixa Econômica Federal	R\$12.174.101,43	51,74%



9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

9.1. RENTABILIDADE

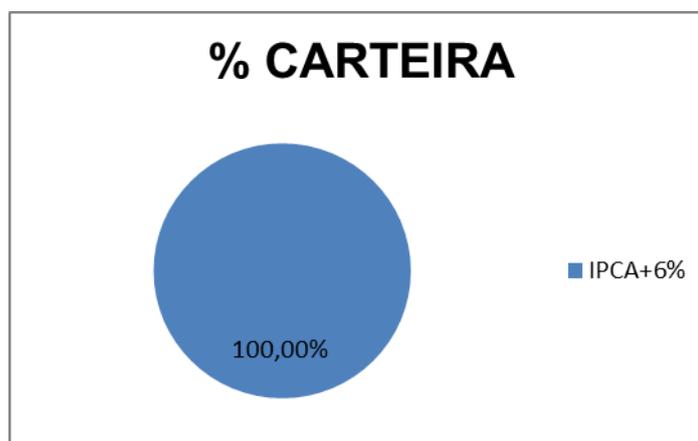
A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de 0,08% e fechou o mês com o saldo de R\$ 16.839.050,55 (dezesesseis milhões e oitocentos e trinta e nove mil e cinquenta reais e cinquenta e cinco centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de setembro.



9.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

Indicador	Saldo em 30/09/2022	Participação
IPCA+6%	R\$16.839.050,55	100,00%
	R\$16.839.050,55	100,00%

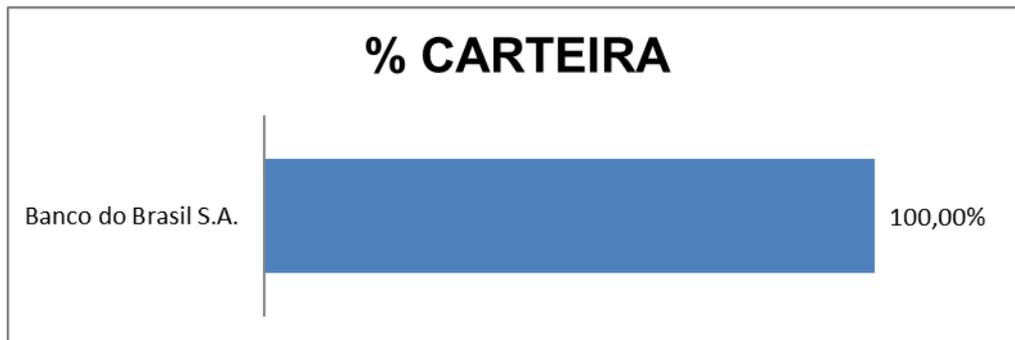




9.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$16.839.050,55	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%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	1,25%	0,00%
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	0,70%	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 setembro de 2022 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 3.795.695.232,52 (três bilhões e setecentos e noventa e cinco milhões e seiscentos e noventa e cinco mil e duzentos e trinta e dois reais e cinquenta e dois centavos).

Macaé, 24 de Outubro de 2022.

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



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e seis dias do mês de outubro 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 **setembro 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 outubro de 2022.

Considerando ainda que a carteira de investimentos do Macaeprev reflete as decisões de investimentos e alocações deliberadas no mês de **setembro 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 a **SETEMBRO 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

Patric Alves de Vasconcelos

Claudio de Freitas Duarte

Isabella Felix Viana

Miriam Amaral Queiroz

Viviane da Silva Lourenço Campos



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETEMBRO DE 2022

TERMO DE APROVAÇÃO CONSELHO FISCAL

Ao dia 03/11/2022, 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 **SETEMBRO de 2022**. Considerando todas as informações constantes no presente relatório, **APROVAMOS** o relatório de investimentos referente à **SETEMBRO DE 2022**.

Macaé, 03 de novembro de 2022.

CONSELHO FISCAL

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