

# RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS



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



**OUTUBRO - 2022**



## SUMÁRIO

<b>1. INTRODUÇÃO.....</b>	<b>3</b>
<b>2. CENÁRIO ECONÔMICO.....</b>	<b>3</b>
<b>3. RESULTADO DA CARTEIRA.....</b>	<b>6</b>
<b>4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA .....</b>	<b>11</b>
4.1. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022 .....	11
4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA .....	12
4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA .....	13
<b>5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES.....</b>	<b>14</b>
<b>6. MONITORAMENTO DE RISCOS .....</b>	<b>14</b>
6.1. ART. 7º, INCISO I, “B” – FUNDOS DE RENDA FIXA 100% EM TP .....	14
6.2. ART. 7º, INCISO III, “A” – FUNDOS DE RENDA FIXA CVM .....	15
6.3. ART. 8º, INCISO I – FUNDOS DE AÇÕES .....	15
6.4. ART. 9º, INCISO II – FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR .....	16
6.5. ART. 9º, INCISO III – FUNDOS DE AÇÕES – BDR NÍVEL I .....	16
6.6. ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO. ....	17
<b>7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO .....</b>	<b>17</b>
7.1. RENTABILIDADE .....	17
7.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022 .....	18
7.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA .....	18
7.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA .....	19
<b>8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021.....</b>	<b>20</b>
8.1. RENTABILIDADE .....	20
8.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022 .....	20
8.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA .....	21
8.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA .....	22
<b>9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022.....</b>	<b>22</b>
9.1. RENTABILIDADE .....	22
9.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022 .....	23
9.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA .....	23
9.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA .....	23
<b>10. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES.....</b>	<b>25</b>
10.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS.....	25
<b>11. CONCLUSÃO.....</b>	<b>26</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 outubro 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

O mês de outubro foi marcado pela eleição mais apertada da história do Brasil, onde os dois principais candidatos disputaram acirradamente o cargo de Chefe do Executivo, além das disputas nas duas Casas Legislativas. Na primeira sessão após a confirmação da vitória de Luís Inácio Lula da Silva sobre Jair Bolsonaro, o Ibovespa enfrentou forte volatilidade, mas encerrou os negócios em alta firme, mostrando que o mercado aceitou o resultado, além de um otimismo atribuído ao investidor estrangeiro.

O mês também foi marcado por aumento de inflação ao redor do mundo. 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.

A atividade industrial da China voltou a se contrair em outubro, no mais recente indício do impacto das rígidas políticas de Covid zero adotadas pelo país e do enfraquecimento da demanda global por produtos de fabricação chinesa. Sobre os dados, o índice oficial de atividade (PMI) do setor industrial caiu para 49,2 pontos, de 50,1 em setembro, informou o Departamento Nacional de Estatística do país. O resultado foi mais fraco que o esperado pelos analistas e chama a atenção para o grau de vulnerabilidade da economia da China a suas políticas de controle da pandemia. Números abaixo de 50 indicam contração do nível de atividade.

O PMI oficial do setor de serviços, que inclui construção civil, também se contraiu, para 48,7 pontos, de 50,6 de setembro. O indicador só de serviços de outubro caiu de 48,9



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



pontos para 47. Esse foi seu nível mais baixo desde abril, quando Xangai, capital comercial e polo manufatureiro da China, foi colocada em um lockdown que durou um mês.

Nos Estados Unidos, a inflação subiu 0,4% em outubro, de acordo com dados do Departamento do Trabalho. Em 12 meses, o CPI (índice de preço ao consumidor) acumula alta de 7,7% ante os 8,2% registrados em setembro.

A inflação americana voltou a ser pressionada pelos preços de energia (1,8%) depois de três meses de queda, com destaque para a gasolina (4%) e diesel (19,8%). Em 12 meses, o índice de energia aumentou 17,6%. O índice de alimentos desacelerou e registrou aumento de 0,6% em outubro, após um aumento de 0,8% em setembro. Foi o menor aumento mensal desse índice desde dezembro de 2021. Em 12 meses, a alta é de 10,9%. Já o núcleo da inflação, que une todos os itens exceto alimentos e energia, subiu 0,3% em outubro, após um aumento de 0,6% em setembro. Na janela de 12 meses teve alta de 6,3%.

A economia norte-americana criou 263 mil vagas líquidas de emprego não-agrícola, vindo em linha com a expectativa de mercado (250 mil). Em relação ao mês anterior, houve uma desaceleração marginal na criação de empregos (315 mil sem revisão, mas com o dado de junho sendo revisado de 526 mil para 537 mil). No âmbito da atividade, a divulgação da 1ª prévia do PIB do terceiro trimestre apresentou crescimento na margem, passando de -0,6% (T/T, base anualizada) para 2,6%. O resultado veio acima da mediana do mercado que apontava crescimento de 2,4%. Considerando as aberturas, observou-se que o resultado foi influenciado principalmente pelas contribuições positivas das exportações de bens e serviços seguidas do consumo pessoal de serviços, com 1,6% e 1,2p.p. respectivamente.

O Federal Reserve, por sua vez, aumentou novamente a taxa de juros dos Estados Unidos em 0,75 ponto percentual, mas sinalizou que futuros aumentos podem ser menores por conta do "aperto acumulado da política monetária" até agora. A decisão deixou a taxa de juros em uma faixa entre 3,75% e 4%. O banco central dos EUA disse: "Ao determinar o ritmo de aumentos futuros, o FOMC (Comitê Federal de Mercado Aberto) levará em conta o aperto acumulado da política monetária, a defasagem com que a política monetária afeta a atividade econômica e a inflação, e acontecimentos econômicos e financeiros".

O perigo é iminente quando há grandes aumentos contínuos dos juros, que pode vir a estressar o sistema financeiro ou desencadear uma recessão. Apesar de a inflação permanecer mais de três vezes maior que a meta de 2%, o Fed está agora em uma fase de "ajuste fino".



A Europa, especialmente, se encontra em uma situação delicada. Em outubro, a taxa de inflação anual na zona do euro bateu recordes, atingindo os 10,7%, de acordo com uma estimativa divulgada pelo Eurostat.

O aumento foi impulsionado pelos aumentos da energia (40,7% ante 38,6%) e o grupo de Alimentos, Bebidas e Tabaco (10,6% para 11,8%). Com contribuição marginal para cima, tivemos serviços (3,8% para 4,3%) e bens industriais (5,1% para 5,5%). Em relação ao núcleo do CPI, o avanço foi de 4,3% para 4,8% (A/A) em setembro. Entre os países, destaque para o incremento inflacionário na Alemanha (8,8% para 10,9% A/A) e Itália (9,1% para 9,4%).

O PIB da Zona do Euro cresceu 0,2% no terceiro trimestre de 2022 na comparação com o trimestre anterior, segundo os dados da primeira prévia. O resultado veio acima das expectativas do mercado, que apontavam para estagnação (0,0%) no período. Na comparação com o mesmo período no ano anterior, o PIB do bloco teve expansão de 2,1%. Entre os principais países, o crescimento foi semelhante, com a Alemanha registrando alta de 0,3% T/T, enquanto França e Espanha, alta de 0,2% T/T. O Banco Central Europeu elevou suas três taxas de juros de referência em 0,75p.p., em linha com a expectativa do mercado.

Apesar deste cenário internacional desafiador, o cenário doméstico foi marcado pela eleição, com a vitória do Lula no segundo turno. O Ibovespa, principal índice da Bolsa brasileira, fechou no verde, com alta de 5,45%, aos 116.037,08 pontos.

Em outubro, os indicadores de confiança voltaram a se deteriorar, algo que não acontecia desde julho, quando houve a ausência da liberação do FGTS e a antecipação da 1ª parcela do 13º salário dos aposentados e pensionistas.

Na última reunião do Comitê de Política Monetária (Copom), o Banco Central decidiu manter a taxa de juros inalterada em 13,75%, porém, sinalizou que irá manter a taxa por um período prolongado e, se necessário, não hesitará em retomar o ciclo de ajuste.

O Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) divulgou o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) de outubro de 2022, que fechou o mês com variação de 0,59%, acima dos 0,49% esperado pelo mercado. Em julho, agosto e setembro, as variações haviam sido de -0,68%, -0,36% e -0,29%, respectivamente, reflexo principalmente da redução de impostos sobre combustíveis e energia e reversão das altas dos alimentos. Nos últimos 12 meses, o IPCA acumula até outubro 6,47%, abaixo dos 7,17% de setembro.



Dos nove grupos de produtos e serviços do IPCA, oito tiveram alta em outubro. A maior contribuição do mês, de 0,16 ponto percentual para o índice, veio de Alimentação e bebidas (0,72%), que havia recuado 0,51% em setembro. Na sequência, vieram Saúde e cuidados pessoais (alta de 1,16%) e Transportes (0,58%), com impactos de 0,15 ponto e 0,12 ponto, respectivamente. Juntos, os três grupos responderam por cerca de 73% do IPCA de outubro. Já a maior alta do mês foi do grupo Vestuário, de 1,22%. O único grupo com queda em outubro foi Comunicação (-0,48%). Alimentação foi puxada por Alimentação em domicílio, com alta de 0,80%, pressionada por batata inglesa, com alta de 23,36%, e tomate, com 17,63%. Já o leite longa vida, com queda de 6,32%, e óleo de soja, com menos 2,85%, seguraram a inflação. Gasolina, diesel e gás veicular caíram menos e etanol subiu, o que, junto com passagens aéreas, que subiram 27,38%, levaram o item Transportes a passar de queda de 1,98% para alta de 0,58%. O dado mostra uma alta acima do esperado, mas com melhora em seus componentes, com menor pressão de serviços, diz Thomas Wu, da Itaú Asset Management.

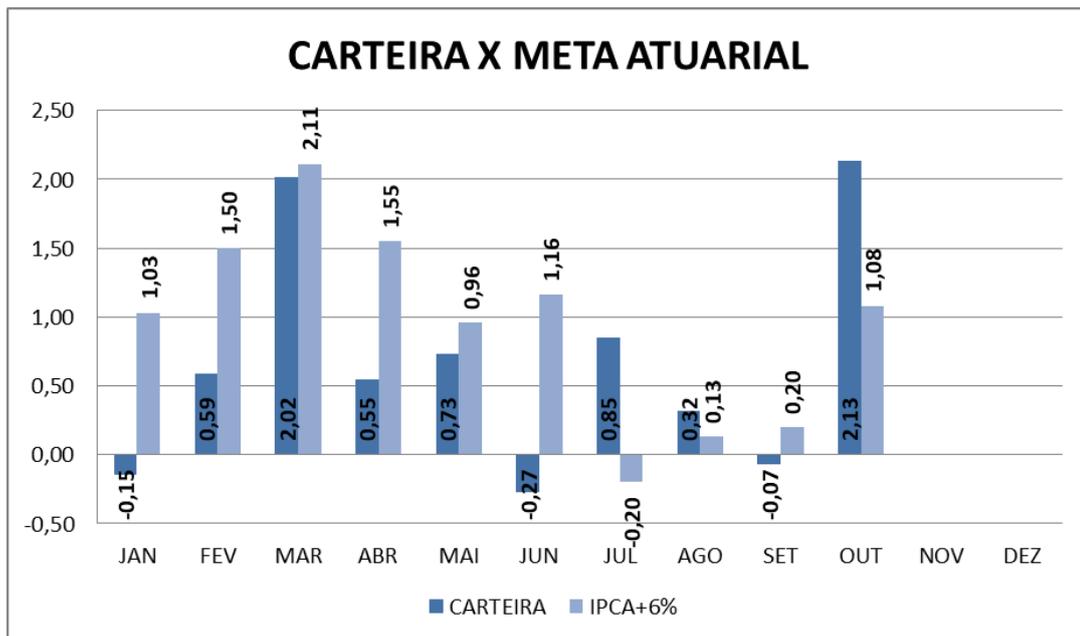
Isso mostra que a inflação não está totalmente controlada. Esse dado não deve alterar o plano de voo do Banco Central. No entanto, o novo governo eleito e o Legislativo precisam buscar uma política fiscal responsável que não afete as expectativas do mercado e não eleve o risco do país.

### 3. RESULTADO DA CARTEIRA

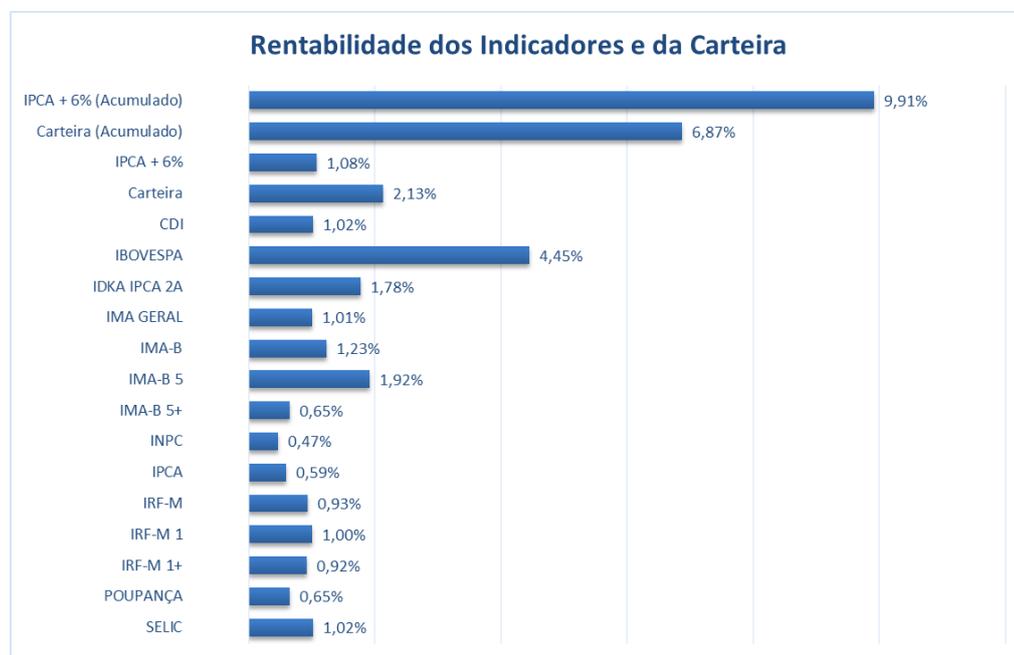
No mês de Outubro, nosso portfólio teve desempenho superior à Meta Atuarial. A Carteira fechou o mês com uma alta de 2,13%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA + 6%, foi de 1,08%.

#### 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	2,13			6,87
IPCA+6%	1,03	1,50	2,11	1,55	0,96	1,16	-0,20	0,13	0,20	1,08			9,91



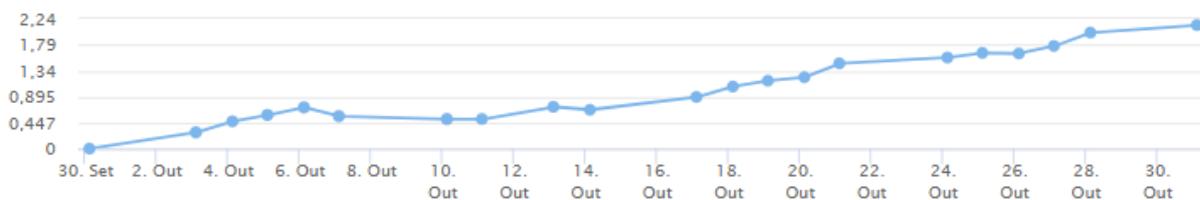
A seguir, apresento o quadro com o comportamento da Carteira, Meta Atuarial e diversos índices do mercado.



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



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



O principal destaque no mês foi que não tivemos nenhum fundo com performance negativa. Dentre eles, os destaques foram os fundos, Caixa Indexa Bolsa Americana Multimercado LP, BB Ações Agro e BB Bolsas Europeias BDR que renderam, respectivamente, 8,77%, 8,23% e 8,02%. Isso mostrou que, tanto no Brasil quanto no Exterior, a renda variável apresentou uma melhor performance em relação aos ativos de renda fixa, com maior apetite ao risco por parte dos investidores, mesmo diante do cenário adverso.

Vale ressaltar que quando o mercado começa a precificar queda na taxa de juros, geralmente a bolsa sobe. Por isso, em momentos de grandes altas na renda fixa, é importante a alocação em renda variável, mesmo que pequena. Dessa forma, é possível que o Macaeprev consiga não apenas bater meta, mas superá-la, demonstrando ainda mais a necessidade de uma gestão ativa dos recursos.

Em média, os fundos de ações brasileiras apresentaram rentabilidade de 6,29%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com proteção cambial apresentaram um retorno médio de 8,24%. Já os fundos com BDRs na carteira tiveram um retorno de 5,09%. Os fundos de investimento no exterior tiveram alta, em média, de 1,77%. Os fundos multimercado tiveram uma rentabilidade de 1,44%.

O fundo de vértice Caixa FI Brasil 2023 TP RF rendeu 2,24%, o fundo BB Previdenciário RF TP IPCA FI rendeu 2,24%, o fundo BB Previdenciário RF TP XXI FI rendeu 1,89%, enquanto o Caixa FI Brasil 2024 IV TP RF rendeu 1,89%.

Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média de 1,03%. Os fundos IMA-B 5 tiveram um retorno de 1,89%. O fundo IMA-B 5+ teve retorno de 0,65%. O fundo indexado ao IRF-M 1+ teve um retorno de 0,88%. O fundo IRF-M 1 teve um retorno de 0,98%. Enquanto o fundo IDKA 2A teve rendimento de 1,85%.

O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade de 0,72%. Até 31/10/2022 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 outubro, o fundo apresentou resultado de R\$ 5.750,36 (cinco mil e setecentos e cinquenta

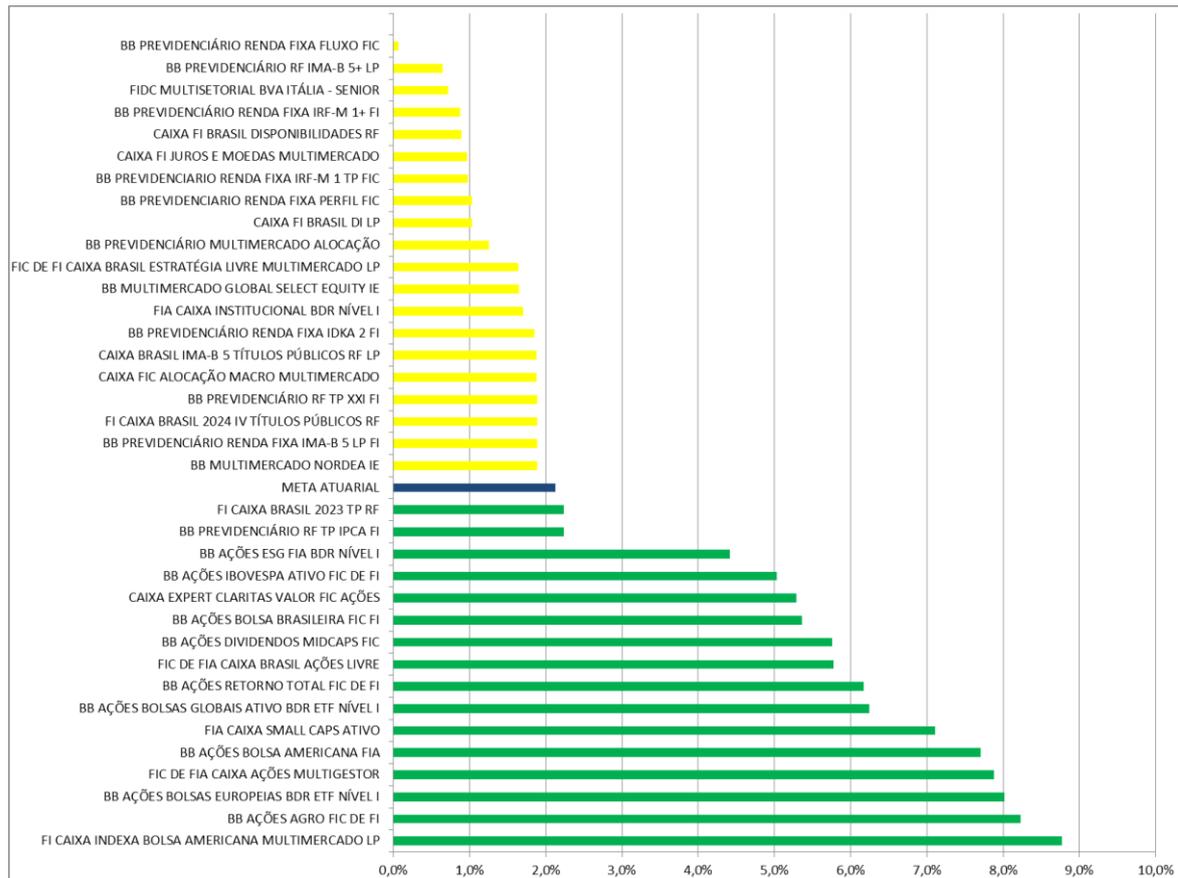


Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social



reais e trinta e seis centavos). O saldo em 31 de outubro estava em R\$ 809.173,07 (oitocentos e nove mil e cento e setenta e três reais e sete 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. Ressaltamos que nesse mês não tivemos fundos com resultado negativo, os quais seriam representados na cor vermelha.



O rendimento de outubro da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 75.854.911,49 (setenta e cinco milhões e oitocentos e cinquenta e quatro mil e novecentos e onze reais e quarenta e nove centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de outubro em R\$ 3.634.085.881,62 (três bilhões e seiscentos e trinta e quatro milhões e oitenta e cinco mil e oitocentos e oitenta e um reais e sessenta e dois centavos).



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



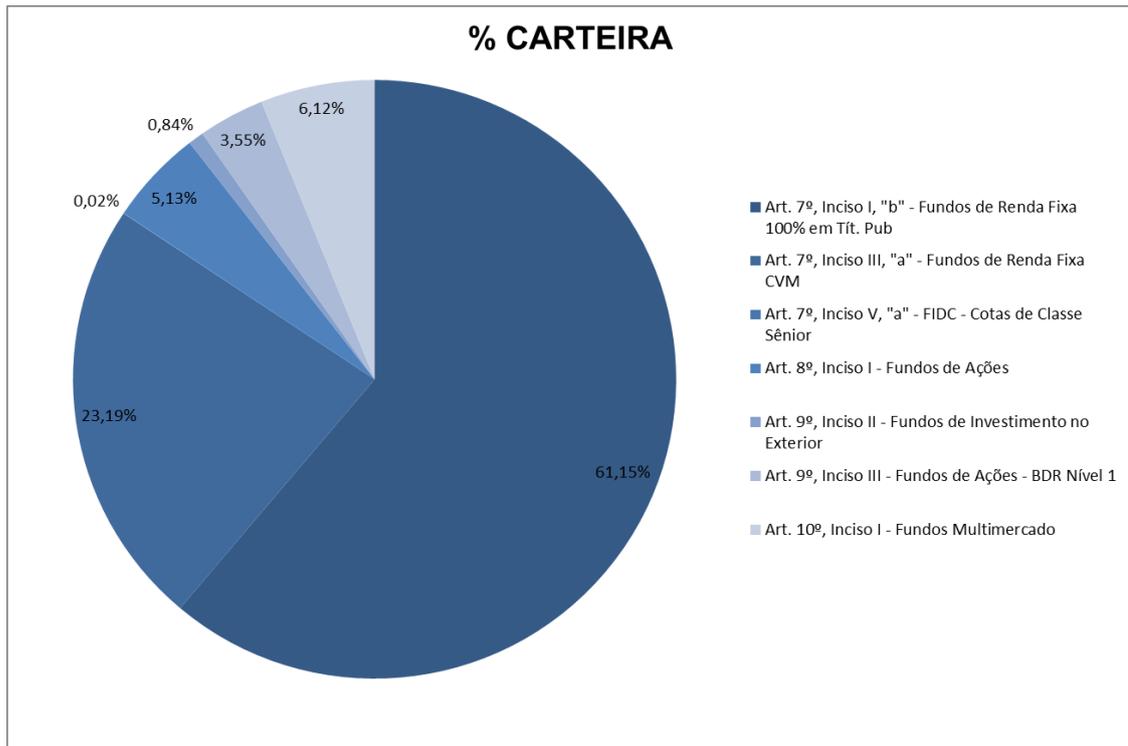
**SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS**

Fundo de Investimento	Saldo em 30/09/2022	Saldo em 31/10/2022	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$8.219,07	R\$8.291,90	R\$0,00	R\$72,83	0,89%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$803.422,71	R\$809.173,07	R\$0,00	R\$5.750,36	0,72%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$1.253.359,94	R\$1.254.362,99	-R\$9.593,21	R\$10.596,26	0,07%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	R\$2.540.185,27	R\$2.674.437,30	R\$0,00	R\$134.252,03	5,29%
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	R\$3.666.937,48	R\$3.712.637,37	R\$0,00	R\$45.699,89	1,25%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$7.309.815,33	R\$7.731.130,67	R\$0,00	R\$421.315,34	5,76%
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	R\$14.831.566,78	R\$15.111.751,09	R\$0,00	R\$280.184,31	1,89%
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	R\$15.105.388,24	R\$15.354.174,32	R\$0,00	R\$248.786,08	1,65%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$15.701.203,87	R\$16.490.608,66	R\$0,00	R\$789.404,79	5,03%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	R\$15.334.099,65	R\$16.564.282,24	R\$0,00	R\$1.230.182,59	8,02%
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	R\$16.117.103,55	R\$16.981.222,20	R\$0,00	R\$864.118,65	5,36%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$18.383.888,13	R\$19.517.992,90	R\$0,00	R\$1.134.104,77	6,17%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$19.529.032,66	R\$20.917.773,18	R\$0,00	R\$1.388.740,52	7,11%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$19.497.101,73	R\$21.101.758,73	R\$0,00	R\$1.604.657,00	8,23%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$20.901.446,26	R\$22.548.093,85	R\$0,00	R\$1.646.647,59	7,88%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$21.619.974,02	R\$22.868.432,62	R\$0,00	R\$1.248.458,60	5,77%
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	R\$25.143.841,30	R\$25.555.787,83	R\$0,00	R\$411.946,53	1,64%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$24.141.555,91	R\$25.648.381,52	R\$0,00	R\$1.506.825,61	6,24%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$29.168.210,38	R\$29.425.411,16	R\$0,00	R\$257.200,78	0,88%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$32.906.578,73	R\$35.440.340,50	R\$0,00	R\$2.533.761,77	7,70%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$33.400.808,65	R\$36.330.891,58	R\$0,00	R\$2.930.082,93	8,77%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	R\$37.039.810,50	R\$37.279.162,32	R\$0,00	R\$239.351,82	0,65%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$41.332.672,12	R\$42.036.569,71	R\$0,00	R\$703.897,59	1,70%
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	R\$42.957.700,04	R\$44.852.408,60	R\$0,00	R\$1.894.708,56	4,41%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	R\$56.985.128,54	R\$57.545.754,27	R\$0,00	R\$560.625,73	0,98%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	R\$74.476.427,92	R\$75.876.373,51	R\$0,00	R\$1.399.945,59	1,88%
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$80.169.183,31	R\$80.948.454,38	R\$0,00	R\$779.271,07	0,97%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	R\$133.675.948,58	R\$136.202.322,50	R\$0,00	R\$2.526.373,92	1,89%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	R\$138.812.716,09	R\$141.386.627,62	R\$0,00	R\$2.573.911,53	1,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$158.003.350,97	R\$160.966.549,81	R\$0,00	R\$2.963.198,84	1,88%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$195.595.914,57	R\$199.301.077,05	R\$0,00	R\$3.705.162,48	1,89%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	R\$219.611.256,30	R\$223.768.468,98	R\$0,00	R\$4.157.212,68	1,89%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	R\$379.318.262,49	R\$387.824.665,81	R\$0,00	R\$8.506.403,32	2,24%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$397.854.853,01	R\$401.961.397,13	R\$0,00	R\$4.106.544,12	1,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$427.869.434,17	R\$439.462.220,70	R\$7.114.000,00	R\$4.478.786,53	1,03%
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	R\$830.060.165,07	R\$848.626.893,55	R\$0,00	R\$18.566.728,48	2,24%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$3.551.126.563,34</b>	<b>R\$3.634.085.881,62</b>	<b>R\$7.104.406,79</b>	<b>R\$75.854.911,49</b>	<b>2,13%</b>

#### 4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA

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

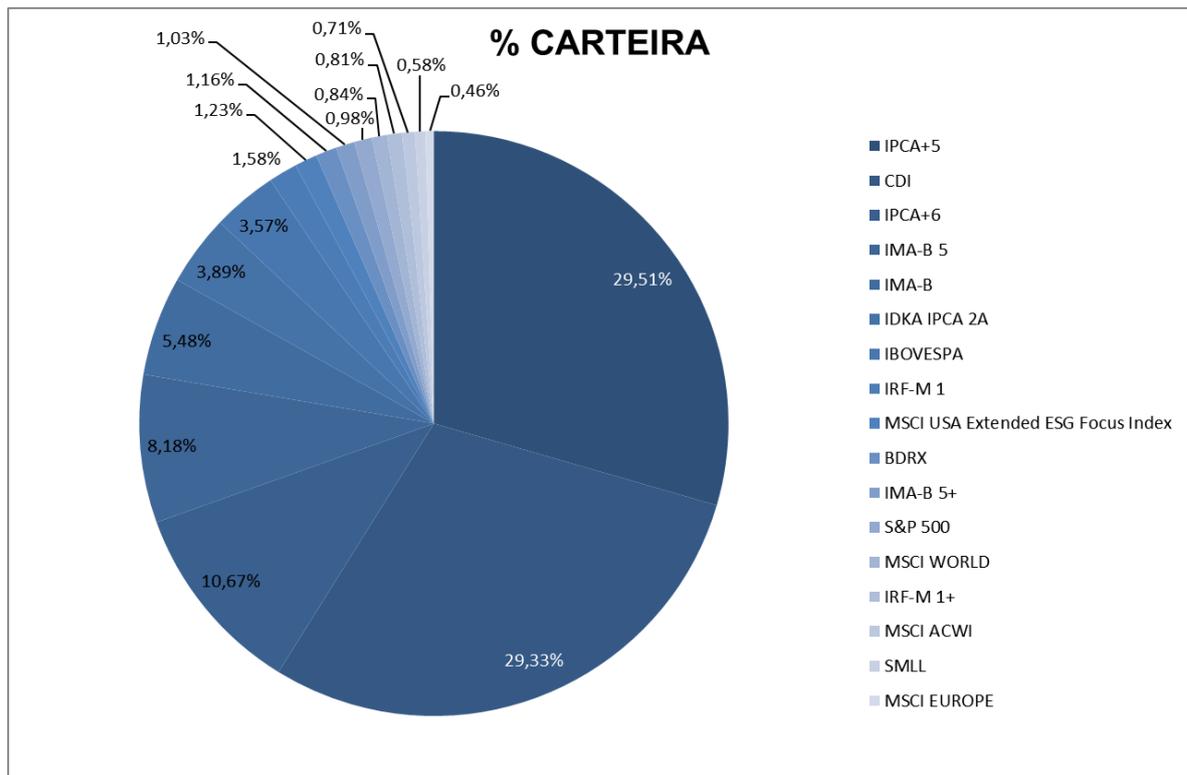
ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022							
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2022	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub</b>		<b>61,15%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$2.222.326.933,07</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	IRF-M 1	1,58%	100,00%	100,00%	100,00%	0,95%	R\$57.545.754,27
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	IDKA 2A	3,89%	100,00%	100,00%	100,00%	1,77%	R\$141.386.627,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	IMA-B 5	3,75%	100,00%	100,00%	100,00%	2,23%	R\$136.202.322,50
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	IMA-B 5	4,43%	100,00%	100,00%	100,00%	1,91%	R\$160.966.549,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5+ LP	IMA-B 5+	1,03%	100,00%	100,00%	100,00%	4,54%	R\$37.279.162,32
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	IPCA+6%	10,67%	100,00%	100,00%	100,00%	10,38%	R\$387.824.665,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	IPCA+5%	6,16%	100,00%	100,00%	100,00%	9,22%	R\$223.768.468,98
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	IPCA+5%	23,35%	100,00%	100,00%	100,00%	20,77%	R\$848.626.893,55
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	IMA-B	5,48%	100,00%	100,00%	100,00%	6,23%	R\$199.301.077,05
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	IRF-M 1+	0,81%	100,00%	100,00%	100,00%	16,28%	R\$29.425.411,16
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>23,19%</b>	<b>65,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$842.686.272,72</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	CDI	12,09%	65,00%	65,00%	20,00%	3,54%	R\$439.462.220,70
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	CDI	0,03%	65,00%	65,00%	20,00%	0,03%	R\$1.254.362,99
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	11,06%	65,00%	65,00%	20,00%	2,87%	R\$401.961.397,13
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	0,00%	65,00%	65,00%	20,00%	0,00%	R\$8.291,90
<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\$809.173,07</b>
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	CDI	0,02%	5,00%	0,50%	20,00%	3,64%	R\$809.173,07
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>5,13%</b>	<b>35,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$186.271.790,61</b>
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	IBOVESPA	0,45%	35,00%	35,00%	20,00%	10,23%	R\$16.490.608,66
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC FI	IBOVESPA	0,47%	35,00%	35,00%	20,00%	6,22%	R\$16.981.222,20
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,58%	35,00%	35,00%	20,00%	5,14%	R\$21.101.758,73
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	0,98%	35,00%	35,00%	20,00%	2,57%	R\$35.440.340,50
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	0,54%	35,00%	35,00%	20,00%	1,84%	R\$19.517.992,90
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	0,21%	35,00%	35,00%	20,00%	2,41%	R\$7.731.130,67
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,07%	35,00%	35,00%	20,00%	6,69%	R\$2.674.437,30
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	0,58%	35,00%	35,00%	20,00%	3,05%	R\$20.917.773,18
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	0,62%	35,00%	35,00%	20,00%	3,10%	R\$22.548.093,85
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	0,63%	35,00%	35,00%	20,00%	4,28%	R\$22.868.432,62
<b>Art. 9º, Inciso II - Fundos de Investimento no Exterior</b>		<b>0,84%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$30.465.925,41</b>
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE	MSCI WORLD	0,42%	10,00%	10,00%	20,00%	1,29%	R\$15.354.174,32
BB MULTIMERCADO NORDEA IE	MSCI WORLD	0,42%	10,00%	10,00%	20,00%	13,67%	R\$15.111.751,09
<b>Art. 9º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>3,55%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$129.101.642,07</b>
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,23%	10,00%	10,00%	20,00%	3,44%	R\$44.852.408,60
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	MSCI EUROPE	0,46%	10,00%	10,00%	20,00%	12,55%	R\$16.564.282,24
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	0,71%	10,00%	10,00%	20,00%	5,98%	R\$25.648.381,52
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	BDRX	1,16%	10,00%	10,00%	20,00%	2,07%	R\$42.036.569,71
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>6,12%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$222.424.144,67</b>
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	0,10%	10,00%	10,00%	20,00%	3,03%	R\$3.712.637,37
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	2,09%	10,00%	10,00%	20,00%	3,50%	R\$75.876.373,51
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	CDI	2,23%	10,00%	10,00%	20,00%	6,07%	R\$80.948.454,38
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	CDI	0,70%	10,00%	10,00%	20,00%	9,53%	R\$25.555.787,83
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	CDI	1,00%	10,00%	10,00%	20,00%	2,06%	R\$36.330.891,58
						<b>Total:</b>	<b>R\$3.634.085.881,62</b>



#### 4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

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

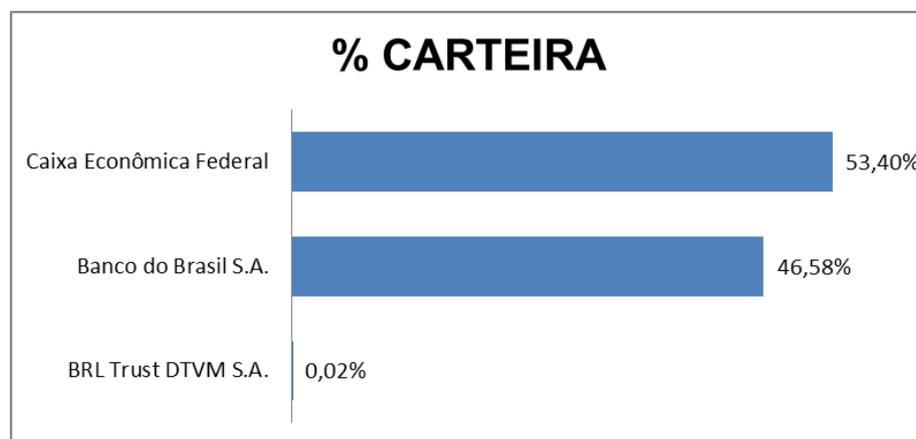
Indicador	Saldo em 31/10/2022	Participação
IPCA+5	R\$1.072.395.362,53	29,51%
CDI	R\$1.065.919.590,46	29,33%
IPCA+6	R\$387.824.665,81	10,67%
IMA-B 5	R\$297.168.872,31	8,18%
IMA-B	R\$199.301.077,05	5,48%
IDKA IPCA 2A	R\$141.386.627,62	3,89%
IBOVESPA	R\$129.913.676,93	3,57%
IRF-M 1	R\$57.545.754,27	1,58%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$44.852.408,60	1,23%
BDRX	R\$42.036.569,71	1,16%
IMA-B 5+	R\$37.279.162,32	1,03%
S&P 500	R\$35.440.340,50	0,98%
MSCI WORLD	R\$30.465.925,41	0,84%
IRF-M 1+	R\$29.425.411,16	0,81%
MSCI ACWI	R\$25.648.381,52	0,71%
SMLL	R\$20.917.773,18	0,58%
MSCI EUROPE	R\$16.564.282,24	0,46%
<b>Total</b>	<b>R\$3.634.085.881,62</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\$809.173,07	0,72%	0,02%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.692.655.685,15	2,17%	46,58%
Caixa Econômica Federal	R\$1.940.621.023,40	2,10%	53,40%



## 5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES

### MOVIMENTAÇÕES

APLICAÇÕES			RESGATES		
Data	Valor	Ativo	Data	Valor	Ativo
03/10/2022	R\$2.451,58	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	04/10/2022	R\$330.616,51	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
06/10/2022	R\$620,75	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	05/10/2022	R\$711.328,85	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
07/10/2022	R\$3.623,15	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	13/10/2022	R\$4.664.171,60	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
10/10/2022	R\$17.150,59	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	26/10/2022	R\$8.688.256,37	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
11/10/2022	R\$4.436.013,87	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	27/10/2022	R\$593.818,47	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
13/10/2022	R\$4.730.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
14/10/2022	R\$2.458,12	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
17/10/2022	R\$611,88	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
18/10/2022	R\$1.404,60	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
19/10/2022	R\$21.820,63	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
20/10/2022	R\$15.748,82	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
21/10/2022	R\$1.628,48	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
24/10/2022	R\$509,11	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
25/10/2022	R\$9.899.388,44	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
26/10/2022	R\$1.800.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC			
27/10/2022	R\$584.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC			
28/10/2022	R\$575.168,17	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			

TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES	
Aplicações	R\$22.092.598,19
Resgates	-R\$14.988.191,80
Saldo	R\$7.104.406,39

## 6. MONITORAMENTO DE RISCOS

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

#### Gráficos

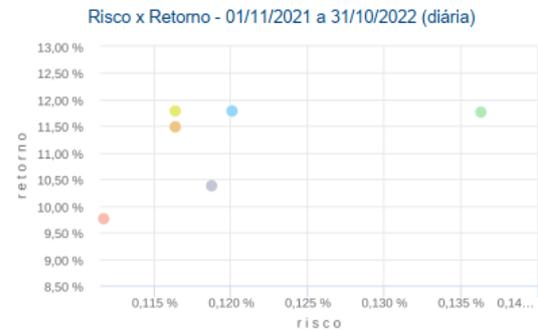


PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
BB TÍTULOS PÚBLICOS 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
CDI



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

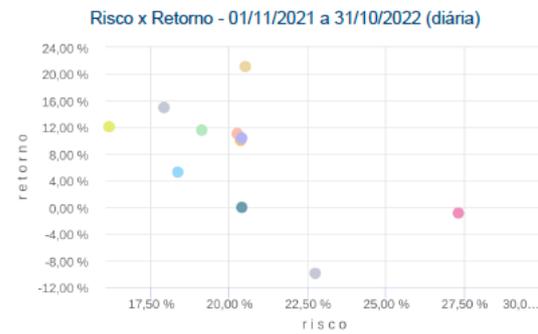
### Gráficos



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
CDI

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

### Gráficos

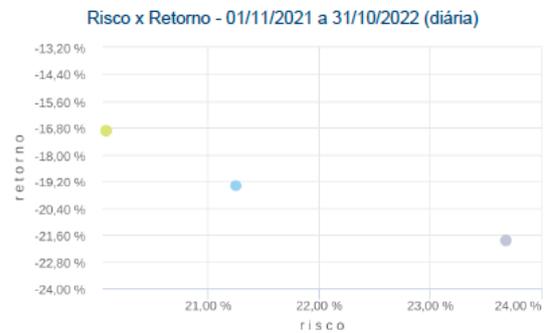


PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES
BB AGRO FIC AÇÕES
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES
CAIXA EXPERT CLARITAS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



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

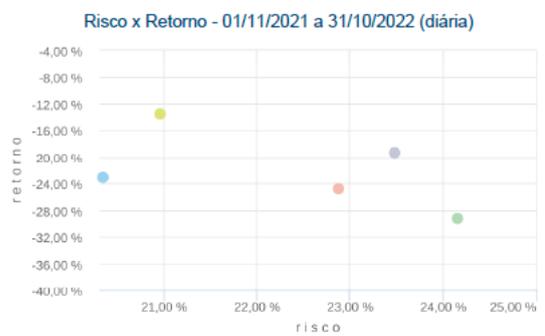
##### Gráficos



- 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

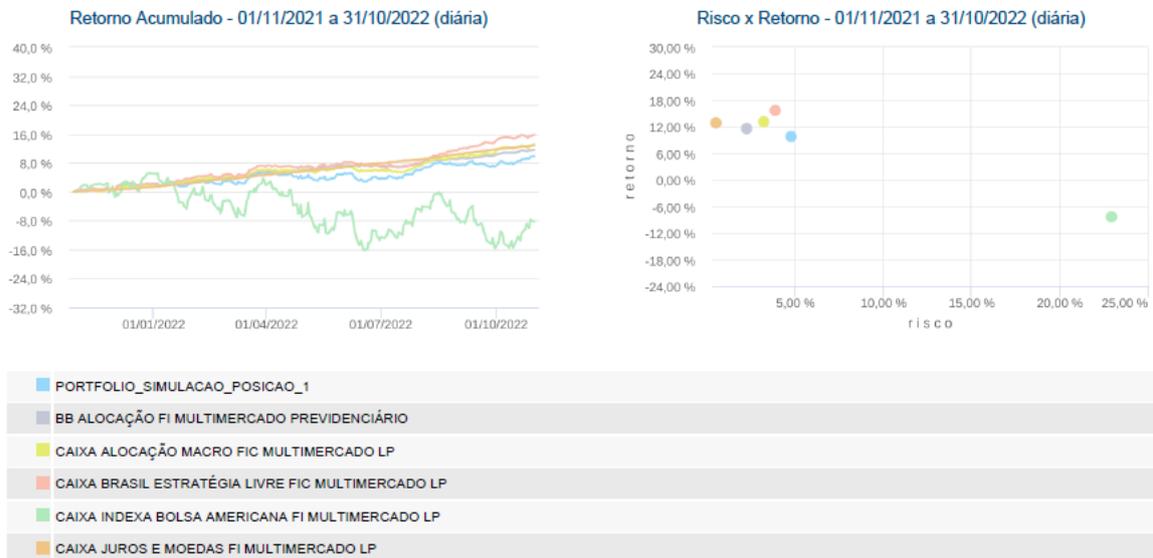


- PORTFOLIO\_SIMULACAO\_POSICAO\_1
- BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I
- BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I
- BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I
- CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I



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

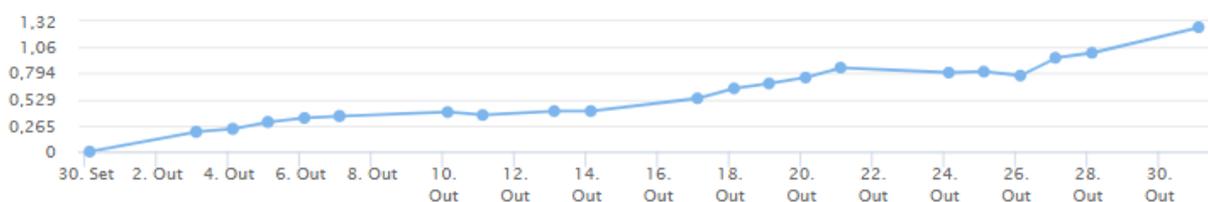
### Gráficos



## 7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

### 7.1. RENTABILIDADE

A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 1,26% no mês de outubro, totalizando um saldo de R\$ 206.095.857,36 (duzentos e seis milhões e noventa e cinco mil e oitocentos e cinquenta e sete reais e trinta e seis centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira ao longo do mês.





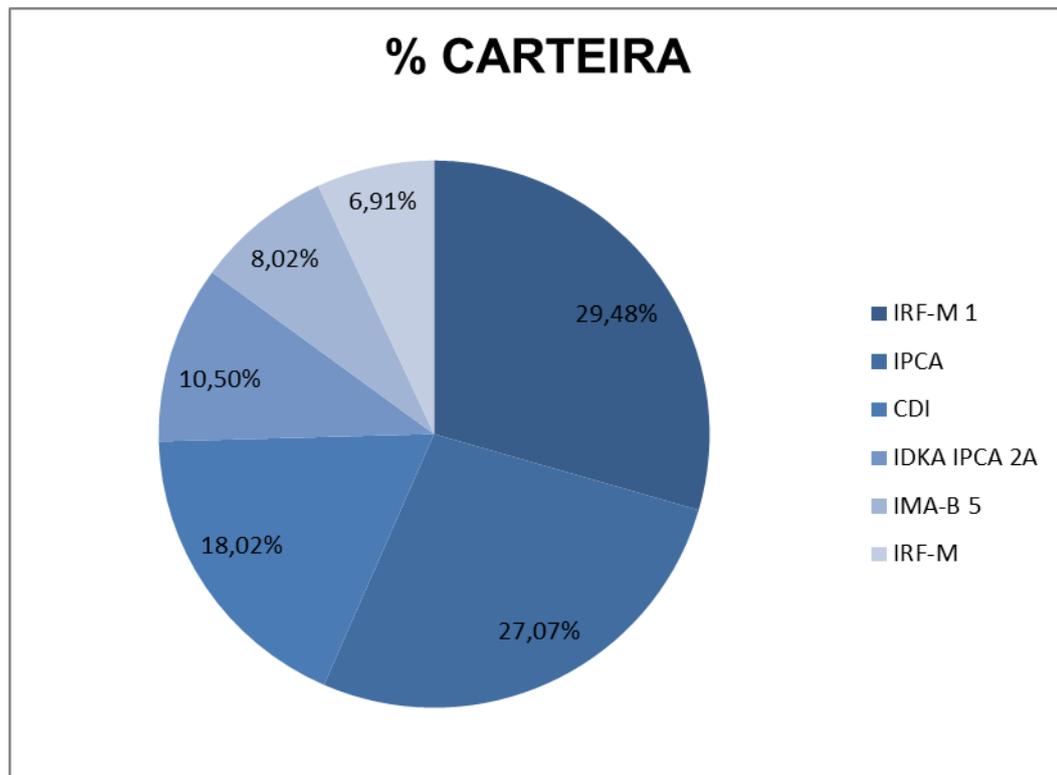
## 7.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022

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>54,91%</b>	<b>100,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>R\$113.165.200,52</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	IRF-M 1	29,39%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	1,00% ✓	R\$60.567.716,86
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	0,09%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	0,00% ✓	R\$187.117,03
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2A	10,50%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	0,27% ✓	R\$21.638.055,92
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	8,02%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	0,27% ✓	R\$16.528.499,72
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	IRF-M	6,91%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	0,35% ✓	R\$14.243.810,99
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>32,86%</b>	<b>65,00%</b> ✓	<b>65,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$67.728.397,09</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COT	CDI	5,61%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,09% ✓	R\$11.555.387,14
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	CDI	0,19%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,01% ✓	R\$388.791,63
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$1.165,69
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	27,07%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	1,76% ✓	R\$55.783.052,63
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>12,23%</b>	<b>10,00%</b> ✓	<b>10,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$25.202.259,75</b>
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	CDI	12,23%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	1,16% ✓	R\$25.202.259,75
<b>Total:</b>							<b>R\$206.095.857,36</b>

## 7.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

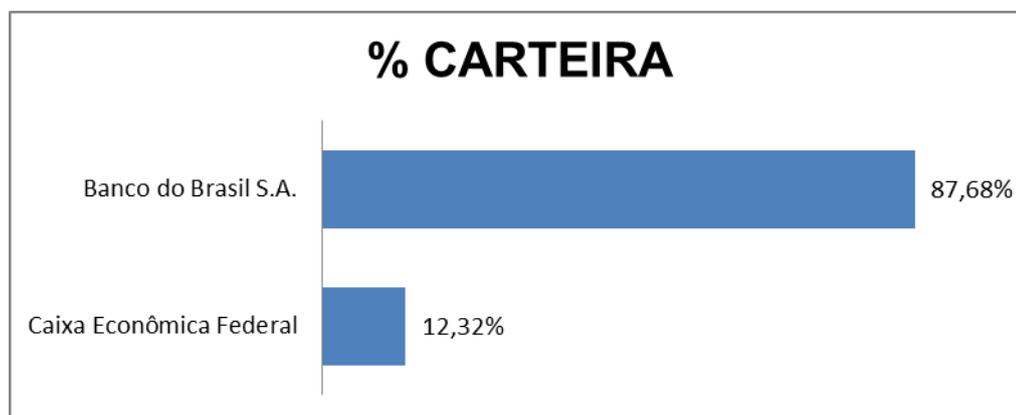
Indicador	Saldo em 31/10/2022	Participação
IRF-M 1	R\$60.754.833,89	29,48%
IPCA	R\$55.783.052,63	27,07%
CDI	R\$37.147.604,21	18,02%
IDKA IPCA 2A	R\$21.638.055,92	10,50%
IMA-B 5	R\$16.528.499,72	8,02%
IRF-M	R\$14.243.810,99	6,91%
	<b>R\$206.095.857,36</b>	<b>100,00%</b>



#### 7.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

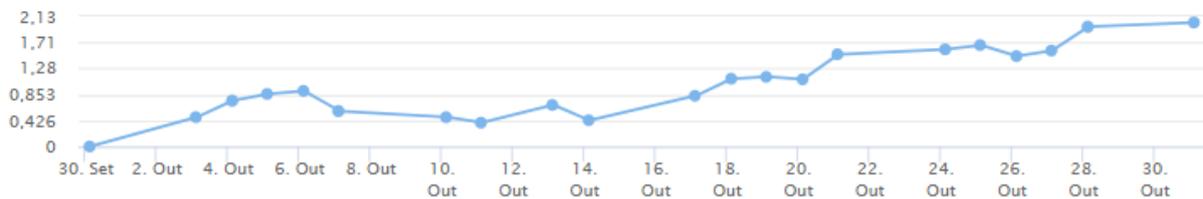
Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$25.390.542,47	12,32%
Banco do Brasil S.A.	R\$180.705.314,89	87,68%



## 8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021

### 8.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2021) apresentou um resultado positivo de 2,03% e fechou o mês com o saldo de R\$ 24.005.703,03 (vinte e quatro milhões e cinco mil e setecentos e três reais e três centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de outubro.



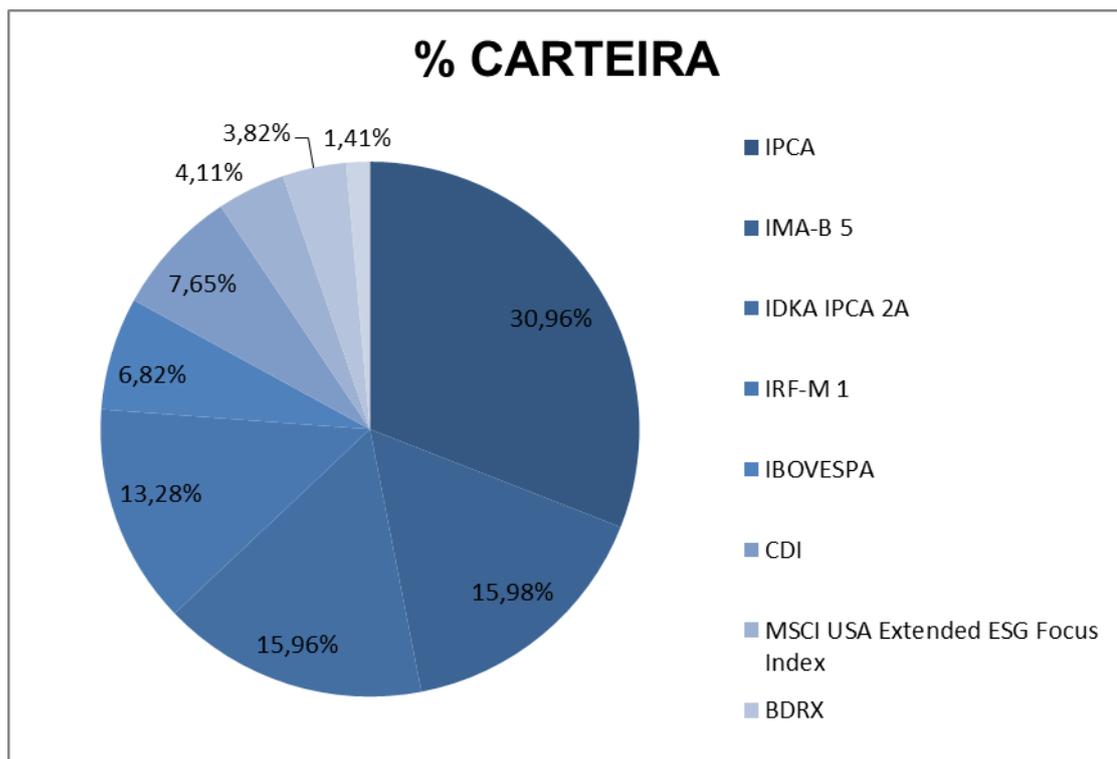
### 8.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022

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>60,57%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$14.540.826,30</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	6,72%	100,00%	100,00%	100,00%	0,03%	R\$1.612.569,02
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	6,57%	100,00%	100,00%	100,00%	0,03%	R\$1.576.155,19
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	IDKA 2A	15,96%	100,00%	100,00%	100,00%	0,05%	R\$3.832.169,04
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	IMA-B 5	15,98%	100,00%	100,00%	100,00%	0,06%	R\$3.835.245,60
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	15,35%	100,00%	100,00%	100,00%	0,06%	R\$3.684.687,45
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>15,61%</b>	<b>65,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$3.747.547,03</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	IPCA	15,61%	65,00%	65,00%	20,00%	0,12%	R\$3.747.547,03
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>8,24%</b>	<b>35,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$1.977.444,50</b>
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC DE FIA	IBOVESPA	1,79%	35,00%	35,00%	20,00%	0,04%	R\$430.558,69
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	1,49%	35,00%	35,00%	20,00%	0,03%	R\$358.160,25
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	1,87%	35,00%	35,00%	20,00%	0,08%	R\$448.106,09
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	1,67%	35,00%	35,00%	20,00%	0,06%	R\$401.467,16
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	1,41%	35,00%	35,00%	20,00%	0,05%	R\$339.152,31
<b>Art. 9º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>7,93%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$1.903.034,18</b>
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	4,11%	10,00%	10,00%	20,00%	0,08%	R\$985.507,36
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	3,82%	10,00%	10,00%	20,00%	0,05%	R\$917.526,82
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>7,65%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>15,00%</b>	<b>R\$1.836.851,03</b>
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	CDI	2,63%	10,00%	10,00%	20,00%	0,52%	R\$630.215,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,67%	10,00%	10,00%	20,00%	0,24%	R\$640.600,76
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	CDI	2,36%	10,00%	10,00%	20,00%	0,03%	R\$566.034,57
<b>Total:</b>							<b>R\$24.005.703,04</b>

### 8.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

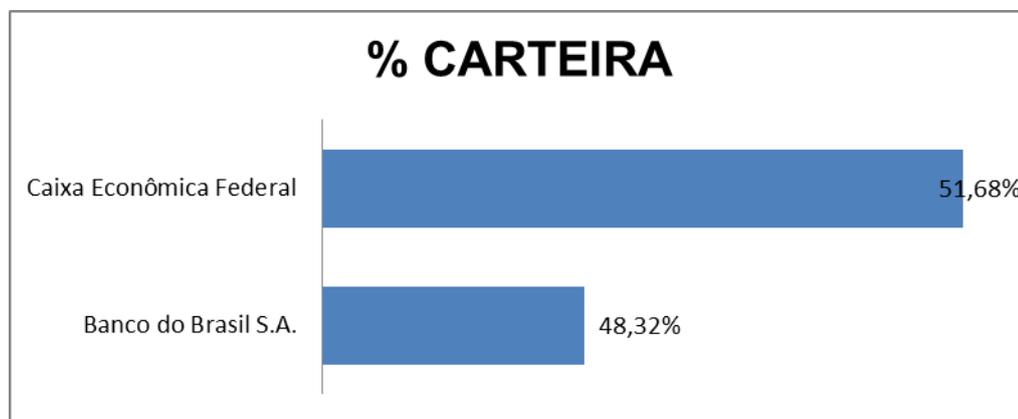
Indicador	Saldo em 31/10/2022	Participação
IPCA	R\$7.432.234,48	30,96%
IMA-B 5	R\$3.835.245,60	15,98%
IDKA IPCA 2A	R\$3.832.169,04	15,96%
IRF-M 1	R\$3.188.724,21	13,28%
IBOVESPA	R\$1.638.292,19	6,82%
CDI	R\$1.836.851,03	7,65%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$985.507,36	4,11%
BDRX	R\$917.526,82	3,82%
SMLL	R\$339.152,31	1,41%
	<b>R\$24.005.703,04</b>	<b>100,00%</b>



#### 8.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$11.599.803,65	48,32%
Caixa Econômica Federal	R\$12.405.899,39	51,68%



## 9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022

### 9.1. RENTABILIDADE

A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022) apresentou um resultado de 2,24% e fechou o mês com o saldo de R\$ 17.216.674,75 (Dezessete milhões e duzentos e dezesseis mil e seiscentos e setenta e quatro reais e setenta e cinco centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de outubro.





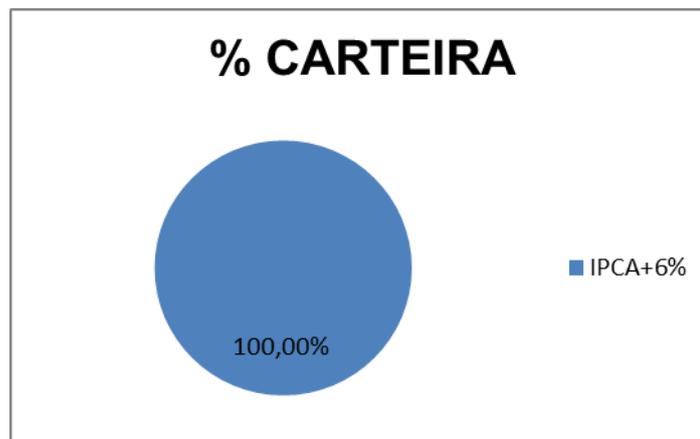
## 9.2. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022

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	% Participação	Total
Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tít. Pub		100,00%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	R\$17.216.674,75
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	IPCA+6%	100,00%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	0,46% ✓	R\$17.216.674,75
<b>Total:</b>							<b>R\$17.216.674,75</b>

## 9.3. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

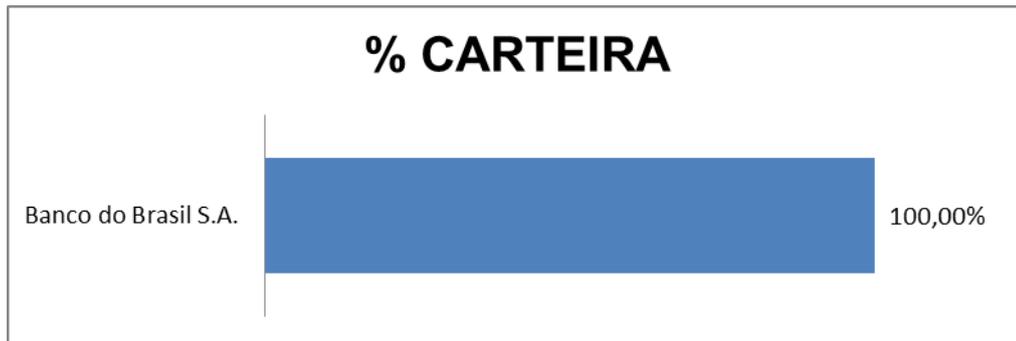
Indicador	Saldo em 31/10/2022	Participação
IPCA+6%	R\$17.216.674,75	100,00%
	<b>R\$17.216.674,75</b>	<b>100,00%</b>



## 9.4. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$17.216.674,75	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 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 outubro de 2022 com o Patrimônio Consolidado de R\$ 3.881.404.116,77 (três bilhões e oitocentos e oitenta e um milhões e quatrocentos e quatro mil e cento e dezesseis reais e setenta e sete centavos).

Macaé, 21 de Novembro de 2022.

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



## PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e três dias do mês de novembro 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 **outubro de 2022**.

Considerando todas as informações constantes no relatório do gestor de investimentos o qual segue na íntegra na ata do dia de hoje, 23 de novembro de 2022.

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

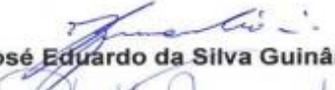
Considerando, por fim, que os investimentos são aderentes à Política Anual de Investimentos do Macaeprev de 2022 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução CMN 4.963, **APROVAMOS** o relatório apresentado referente a **OUTUBRO de 2022**, o qual segue para aprovação do Conselho Fiscal. É o parecer.

  
Alfredo Tanos Filho

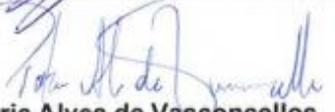
  
Claudio de Freitas Duarte

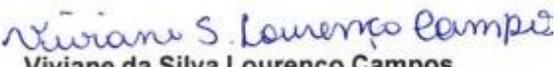
  
Erenildo Motta da Silva Júnior

  
Isabella Felix Viana

  
José Eduardo da Silva Guinâncio

  
Miriam Amaral Queiroz

  
Patric Alves de Vasconcellos

  
Viviane da Silva Lourenço Campos



## RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

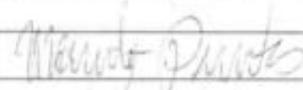
OUTUBRO DE 2022

### TERMO DE APROVAÇÃO CONSELHO FISCAL

Ao dia 08/12/2022, 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 **OUTUBRO de 2022**. Considerando todas as informações constantes no presente relatório, **APROVAMOS** o relatório de investimentos referente à **OUTUBRO DE 2022**.

*Macaé, 08 de dezembro de 2022.*

#### CONSELHO FISCAL

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