



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

1 ATA Nº 37/2021 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 22/10/2021 – Ata de Reunião  
2 Ordinária do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Social do Município de  
3 Macaé – Macaeprev, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, sediado à Rua  
4 Tenente Rui Lopes Ribeiro, duzentos e noventa e três, Centro, Macaé, Rio de Janeiro,  
5 realizada às dezessete horas do dia vinte e dois de outubro de dois mil e vinte e um, estando  
6 presentes via plataforma de reunião *Google Meet*, os membros constituídos através da  
7 portaria de nomeação n.º 289/2021: **Alfredo Tanos Filho, Claudio de Freitas Duarte,**  
8 **Erenildo Motta da Silva Júnior, Isabella Felix Viana, José Eduardo da Silva Guinâncio,**  
9 **Maria Auxiliadora de Moura Ferreira, Patric Alves de Vasconcellos e Rose Mary**  
10 **Gomes**, em virtude da pandemia do Coronavírus. I – JUSTIFICATIVA: Iniciada a reunião, foi  
11 registrado que a presente está ocorrendo hoje, com a concordância de todos os membros  
12 via grupo de whatsapp, e não no dia 20 de outubro, conforme cronograma, em virtude dos  
13 membros **Claudio, Erenildo e Patric** estarem, naquela data, participando do XIV Congresso  
14 de Previdência da Aepremerj no Município de Angra dos Reis. II – POLÍTICA DE  
15 SEGURANÇA DA INFORMAÇÃO E CÓDIGO DE ÉTICA: Os membros deste Comitê  
16 registram que estão cientes do conteúdo dos arquivos publicados no *site* do Macaeprev  
17 acerca da Política de Segurança da Informação e do Código de Ética, nos endereços:  
18 <http://www.macaee.rj.gov.br/macaeprev/conteudo/titulo/politica-de-seguranca-da-informacao> e  
19 <http://macaee.rj.gov.br/midia/conteudo/arquivos/1629755385.pdf>. III – RELATÓRIO DE  
20 INVESTIMENTOS DO MACAEPREV - SETEMBRO DE 2021: Passada a palavra para o  
21 membro e gestor dos fundos de investimentos **Erenildo**, apresentou o Relatório de  
22 Investimentos do Macaeprev referente ao mês de setembro de 2021, no qual destacamos: 1  
23 – **Resultado da Carteira**: Em relação ao desempenho do nosso portfólio, setembro foi mais  
24 um mês em que a Carteira apresentou desempenho negativo em relação à Meta Atuarial. A  
25 Carteira fechou com queda de -0,05%, enquanto a Meta Atuarial, representada pelo IPCA +  
26 6%, foi de 1,65%. Logo, a Carteira não atingiu a Meta Atuarial. Nos quadros a seguir pode-  
27 se observar o desempenho da Carteira em 2021.

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

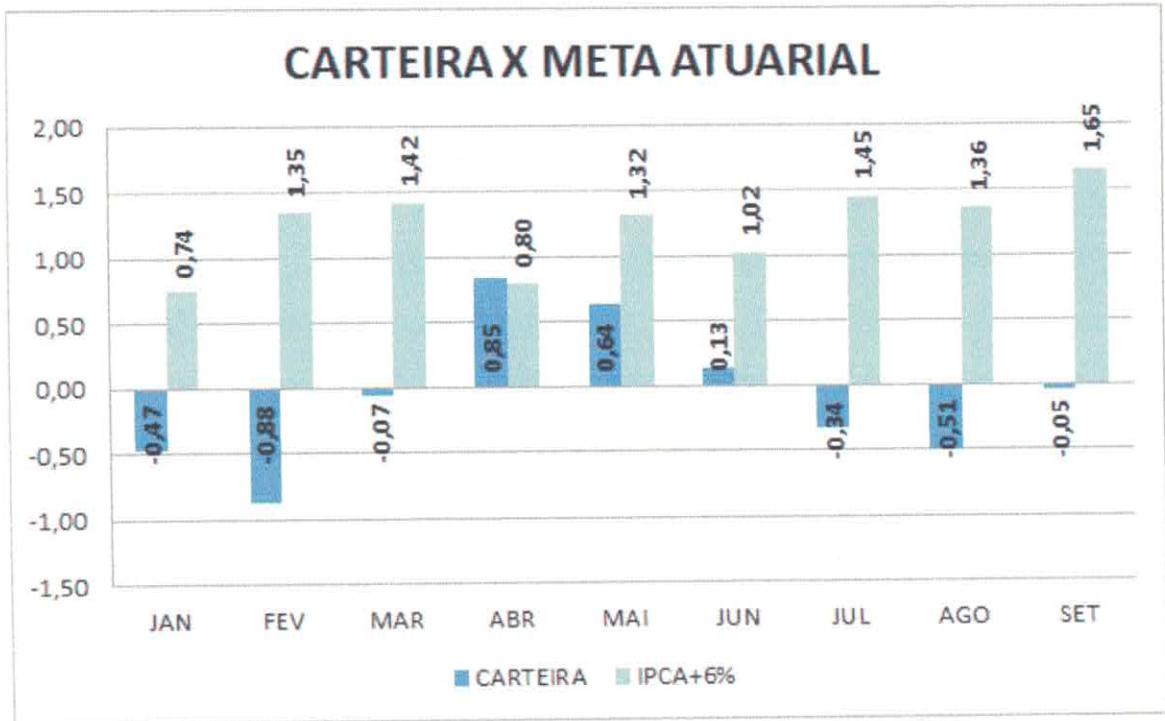
2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
CARTEIRA	-0,47	-0,88	-0,07	0,85	0,64	0,13	-0,34	-0,51	-0,05				-0,71
IPCA+6%	0,74	1,35	1,42	0,80	1,32	1,02	1,45	1,36	1,65				11,67

29

*Alfredo Tanos Filho* *Patric Alves de Vasconcellos* *Erenildo Motta da Silva Júnior* *Isabella Felix Viana* *José Eduardo da Silva Guinâncio* *Maria Auxiliadora de Moura Ferreira* *Rose Mary Gomes*



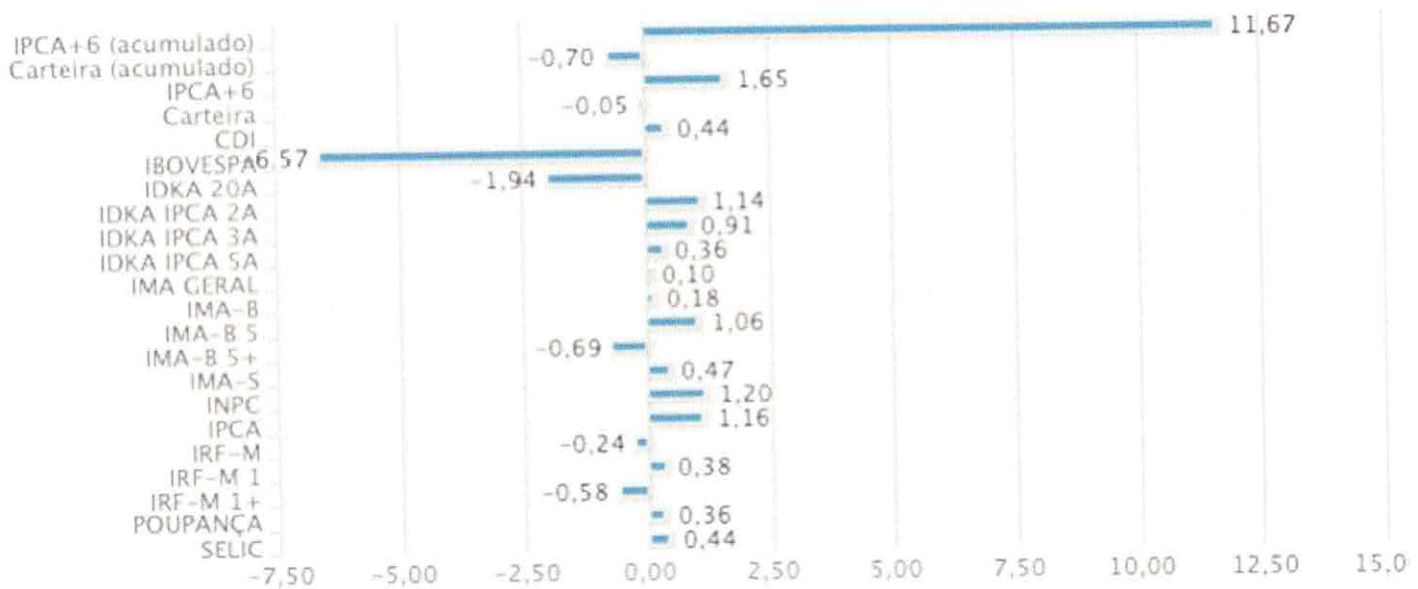
**Estado do Rio de Janeiro**  
**Município de Macaé**  
**Instituto de Previdência Social**  
**Comitê de Investimentos**



30  
31  
32  
33

Em seguida, o gestor de investimentos **Erenildo** apresentou o quadro com o comportamento da Carteira, Meta Atuarial e diversos índices do mercado.

### Rentabilidade dos indicadores e da Carteira



34  
35  
36

O comportamento da carteira ao longo do mês de setembro foi demonstrado na próxima imagem:

Erenildo



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



37  
38

39 Informou **Erenildo** que apenas três fundos superaram a Meta Atuarial em setembro. Os  
40 fundos com melhor desempenho em setembro foram o FIDC Multisetorial Itália com 6,19%,  
41 BB Ações Agro com rentabilidade de 3,61%, seguido pelo fundo de vértice Caixa FI Brasil  
42 2022 I TP RF que rendeu 1,66%. Os fundos que acompanham a bolsa americana com  
43 proteção cambial apresentaram um retorno médio negativo de -4,16%. Os fundos de ações  
44 tiveram uma rentabilidade média negativa de -3,71%. Já os fundos com BDRs na carteira  
45 tiveram um retorno de -0,88%. Os fundos Multimercado tiveram uma rentabilidade média de  
46 -0,96%. Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma rentabilidade média  
47 de 0,36%. O fundo de vértice Caixa FI Brasil 2024 IV TP RF teve uma rentabilidade de  
48 0,96%. Os fundos de renda fixa com gestão ativa apresentaram uma rentabilidade média de  
49 0,23%. Já os fundos que buscam acompanhar o IMA Geral tiveram um retorno de 0,26%. Os  
50 fundos IMA-B renderam -0,05% em média. Os fundos IMA-B 5 tiveram um retorno de 0,98%.  
51 Enquanto os fundos IDKA 2A renderam 1,06%. Os fundos indexados ao IRF-M 1+ tiveram,  
52 em média, uma rentabilidade negativa de -1,13%. Os fundos atrelados ao IRF-M tiveram  
53 uma rentabilidade média na casa de -0,38%. Os fundos IRF-M 1 tiveram um retorno médio  
54 de 0,35%. O FIDC Multisetorial Itália teve uma rentabilidade de 6,19%. Até 30 de setembro  
55 de 2021 foram resgatados o total de R\$ 8.565.032,04 (oito milhões e quinhentos e sessenta  
56 e cinco mil e trinta e dois reais e quatro centavos), cerca de 85% do total investido. Em  
57 setembro, o fundo apresentou resultado positivo de R\$ 111.067,02 (cento e onze mil e  
58 sessenta e sete reais e dois centavos). O saldo em 30 de setembro estava em R\$  
59 1.467.062,72 (um milhão e quatrocentos e sessenta e sete mil e sessenta e dois reais e  
60 setenta e dois centavos). O gráfico a seguir mostra a comparação entre a rentabilidade dos  
61 fundos e a meta atuarial. Os fundos na cor vermelha apresentaram resultado negativo, os  
62 fundos em amarelo apresentaram resultado positivo, porém, abaixo da Meta Atuarial,  
63 enquanto os fundos na cor verde bateram a Meta Atuarial.

*Handwritten signature*

*Handwritten mark*

*Handwritten signature*

*Handwritten signature*

3

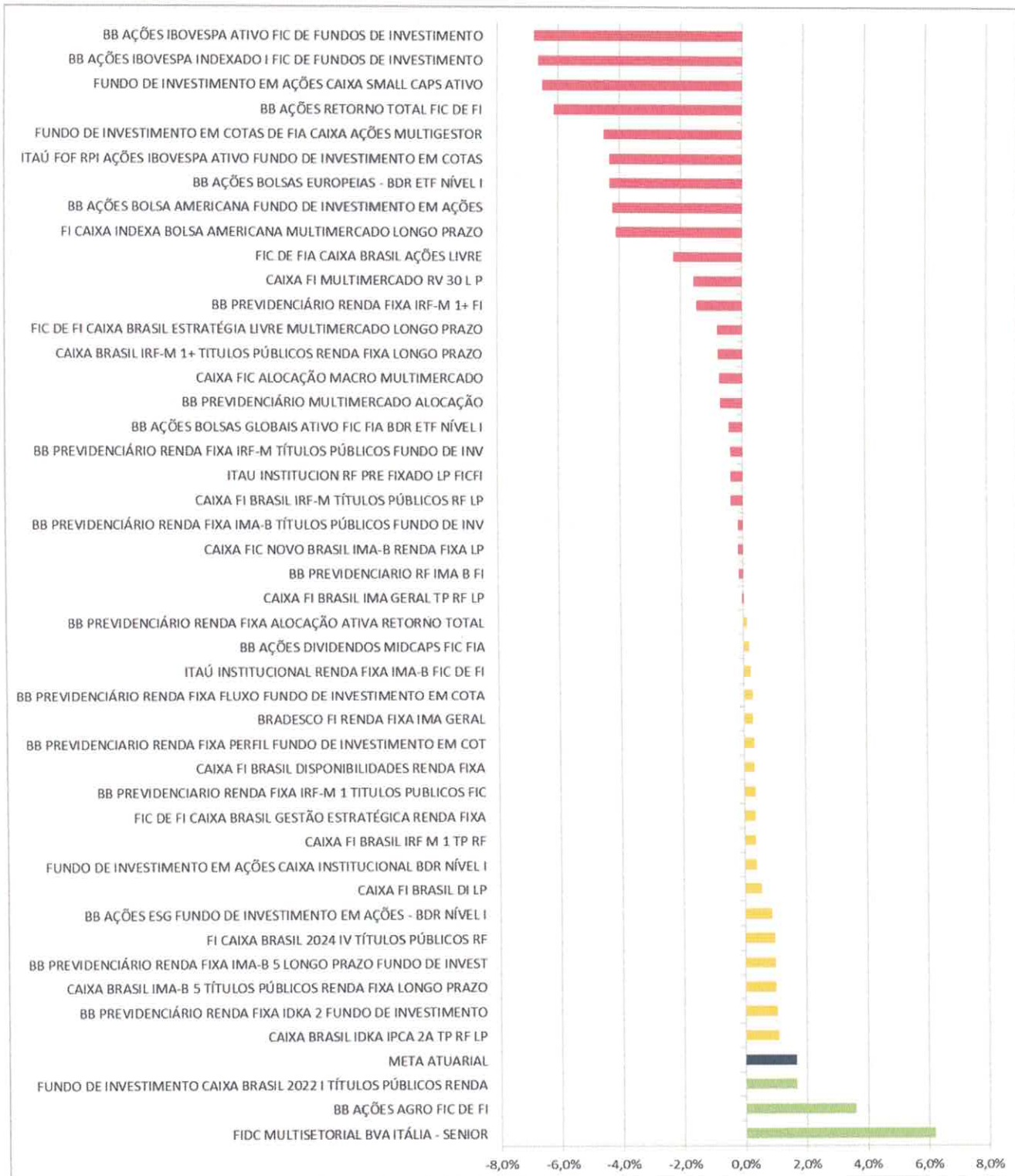
*Handwritten signature*

*Handwritten signature*  
Rjoms

*Handwritten signature*



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



64

65 O rendimento de setembro da Carteira do Instituto foi negativo em R\$ -2.108.437,86 (dois  
66 milhões e cento e oito mil e quatrocentos e trinta e sete reais e oitenta e seis centavos). O  
67 Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de setembro em R\$ 3.256.426.937,18  
68 (três bilhões e duzentos e cinquenta e seis milhões e quatrocentos e vinte e seis mil e  
69 novecentos e trinta e sete reais e dezoito centavos).

*Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.*



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

**SALDO E RENTABILIDADE DOS FUNDOS**

Fundo de Investimento	Saldo em 31/08/2021	Saldo em 30/09/2021	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
ITAU INSTITUCION RF PRE FIXADO LP FICFI	R\$4.707.372,42	R\$0,00	-R\$4.689.364,19	-R\$18.008,26	-0,38%
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC	R\$28.470.119,82	R\$0,00	-R\$27.241.058,98	-R\$1.229.060,84	-4,32%
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B FIC DE FI	R\$33.798.185,52	R\$0,00	-R\$33.879.753,49	R\$81.567,78	0,24%
BRADESCO FI RENDA FIXA IMA GERAL	R\$103.701.028,90	R\$0,00	-R\$103.996.188,23	R\$295.159,32	0,28%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$995,98	R\$999,46	R\$0,00	R\$3,48	0,33%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$949.154,08	R\$971.094,99	R\$19.293,18	R\$2.647,73	0,27%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$1.793.332,53	R\$1.467.062,72	R\$0,00	R\$111.067,02	6,19%
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	R\$3.353.854,26	R\$3.330.171,42	R\$0,00	-R\$23.682,84	-0,71%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$3.906.415,56	R\$3.900.849,66	R\$0,00	-R\$5.565,90	-0,14%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$0,00	R\$4.132.827,60	R\$4.125.000,00	R\$7.827,60	0,19%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	R\$11.486.495,46	R\$12.043.189,12	R\$1.101.000,00	-R\$544.306,34	-4,32%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$11.742.071,83	R\$15.513.719,69	R\$4.125.000,00	-R\$353.352,14	-2,23%
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	R\$15.474.780,00	R\$15.731.980,00	R\$0,00	R\$257.200,00	1,66%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$17.271.521,21	R\$16.099.621,46	R\$0,00	-R\$1.171.899,75	-6,79%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$12.961.483,55	R\$16.317.233,60	R\$4.125.000,00	-R\$769.249,95	-4,50%
BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO I FIC DE FI	R\$17.572.126,76	R\$16.402.976,19	R\$0,00	-R\$1.169.150,57	-6,65%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$11.841.508,33	R\$16.542.596,77	R\$4.125.000,00	R\$576.088,44	3,61%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$17.911.583,87	R\$16.742.893,35	R\$0,00	-R\$1.168.690,51	-6,52%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$14.466.384,14	R\$17.450.325,58	R\$4.125.000,00	-R\$1.141.058,56	-6,14%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$0,00	R\$20.812.063,34	R\$20.900.000,00	-R\$87.936,66	-0,42%
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	R\$22.533.936,12	R\$22.356.631,86	R\$0,00	-R\$177.304,26	-0,79%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$54.900.149,97	R\$27.243.310,72	-R\$27.250.000,00	-R\$406.839,25	-1,47%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$28.021.060,45	R\$31.846.895,42	R\$5.226.000,00	-R\$1.400.165,03	-4,21%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$28.124.036,02	R\$31.978.420,15	R\$5.226.000,00	-R\$1.371.615,87	-4,11%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$28.185.045,34	R\$45.951.104,79	R\$17.601.000,00	R\$165.059,45	0,36%
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	R\$28.352.725,76	R\$46.347.960,75	R\$17.601.000,00	R\$394.234,99	0,86%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	R\$88.188.869,59	R\$67.684.413,64	R\$0,00	-R\$504.455,95	-0,74%
CAIXA FI MULTIMERCADO RV 30 L P	R\$89.735.628,30	R\$88.320.311,23	R\$0,00	-R\$1.415.317,07	-1,58%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$105.873.011,55	R\$106.433.872,19	R\$0,00	R\$560.860,64	0,53%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$110.225.043,47	R\$113.673.713,08	R\$3.055.423,11	R\$393.246,50	0,35%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	R\$113.056.384,13	R\$115.192.532,57	R\$1.750.919,54	R\$385.228,90	0,34%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	R\$114.703.594,14	R\$115.824.919,44	R\$0,00	R\$1.121.325,30	0,98%
CAIXA FI BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$119.032.190,34	R\$118.592.811,58	R\$0,00	-R\$439.378,76	-0,37%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	R\$122.212.787,41	R\$122.025.105,09	R\$0,00	-R\$187.682,32	-0,15%
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	R\$142.880.954,71	R\$142.856.941,49	R\$0,00	-R\$24.013,22	-0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$143.354.723,62	R\$144.761.126,70	R\$0,00	R\$1.406.403,08	0,98%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B FI	R\$146.237.747,27	R\$146.047.386,24	R\$0,00	-R\$190.361,03	-0,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$161.811.772,26	R\$160.550.438,27	R\$0,00	-R\$1.261.333,99	-0,78%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	R\$168.511.569,12	R\$167.878.253,35	R\$0,00	-R\$633.315,77	-0,38%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$167.025.800,96	R\$168.633.331,31	R\$0,00	R\$1.607.530,35	0,96%
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	R\$172.343.596,19	R\$172.955.336,21	R\$0,00	R\$611.740,02	0,35%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	R\$204.560.264,15	R\$206.674.284,93	R\$0,00	R\$2.114.020,78	1,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	R\$207.770.440,48	R\$207.993.200,64	R\$0,00	R\$222.760,16	0,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	R\$219.277.237,89	R\$221.641.735,18	R\$0,00	R\$2.364.497,29	1,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$174.846.477,25	R\$285.503.295,40	R\$109.750.000,00	R\$906.818,15	0,32%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$3.253.173.440,71</b>	<b>R\$3.256.426.937,18</b>	<b>R\$5.799.270,94</b>	<b>-R\$2.108.437,86</b>	<b>-0,05%</b>

70  
*Shiane*

*Ernildo*      *Samuel*      *R Jones*

*[Handwritten signature]*



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

71 **1.2- Distribuição de Recursos da Carteira: 1.2.1. ADERÊNCIA em relação à Resolução**  
 72 **3922/2010 e à PAI 2021:**

**ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 3922/2010 E À PAI 2021**

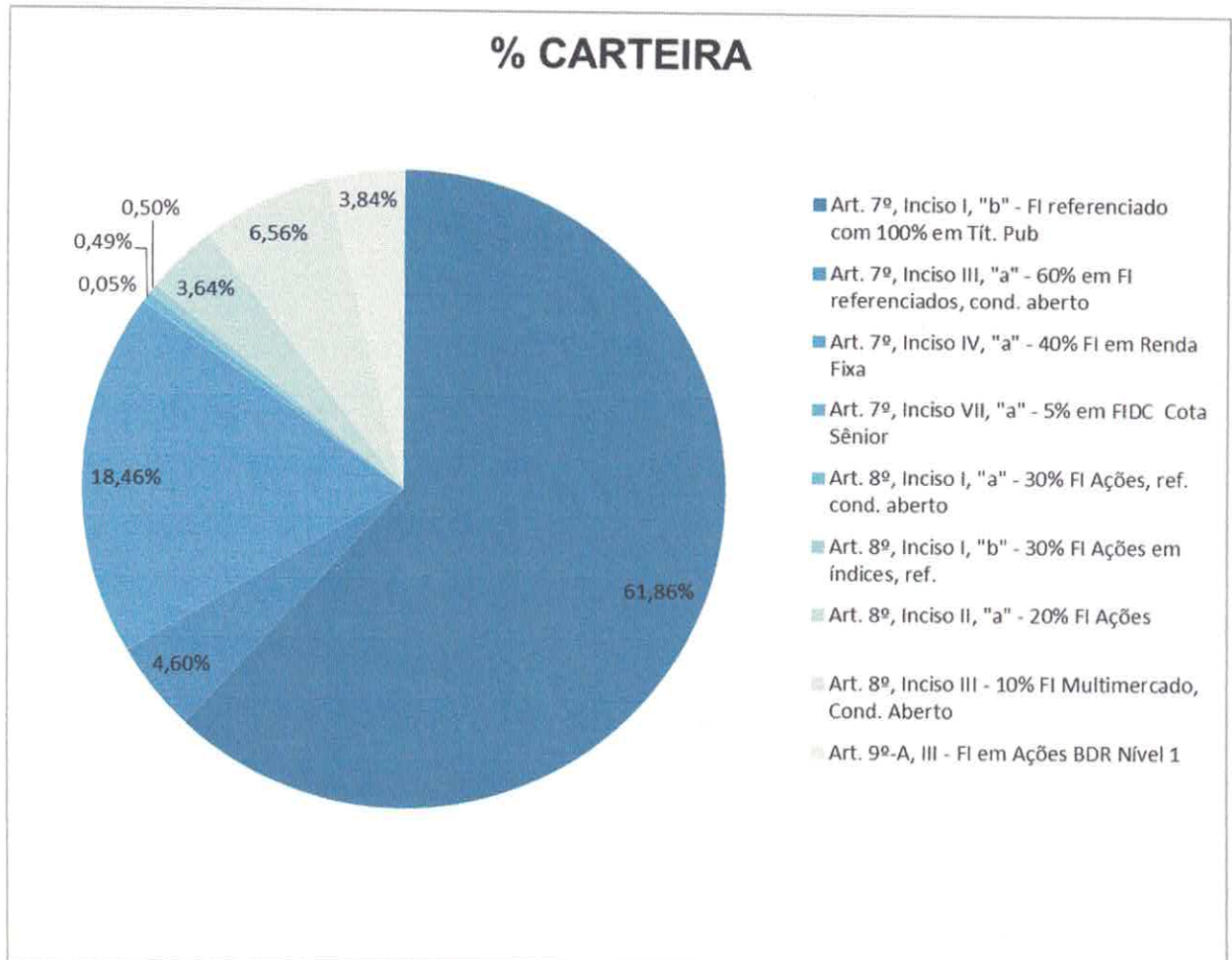
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2021	% Participação no Pl. do Fundo	Total
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - FI referenciado com 100% em Tit. Pub</b>		<b>61,86%</b>	<b>100,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$2.014.235.819,92</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	3,54%	100,00% ✓	100,00% ✓	1,67% ✓	R\$115.192.532,57
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	IRF-M 1	3,49%	100,00% ✓	100,00% ✓	1,67% ✓	R\$113.673.713,08
BB PREVID RF IDKA 2 FI	IDKA 2A	6,35%	100,00% ✓	100,00% ✓	2,19% ✓	R\$206.674.284,93
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF	IDKA 2A	6,81%	100,00% ✓	100,00% ✓	2,00% ✓	R\$221.641.735,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	IMA-B 5	3,56%	100,00% ✓	100,00% ✓	1,90% ✓	R\$115.824.919,44
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	IMA-B 5	4,45%	100,00% ✓	100,00% ✓	1,30% ✓	R\$144.761.126,70
FI CAIXA BRASIL 2022 I TP RF	IPCA+6%	0,48%	100,00% ✓	100,00% ✓	17,22% ✗	R\$15.731.980,00
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL	IMA Geral	4,39%	100,00% ✓	100,00% ✓	13,95% ✓	R\$142.856.941,49
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	IMA-B	3,75%	100,00% ✓	100,00% ✓	1,69% ✓	R\$122.025.105,09
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	IMA-B	5,18%	100,00% ✓	100,00% ✓	12,02% ✓	R\$168.633.331,31
BB PREVID. RF IRF-M TP FI	IRF-M	5,16%	100,00% ✓	100,00% ✓	2,70% ✓	R\$167.878.253,35
CAIXA FI BRASIL IRF-M TP RF LP	IRF-M	3,64%	100,00% ✓	100,00% ✓	8,55% ✓	R\$118.592.811,58
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+	IRF-M 1+	0,84%	100,00% ✓	100,00% ✓	13,04% ✓	R\$27.243.310,72
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1+ TP RF L	IRF-M 1+	4,93%	100,00% ✓	100,00% ✓	10,85% ✓	R\$160.550.438,27
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRAT	IPCA	5,31%	100,00% ✓	100,00% ✓	1,20% ✓	R\$172.955.336,21
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - 60% em FI referenciados, cond. aberto</b>		<b>4,60%</b>	<b>60,00%</b> ✓	<b>60,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$149.948.235,90</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B	IMA-B	4,48%	60,00% ✓	60,00% ✓	12,55% ✓	R\$146.047.386,24
FIC NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA	IMA-B	0,12%	60,00% ✓	60,00% ✓	0,15% ✓	R\$3.900.849,66
<b>Art. 7º, Inciso IV, "a" - 40% FI em Renda Fixa</b>		<b>18,46%</b>	<b>40,00%</b> ✓	<b>40,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$600.902.462,68</b>
BB PREVID RF PERFIL FI EM COTAS	CDI	8,77%	20,00% ✓	20,00% ✓	5,22% ✓	R\$285.503.295,40
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO	CDI	0,03%	20,00% ✓	20,00% ✓	0,04% ✓	R\$971.094,99
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	3,27%	20,00% ✓	20,00% ✓	1,47% ✓	R\$106.433.872,19
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES	CDI	0,00%	20,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$999,46
BB PREV RF ALOC ATIVA RET TOTAL	IPCA	6,39%	20,00% ✓	20,00% ✓	4,70% ✓	R\$207.993.200,64
<b>Art. 7º, Inciso VII, "a" - 5% em FIDC Cota Sênior</b>		<b>0,05%</b>	<b>5,00%</b> ✓	<b>1,00%</b> ✓	<b>5,00%</b> ✓	<b>R\$1.467.062,72</b>
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA -	CDI	0,05%	5,00% ✓	1,00% ✓	3,64% ✓	R\$1.467.062,72
<b>Art. 8º, Inciso I, "a" - 30% FI Ações, ref. cond. aberto</b>		<b>0,49%</b>	<b>30,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$16.099.621,46</b>
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE F	IBOVESPA	0,49%	30,00% ✓	20,00% ✓	8,34% ✓	R\$16.099.621,46
<b>Art. 8º, Inciso I, "b" - 30% FI Ações em índices, ref.</b>		<b>0,50%</b>	<b>30,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$16.402.976,19</b>
BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO I FIC	IBOVESPA	0,50%	30,00% ✓	20,00% ✓	6,26% ✓	R\$16.402.976,19
<b>Art. 8º, Inciso II, "a" - 20% FI Ações</b>		<b>3,64%</b>	<b>20,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$118.546.492,01</b>
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,51%	20,00% ✓	20,00% ✓	4,07% ✓	R\$16.542.596,77
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	0,98%	20,00% ✓	20,00% ✓	1,53% ✓	R\$31.846.895,42
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	0,54%	20,00% ✓	20,00% ✓	1,02% ✓	R\$17.450.325,58
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	0,13%	20,00% ✓	20,00% ✓	1,06% ✓	R\$4.132.827,60
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	0,51%	20,00% ✓	20,00% ✓	1,60% ✓	R\$16.742.893,35
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	0,50%	20,00% ✓	20,00% ✓	1,68% ✓	R\$16.317.233,60
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	0,48%	20,00% ✓	20,00% ✓	3,31% ✓	R\$15.513.719,69
<b>Art. 8º, Inciso III - 10% FI Multimercado, Cond. Aberto</b>		<b>6,56%</b>	<b>10,00%</b> ✓	<b>10,00%</b> ✓	<b>5,00%</b> ✓	<b>R\$213.669.948,30</b>
BB PREVIDENCIÁRIO MULT ALOCAÇÃO	CDI	0,10%	10,00% ✓	10,00% ✓	2,58% ✓	R\$3.330.171,42
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIME	CDI	2,08%	10,00% ✓	10,00% ✓	1,66% ✓	R\$67.684.413,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRAT LIVRE	CDI	0,69%	10,00% ✓	10,00% ✓	8,65% ✗	R\$22.356.631,86
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA	CDI	0,98%	10,00% ✓	10,00% ✓	1,01% ✓	R\$31.978.420,15
CAIXA FI MULTIMERCADO RV 30 L P	%30IBOV_70CDI	2,71%	10,00% ✓	10,00% ✓	4,96% ✓	R\$88.320.311,23
<b>Art. 8º-A, III - FI em Ações BDR Nível 1</b>		<b>3,84%</b>	<b>10,00%</b> ✓	<b>10,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$125.154.318,00</b>
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,42%	10,00% ✓	10,00% ✓	2,40% ✓	R\$46.347.960,75
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS - BDR ETF NÍVEL I	MSCI EUROPE	0,37%	10,00% ✓	10,00% ✓	5,96% ✓	R\$12.043.189,12
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO - BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	0,64%	10,00% ✓	10,00% ✓	3,28% ✓	R\$20.812.063,34
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	1,41%	10,00% ✓	10,00% ✓	1,38% ✓	R\$45.951.104,79
<b>Total:</b>						<b>R\$3.266.426.937,18</b>

73

*Juliano* *N. Erenilso* *[Assinatura]* **6** *[Assinatura]* *[Assinatura]* *R. Jones* *[Assinatura]*



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



74 **1.2.2 – Desenquadramentos:** O Macaeprev possui na Carteira dois fundos que estão  
75 desenquadrados de acordo com o art. 14 da Resolução 3922/2010 para o fundo CAIXA FI  
76 BRASIL 2022 I TP RF e de acordo com o art. 14, § 1º para o fundo FIC FI CAIXA BRASIL  
77 ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP. Os dois desenquadramentos referem-se ao %  
78 do Patrimônio Líquido dos fundos. No entanto, os ativos podem ser mantidos na Carteira  
79 sem quaisquer ônus ao Instituto, conforme as justificativas a seguir: **CAIXA FI BRASIL 2022**  
80 **I TP RF:** tendo em vista a data de carência do fundo, destacada na nomenclatura, ele só  
81 poderá ser resgatado no prazo estabelecido no contrato com a Caixa Econômica Federal; e  
82 **FIC FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP:** na Pergunta 60 da  
83 Nota Técnica nº 12/2017/CGACI/SRPPS/SPREV-MF (vigente) é esclarecido que no caso de  
84 estruturas master-feeder o patrimônio líquido a ser considerado para esse fim é o do fundo  
85 Master. No regulamento do fundo em seu Art. 7º estabelece que o seu objetivo é investir no  
86 FI CAIXA Master Estratégia Livre Multimercado LP – CNPJ: 34.660.200/0001-92, deixando  
87 claramente que se trata de estrutura master-feeder. Considerando que o patrimônio do  
88 Fundo Master é em 30 de setembro de 2021 de R\$ 1.242.647.953,27 não há



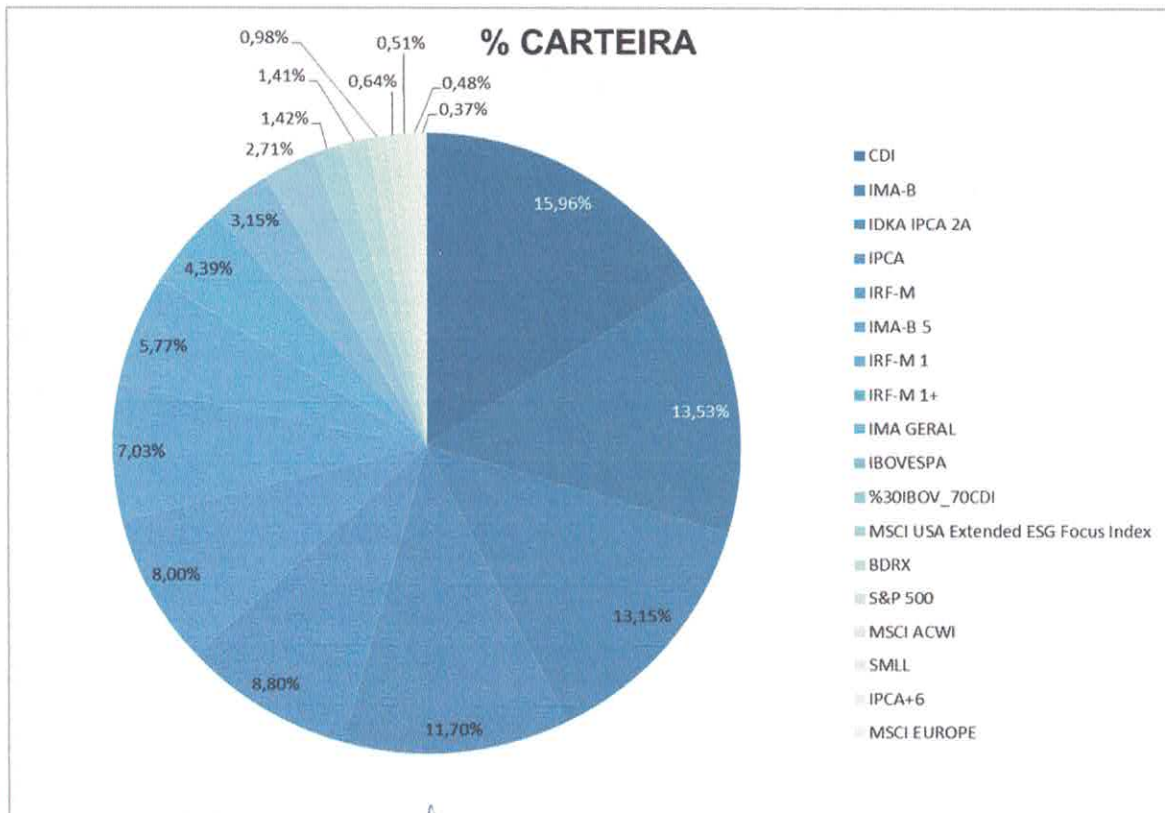
**Estado do Rio de Janeiro**  
**Município de Macaé**  
**Instituto de Previdência Social**  
**Comitê de Investimentos**

89 desequilíbrio em nossa posição. **1.3 - Distribuição da Carteira por Índices de**  
 90 **Referência:**

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 30/09/2021	Participação
CDI	R\$519.725.961,83	15,96%
IMA-B	R\$440.606.672,30	13,53%
IDKA IPCA 2A	R\$428.316.020,11	13,15%
IPCA	R\$380.948.536,85	11,70%
IRF-M	R\$286.471.064,93	8,80%
IMA-B 5	R\$260.586.046,14	8,00%
IRF-M 1	R\$228.866.245,65	7,03%
IRF-M 1+	R\$187.793.748,99	5,77%
IMA GERAL	R\$142.856.941,49	4,39%
IBOVESPA	R\$102.459.300,89	3,15%
%30IBOV_70CDI	R\$88.320.311,23	2,71%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$46.347.960,75	1,42%
BDRX	R\$45.951.104,79	1,41%
S&P 500	R\$31.846.895,42	0,98%
MSCI ACWI	R\$20.812.063,34	0,64%
SMLL	R\$16.742.893,35	0,51%
IPCA+6	R\$15.731.980,00	0,48%
MSCI EUROPE	R\$12.043.189,12	0,37%
<b>Total</b>	<b>R\$3.256.426.937,18</b>	<b>100,00%</b>

91  
92



93  
94

*Handwritten signatures and initials at the bottom of the page, including names like 'N. F. Peniles', 'R. Gomes', and others.*





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

95 1.4 – Distribuição da Carteira por Instituição Financeira:

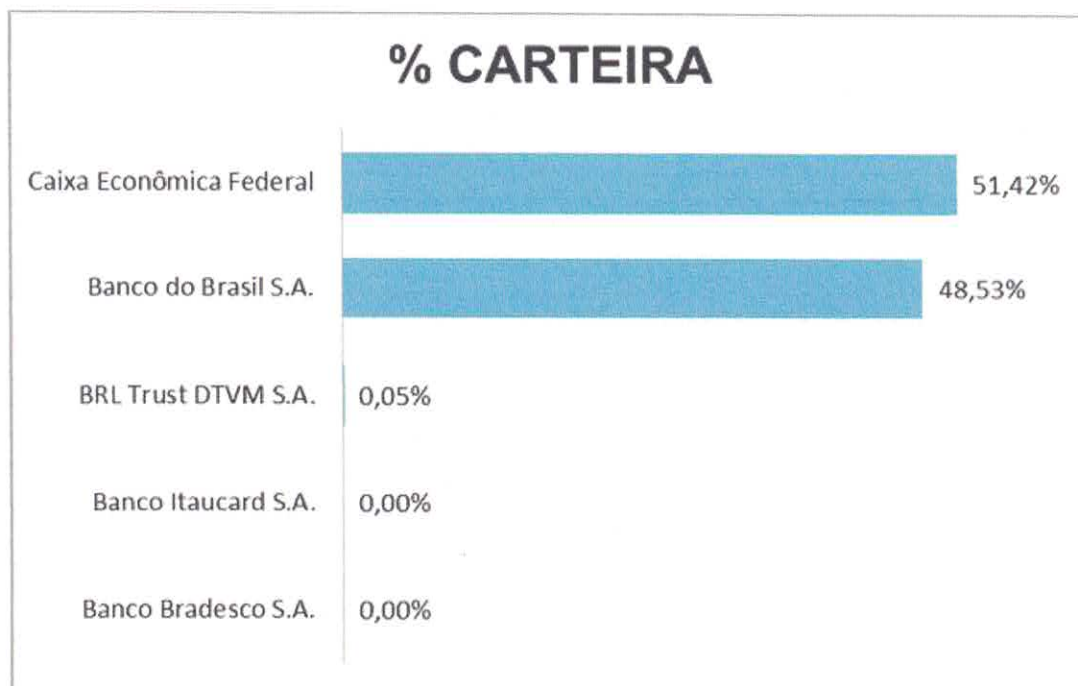
96

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Rentabilidade	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$1.674.597.863,44	0,00%	51,42%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.580.362.011,02	-0,07%	48,53%
BRL Trust DTVM S.A.	R\$1.467.062,72	6,19%	0,05%
Banco Bradesco S.A.	R\$0,00	0,28%	0,00%
Banco Itaucard S.A.	R\$0,00	-2,78%	0,00%

97

98



99

100

101

102

103

104

105

106

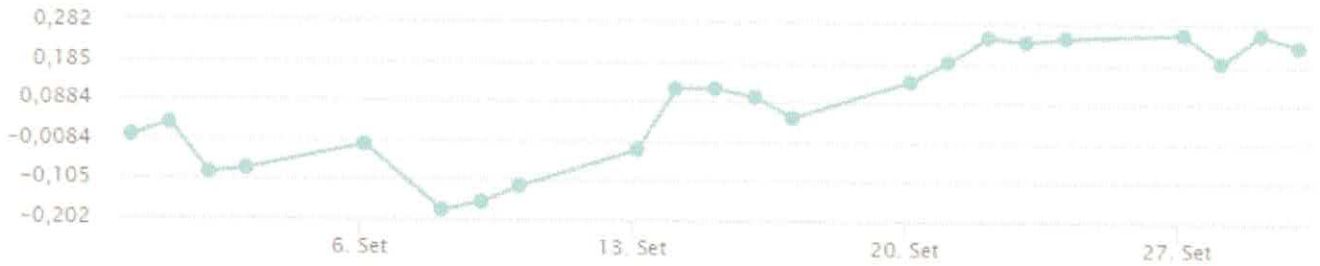
107

**2 – Recursos da Taxa de Administração:** Dando prosseguimento, o membro e gestor dos fundos de investimentos **Erenildo** apresentou o resultado da Carteira acerca dos Recursos da Taxa de Administração. **2.1 – Rentabilidade:** A Carteira da Taxa de Administração teve um resultado de 0,23% no mês de setembro, totalizando um saldo de R\$ 185.204.692,59 (cento e oitenta e cinco milhões e duzentos e quatro mil e seiscentos e noventa e dois reais e cinquenta e nove centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira ao longo do mês.

9



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



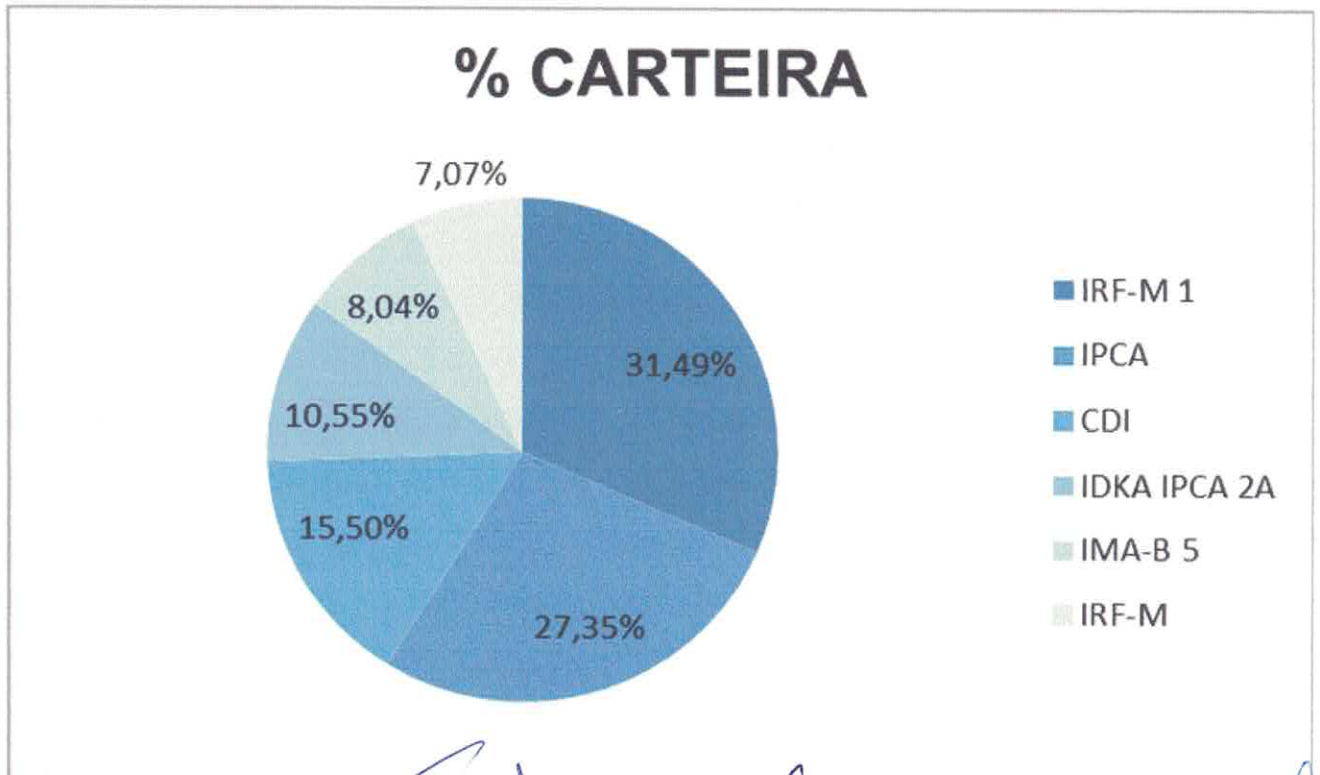
108  
109  
110

**2.2 – Distribuição por Índices de Referência:**

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 30/09/2021	Participação
IRF-M 1	R\$58.314.224,64	31,49%
IPCA	R\$50.661.248,32	27,35%
CDI	R\$28.711.377,96	15,50%
IDKA IPCA 2A	R\$19.539.858,88	10,55%
IMA-B 5	R\$14.886.003,68	8,04%
IRF-M	R\$13.091.979,11	7,07%
	<b>R\$185.204.692,59</b>	<b>100,00%</b>

111  
112



113  
114

*Handwritten signatures and notes at the bottom of the page, including names like 'Sousa', 'Erenildo', 'Rafael', and 'Rafael'.*

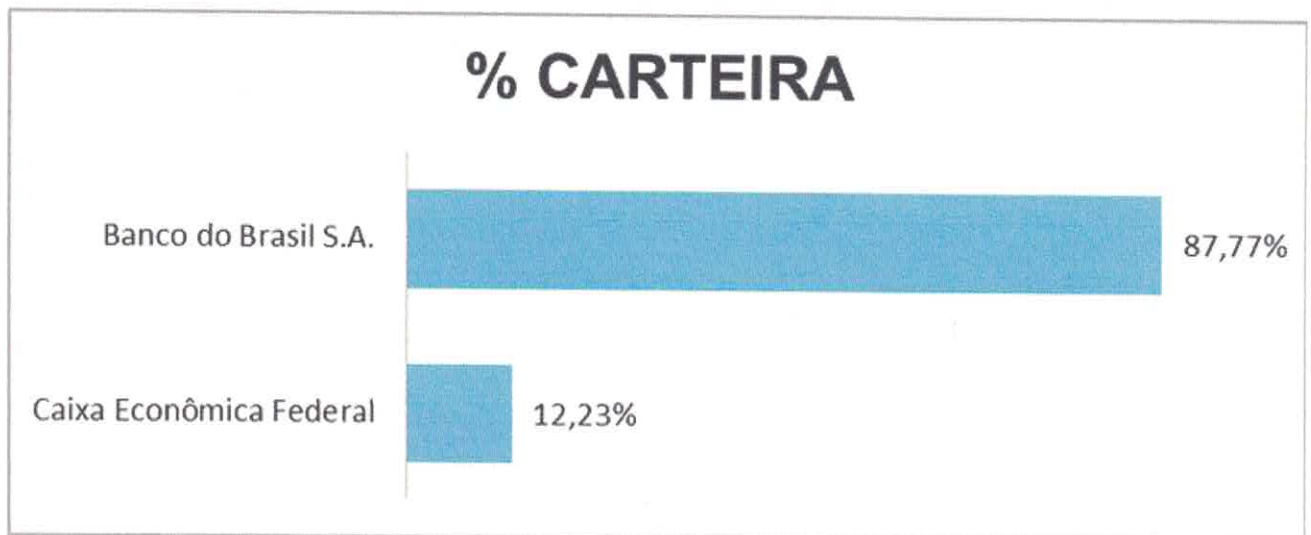


115 2.3 – Distribuição por Instituição Financeira:

### DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$162.553.221,99	87,77%
Caixa Econômica Federal	R\$22.651.470,60	12,23%

116



117

118 **3 – Recursos da Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial:** Em ato contínuo, o gestor  
119 dos fundos de investimentos *Erenildo* apresentou o resultado da Carteira para Cobertura de  
120 Déficit Atuarial. **3.1 – Rentabilidade:** A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial  
121 apresentou um resultado negativo de -0,20% e fechou o mês com o saldo de R\$  
122 22.630.820,66 (vinte e dois milhões e seiscentos e trinta mil e oitocentos e vinte reais e  
123 sessenta e seis centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no  
124 mês de setembro.

125



126

127 **3.2 – Distribuição por Índices de Referência:**

*Sebastião*  
*N. Erenildo*  
*Amorim*  
*Juliano*  
*Rômulo*



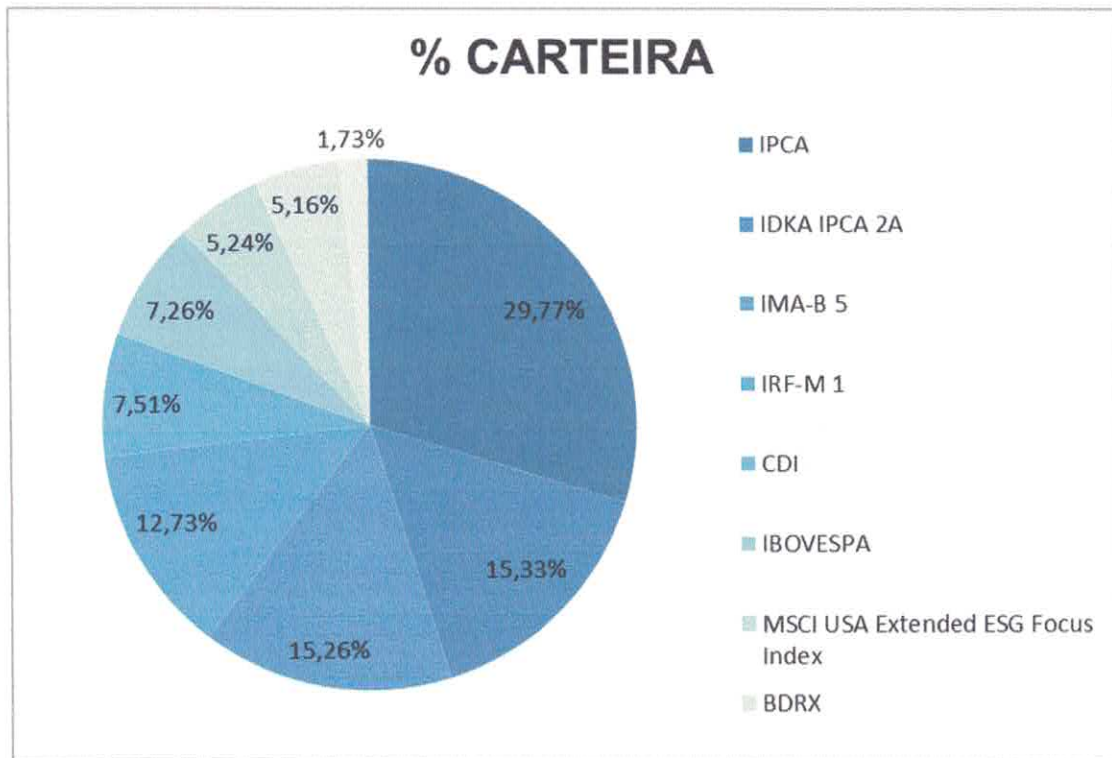
**Estado do Rio de Janeiro**  
**Município de Macaé**  
**Instituto de Previdência Social**  
**Comitê de Investimentos**

128

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 30/09/2021	Participação
IPCA	R\$6.737.312,61	29,77%
IDKA IPCA 2A	R\$3.469.571,61	15,33%
IMA-B 5	R\$3.454.123,55	15,26%
IRF-M 1	R\$2.881.805,07	12,73%
CDI	R\$1.699.226,19	7,51%
IBOVESPA	R\$1.643.786,01	7,26%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.185.758,33	5,24%
BDRX	R\$1.168.814,40	5,16%
SMLL	R\$390.422,89	1,73%
	<b>R\$22.630.820,66</b>	<b>100,00%</b>

129  
130



131  
132  
133

**3.3 – Distribuição por Instituição Financeira:**

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$11.773.212,87	52,02%
Banco do Brasil S.A.	R\$10.857.607,79	47,98%

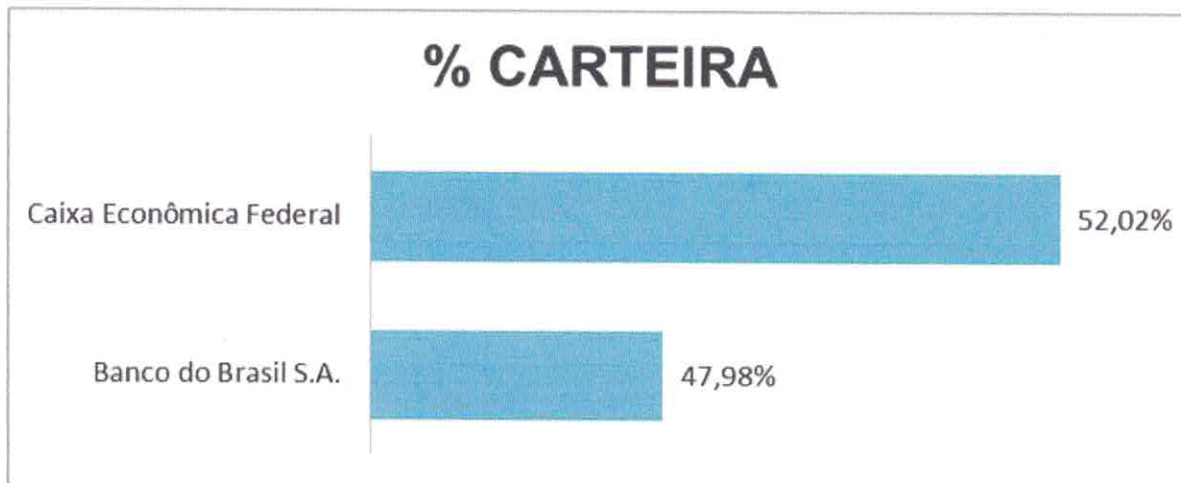
134

*Handwritten signatures and notes at the bottom of the page, including names like 'Frenillo', 'Bomall', 'Romeo', and '12'.*



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

135



136  
137

138 **4 – Patrimônio Consolidado:** Finalizando, o Gestor de Recursos **Erenildo** informou que o  
139 Macaeprev encerrou o mês de setembro de 2021 com o Patrimônio Consolidado de R\$  
140 3.464.262.450,43 (três bilhões e quatrocentos e sessenta e quatro milhões e duzentos e  
141 sessenta e dois mil e quatrocentos e cinquenta reais e quarenta e três centavos). **IV -**  
142 **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada e a ata será  
143 enviada para o e-mail e whatsapp de todos os membros, para leitura, aprovação e posterior  
144 assinatura dos mesmos.

Alfredo Tanos Filho

Claudio de Freitas Duarte

Erenildo Motta da Silva Júnior

Isabella Felix Viana

José Eduardo da Silva Guinâncio

Maria Auxiliadora de Moura Ferreira

Patric Alves de Vasconcellos

Rose Mary Gomes

