



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

1 **ATA Nº 12/2022 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 23/03/2022** – 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 três de março de dois mil e vinte e dois, estando  
6 presentes os membros **Alfredo Tanos Filho, Claudio de Freitas Duarte, Erenildo Motta**  
7 **da Silva Júnior e José Eduardo da Silva Guinâncio**, instituídos através da portaria de  
8 nomeação nº 289/2021, e os membros **Miriam Amaral Queiroz, Maria Auxiliadora de**  
9 **Moura Ferreira, Patric Alves de Vasconcellos e Isabella Felix Viana** instituídos através  
10 da portaria de nomeação nº 306/2022, reunião que ocorreu via plataforma de reunião  
11 *Google Hangouts Meet*, devido à pandemia do Covid 19 e suas variantes, conforme pode  
12 ser comprovado através do *print* da foto em anexo. Aberta a reunião, foram tratados os  
13 seguintes temas: I – **PRÓ-GESTÃO**: Iniciada a reunião, pelo membro **Isabella** foi informado  
14 que na data de ontem o Macaeprev recebeu a placa do Pró-gestão na cerimônia do  
15 Seminário da Aepremerj ocorrido em Itaipava-RJ, estando presentes o presidente do  
16 Macaeprev e membro deste Comitê **Claudio Duarte**, o diretor previdenciário e conselheiro  
17 fiscal **Júlio Viana**, e os membros **Erenildo Motta** e **Patric Vasconcellos**. O membro  
18 **Claudio** falou acerca da importância desta certificação, destacando que devemos começar a  
19 nos preparar na possibilidade de indicar ou não os fundos para investidor qualificado.  
20 Noticiou que o Macaeprev foi bem recepcionado, e a conversa com outros gestores  
21 produtivas. Destacou que os municípios de São João da Barra, Cambuci, Carapebus e  
22 Quissamã agradeceram ao Macaeprev a abertura de fundo de vértice pelo Banco do Brasil.  
23 Acrescentou que o Comitê e o Conselho Previdenciário estão bem certos. Que o RPPS de  
24 Macaé possibilitou a entrada de muitos RPPS e que sofreram ano passado e estão  
25 conseguindo recuperar neste ano. O membro **Erenildo** comentou que, sobre as eleições,  
26 um economista de uma das gestoras disse que na forma de condução da política econômica  
27 os dois (Lula e Bolsonaro) são muito parecidos. Que o que está acontecendo hoje no Brasil,  
28 deve continuar acontecendo. II - **RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS DO MACAEPREV –**  
29 **FEVEREIRO DE 2022**: Iniciada a reunião, o Gestor de Investimentos e membro do Comitê  
30 **Erenildo** apresentou o Relatório de Investimentos do Macaeprev referente ao mês de  
31 **Fevereiro de 2022**, o qual segue na íntegra: “1. **INTRODUÇÃO** – Mantendo elevados níveis  
32 de transparência e para manter boa comunicação junto aos servidores e munícipes, o



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

33 Instituto de Previdência Social do Município de Macaé – Macaeprev apresenta o relatório de  
34 investimentos, referente ao mês de fevereiro de 2022. Neste relatório é possível observar a  
35 consolidação de todas as informações relativas ao período de referência, incluindo o cenário  
36 econômico, os resultados alcançados em relação às metas estabelecidas, o comportamento  
37 dos ativos financeiros que compõe a carteira de investimentos do Macaeprev, inclusive  
38 quanto aos indicadores de desempenho e gerenciamento de riscos. **2. CENÁRIO**  
39 **ECONÔMICO** - Fevereiro de 2022: certamente um mês que não será esquecido e que,  
40 definitivamente, entrará para a história mundial. O crescimento das tensões entre Rússia e  
41 Ucrânia, que culminou no início da invasão russa ao território ucraniano, foi o principal  
42 assunto do mês e trouxe muita volatilidade aos mercados globais, que já vinham fragilizados  
43 por conta da inflação mais persistente e da mudança de postura dos principais bancos  
44 centrais do mundo. O conflito derrubou as principais bolsas de valores mundiais e levou para  
45 máximas históricas os preços do petróleo. Em resposta à invasão, diversas economias  
46 impuseram sanções contra à Rússia, incluindo remoção de vários bancos russos do sistema  
47 de pagamento internacional (Swift), congelamento de ativos russos, restrições comerciais e  
48 fechamento do espaço aéreo. Apesar de algumas tentativas de negociações diplomáticas,  
49 ainda não houve avanço para o término do confronto. O principal índice de inflação dos  
50 Estados Unidos fechou fevereiro em 7,9% no acumulado dos últimos doze meses. É a maior  
51 taxa registrada desde janeiro de 1982, quando o índice foi de 8,4%. Na comparação com o  
52 mês anterior, a alta em fevereiro foi de 0,8%, impulsionada principalmente pelo aumento no  
53 preço da gasolina após o início da guerra na Ucrânia. Além disso, os números da pandemia  
54 nos EUA foram animadores, com uma forte desaceleração de casos e mortes por Covid-19,  
55 viabilizando novas flexibilizações sanitárias em diversos estados. Acerca da atividade, os  
56 dados referentes a janeiro indicaram resiliência da economia americana com “vendas do  
57 varejo” avançando 3,8% (M/M) e “produção industrial” registrando crescimento de 1,4%  
58 (M/M). Já o mercado de trabalho americano novamente surpreendeu positivamente, gerando  
59 467 mil vagas líquidas de empregos não-agrícola em janeiro, ante expectativas de 125 mil  
60 vagas. A inflação da Zona do Euro alcançou recorde em janeiro ao registrar 5,1% em termos  
61 anuais com os preços da energia e dos custos de alimentos pressionando o índice,  
62 enquanto a inflação de serviços e de bens industriais também permaneceu  
63 desconfortavelmente alta. Na Europa, a desaceleração na onda de contágio da variante  
64 Ômicron também impulsionou o relaxamento das medidas restritivas. A invasão russa à



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

65 Ucrânia mantém as principais economias do bloco em estado de alerta, monitorando de  
66 perto as ofensivas militares e os impactos econômicos sobre o quadro inflacionário já  
67 bastante pressionado. A União Europeia também aplicou diversas sanções financeiras e  
68 comerciais à economia russa para pressionar um acordo diplomático o mais breve possível.  
69 Dados de atividade referentes a dezembro apresentaram comportamentos mistos, na  
70 medida em que as vendas do varejo registraram queda de 3,0% (M/M), enquanto a  
71 produção industrial avançou 1,2% (M/M). A economia da zona euro só deve crescer 3,7%  
72 em 2022, tendo em conta os primeiros dados econômicos muito negativos e incertos que  
73 emergiram com a guerra da Rússia contra a Ucrânia. O BCE também subiu e muito a  
74 projeção de inflação para o ano corrente. Em dezembro, as contas da instituição sediada em  
75 Frankfurt apontavam para 3,2% (quase o dobro face aos 1,7% de setembro) já por causa  
76 das fortes pressões que sentiam na alta do nível dos preços da energia e de muitas outras  
77 matérias-primas, sobretudo alimentares. Assim, o BCE subiu a previsão de inflação para  
78 5,1% este ano, sendo que Christine Lagarde, a presidente do banco central europeu, foi  
79 avisando ao longo da conferência de imprensa de que há sinais de que a subida fortíssima  
80 dos preços pode não ser algo temporário. Dessa forma, O BCE já começou a sinalizar o fim  
81 do programa de compra de ativos e que provavelmente até o fim do ano um aumento de  
82 juros também seria necessário para conter a inflação. O índice de preços ao consumidor  
83 (IPC), o principal indicador da inflação na China, aumentou 0,9%, em fevereiro, em relação  
84 ao mesmo período no ano anterior, segundo dados oficiais divulgados pelo Gabinete  
85 Nacional de Estatísticas (GNE) chinês. Em relação ao conflito entre Rússia e Ucrânia, a  
86 China evitou críticas direcionadas ao líder russo, Vladimir Putin, e não aplicou sanções  
87 econômicas conforme anunciadas pelas principais economias ocidentais. Acerca da  
88 atividade, as sondagens do setor de serviços e industrial na China avançaram  
89 moderadamente em fevereiro, atingindo 51,6 e 50,2, respectivamente. Ao contrário dos EUA  
90 e da Europa, a alta no número de casos da Covid-19 na capital chinesa, superando 2 mil/dia  
91 em meados de fevereiro, manteve a política rigorosa de “covid zero” ativa. Aqui no Brasil, o  
92 Comitê de Política Monetária (Copom) elevou no começo de fevereiro a taxa básica de juros  
93 da economia para 10,75% ao ano. Atualmente a taxa se encontra em 11,75%. Apesar de  
94 todos os problemas que têm impactado as perspectivas macroeconômicas de forma geral,  
95 além de todos os impactos sociais e geopolíticos, é importante ressaltar que a Bolsa de  
96 Valores brasileira está se comportando de forma contrária. O fluxo de entrada de capital



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

97 vindo de fora está cada vez maior e, conseqüentemente, o valor do dólar vem diminuindo.  
98 Até o dia 25 de fevereiro, entraram R\$ 62,6 bilhões neste ano, um pouco mais do que a  
99 metade do total que entrou no ano passado inteiro. Ao longo do mês, a Bolsa registrou  
100 vários pregões consecutivos de alta e foi somente nos últimos dias de fevereiro, quando as  
101 notícias de agravamento do conflito entre a Rússia e a Ucrânia aumentaram, é que a Bolsa  
102 brasileira cedeu. O crescimento da atividade de serviços do Brasil ganhou força em fevereiro  
103 em meio à demanda favorável com o recuo da pandemia e o avanço da vacinação contra o  
104 coronavírus, apontou a pesquisa Índice de Gerentes de Compras (PMI, na sigla em inglês).  
105 A IHS Markit informou que seu PMI subiu a 54,7 em fevereiro, de 52,8 em janeiro, mês em  
106 que o ritmo da atividade desacelerou devido à variante Ômicron do coronavírus. Com isso, o  
107 índice permaneceu acima da marca de 50, que separa crescimento de contração pelo nono  
108 mês seguido. Além da queda nos casos de Covid-19 e do avanço da vacinação, várias  
109 empresas citaram ainda a retomada de eventos adiados, a redução das restrições de  
110 viagem e o aumento da adesão dos consumidores, de acordo com a IHS Markit. No geral, as  
111 vendas cresceram com força e o aumento da atividade levou os fornecedores de serviços  
112 brasileiros a aumentar suas equipes em fevereiro. O subíndice de emprego cresceu pelo  
113 nono mês seguido, e registrou o segundo ritmo mais rápido em quase 14 anos. O Índice  
114 Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) registrou alta de 1,01% em fevereiro de  
115 2022, sendo essa a maior variação para um mês de fevereiro desde 2015 (1,22%). O índice  
116 ficou 0,47 ponto percentual acima do registrado em janeiro (0,54%) e, no ano, acumula alta  
117 de 1,56%. Nos últimos 12 meses, o IPCA acumula alta de 10,54%. Os principais impactos  
118 vieram da Educação (5,61%) e da Alimentação e Bebidas (1,28%). “Em fevereiro, são  
119 incorporados no IPCA os reajustes habitualmente praticados no início do ano letivo. Com  
120 isso, esse foi o grupo que teve o maior impacto no mês, contribuindo com 0,31 ponto  
121 percentual. O outro grupo que pesou bastante no mês foi o de Alimentação e bebidas, que  
122 acelerou para 1,28% e contribuiu com 0,27 ponto percentual. Juntos, os dois grupos  
123 representaram cerca de 57% do IPCA de fevereiro”, ressalta o gerente da pesquisa, Pedro  
124 Kislanov. **3. RESULTADO DA CARTEIRA** - Em relação ao desempenho do nosso portfólio,  
125 fevereiro foi um mês em que a Carteira teve um resultado positivo, porém inferior à Meta  
126 Atuarial. A Carteira fechou o mês com uma valorização de 0,59%, enquanto a Meta Atuarial,  
127 representada pelo IPCA + 6%, foi de 1,50%. Logo, a Carteira não conseguiu superar a Meta



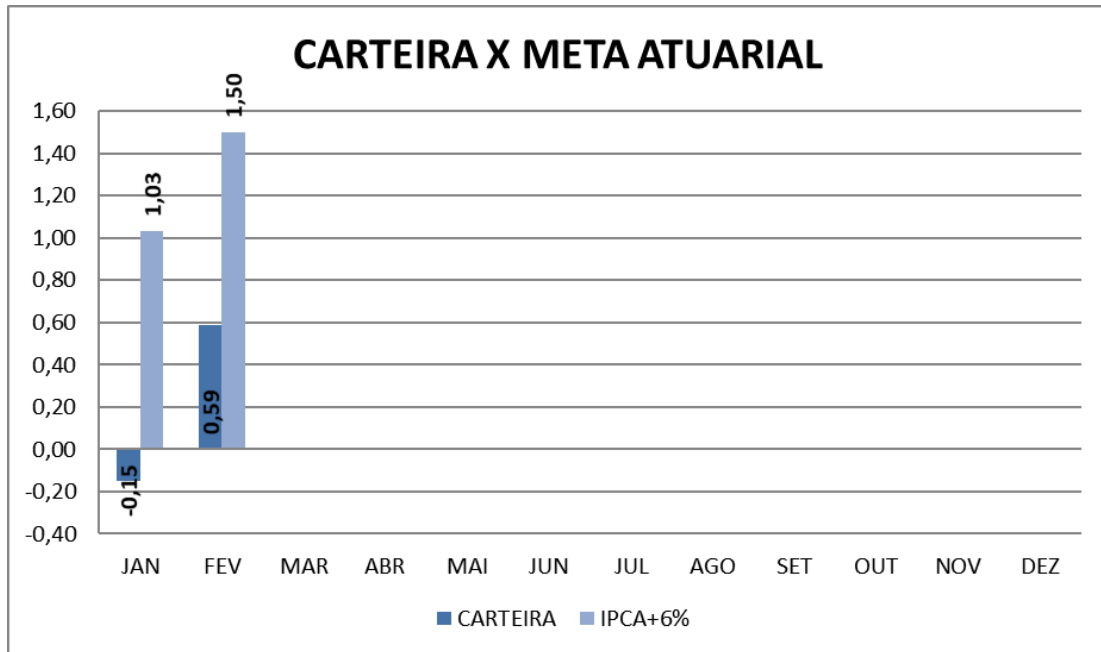
**Estado do Rio de Janeiro**  
**Município de Macaé**  
**Instituto de Previdência Social**  
**Comitê de Investimentos**

128 Atuarial necessária. Nos quadros a seguir pode-se observar o desempenho da Carteira em  
 129 2022.

**HISTÓRICO DE RENTABILIDADE**

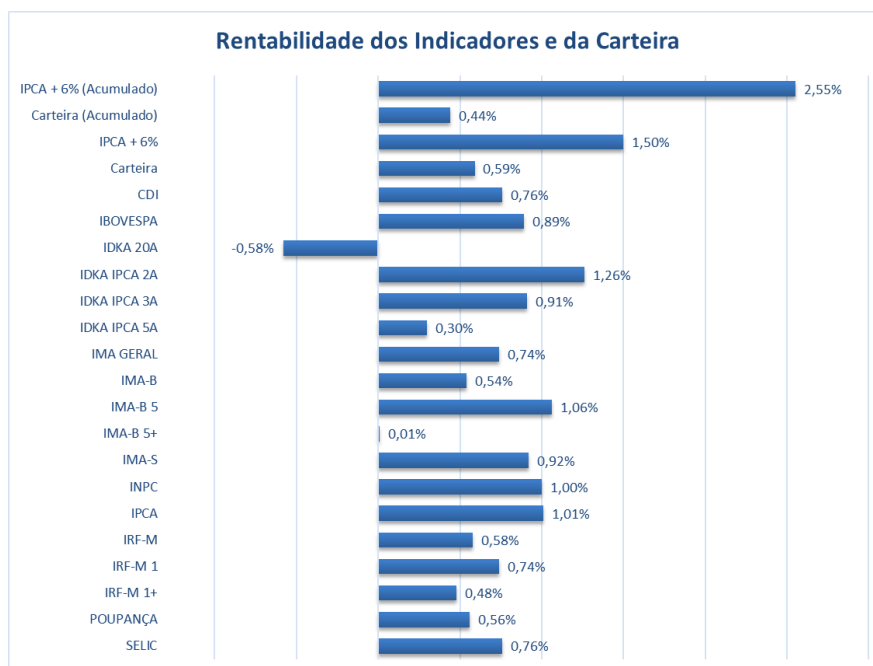
130

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUM
<b>CARTEIRA</b>	-0,15	0,59											<b>0,44</b>
IPCA+6%	1,03	1,50											2,55



131

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

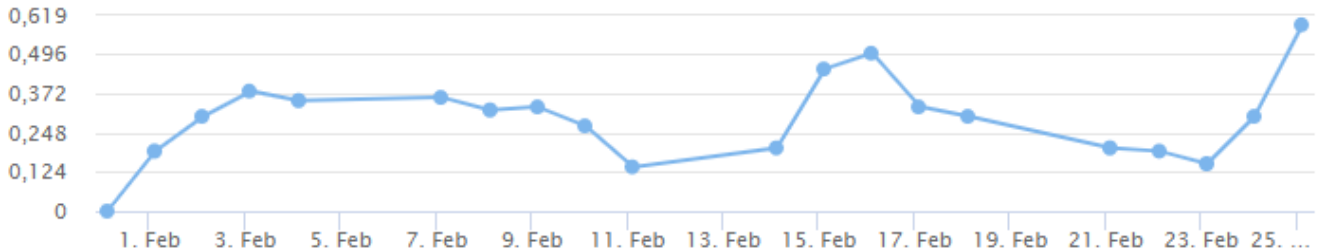


134



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

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

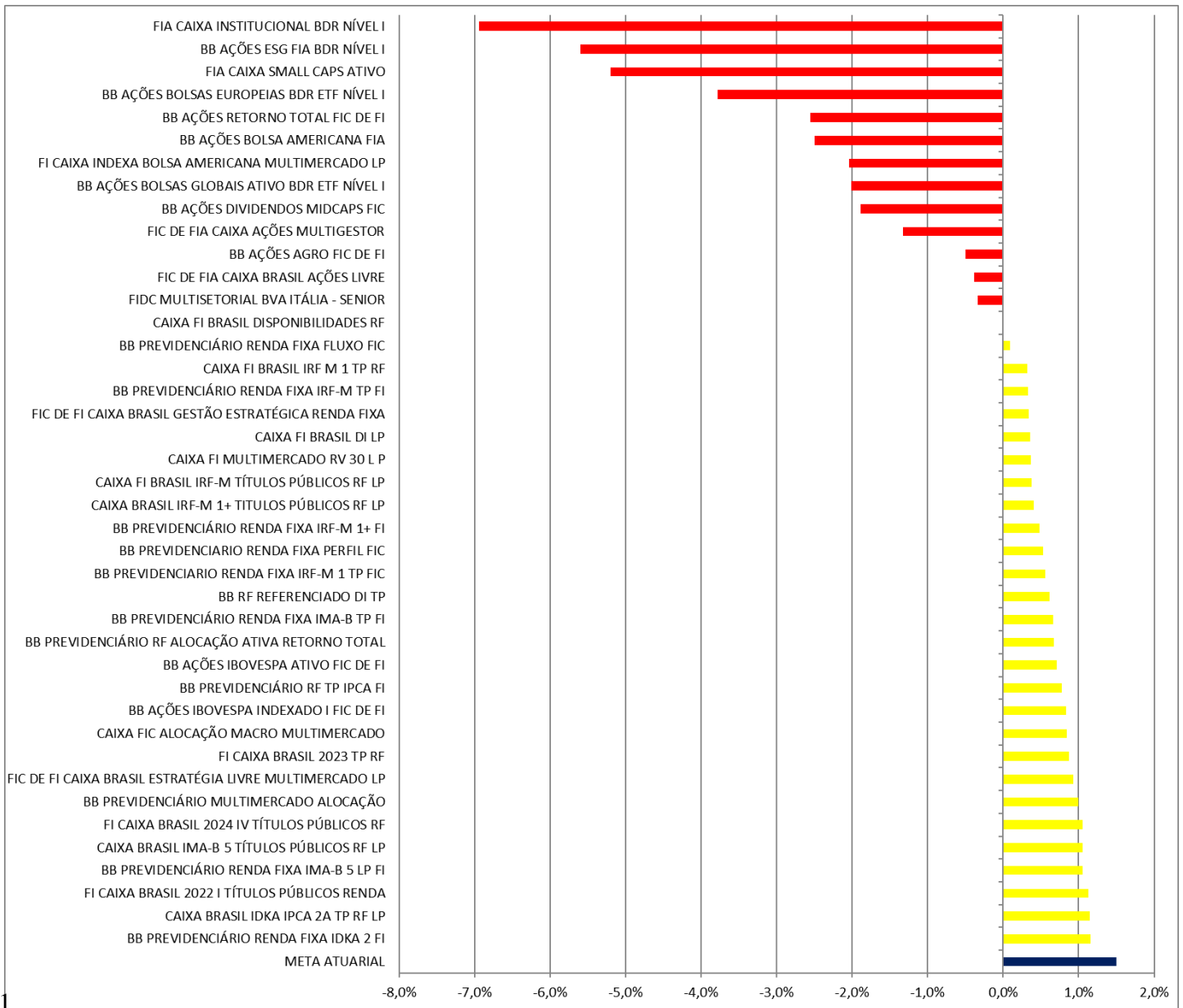


136

137 Os destaques do mês foram os fundos de inflação de curto prazo BB Previdenciário Renda  
138 Fixa IDKA 2 FI e Caixa Brasil IDKA IPCA 2A TP RF LP que renderam, respectivamente,  
139 1,16% e 1,15%. No entanto, nenhum fundo da carteira superou a Meta Atuarial no mês. Os  
140 fundos de ações brasileiras tiveram, em média, um resultado negativo de -1,29%. Os fundos  
141 que acompanham a bolsa americana com proteção cambial caíram -2,27%. Já os fundos  
142 com BDRs na carteira tiveram um retorno de -4,58%. Os fundos multimercado tiveram uma  
143 rentabilidade de 0,79%. Os fundos de renda fixa indexados ao CDI apresentaram uma  
144 rentabilidade média de 0,32%. O fundo de vértice Caixa FI Brasil 2022 I TP RF teve um  
145 retorno de 1,13%, o fundo Caixa FI Brasil 2023 TP RF rendeu 0,87%, o fundo BB  
146 Previdenciário RF TP IPCA FI rendeu 0,78%, enquanto o Caixa FI Brasil 2024 IV TP RF  
147 rendeu 1,05%. Os fundos de renda fixa com gestão ativa apresentaram uma rentabilidade  
148 média de 0,53%. Os fundos IMA-B 5 tiveram um retorno de 1,05%. Enquanto o fundo IMA-B  
149 rendeu 0,66%. Os fundos indexados ao IRF-M 1+ tiveram, em média, uma rentabilidade de  
150 0,45%. Os fundos atrelados ao IRF-M tiveram uma rentabilidade média na casa de 0,36%.  
151 Os fundos IRF-M 1 tiveram um retorno médio de 0,44%. O FIDC Multisetorial Itália teve uma  
152 rentabilidade negativa de -0,34%. Até 28/02/2022 foram resgatados o total de R\$  
153 8.710.810,98 (oito milhões e setecentos e dez mil e oitocentos e dez reais e noventa e oito  
154 centavos), cerca de 87% do total investido. Em fevereiro, o fundo apresentou resultado  
155 negativo de R\$ 4.542,30 (quatro mil e quinhentos e quarenta e dois reais e trinta centavos).  
156 O saldo em 28 de fevereiro estava em R\$ 1.332.458,37 (um milhão e trezentos e trinta e  
157 dois mil e quatrocentos e cinquenta e oito reais e trinta e sete centavos). O gráfico a seguir  
158 mostra a comparação entre a rentabilidade dos fundos e a Meta Atuarial. Os fundos em  
159 amarelo apresentaram resultado positivo, porém, abaixo da Meta Atuarial, enquanto os  
160 fundos na cor vermelha apresentaram resultado negativo.



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



161

162

163 O rendimento de fevereiro da Carteira do Instituto foi positivo em R\$ 19.950.715,90  
 164 (dezenove milhões e novecentos e cinquenta mil e setecentos e quinze reais e noventa  
 165 centavos). O Patrimônio do Fundo Previdenciário fechou o mês de fevereiro em R\$  
 166 3.370.588.461,38 (três bilhões e trezentos e setenta milhões e quinhentos e oitenta e oito mil  
 167 e quatrocentos e sessenta e um reais e trinta e oito centavos).



**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 31/01/2022	Saldo em 28/02/2022	Movimentos do Mês	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)
BB RF REFERENCIADO DI TP	R\$15.357.853,28	R\$0,00	-R\$15.452.472,56	R\$94.619,28	0,62%
CAIXA FI MULTIMERCADO RV 30 L P	R\$90.588.330,66	R\$0,00	-R\$90.921.075,76	R\$332.745,10	0,37%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$115.613.499,55	R\$0,00	-R\$115.984.799,47	R\$371.299,92	0,32%
CAIXA FI BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$119.658.849,54	R\$0,00	-R\$120.108.208,27	R\$449.358,73	0,38%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	R\$122.267.797,18	R\$0,00	-R\$123.071.084,90	R\$803.287,72	0,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$161.057.891,24	R\$0,00	-R\$161.715.539,10	R\$657.647,86	0,41%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	R\$169.231.725,45	R\$0,00	-R\$169.795.463,34	R\$563.737,89	0,33%
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	R\$175.966.659,40	R\$0,00	-R\$176.566.998,51	R\$600.339,11	0,34%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$11,02	R\$5.804,84	-R\$45.827,47	R\$51.621,29	0,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	R\$1.012.366,56	R\$996.443,08	-R\$25.787,47	R\$9.863,99	0,09%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	R\$1.337.000,67	R\$1.332.458,37	R\$0,00	-R\$4.542,30	-0,34%
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO	R\$3.418.539,30	R\$3.452.601,09	R\$0,00	R\$34.061,79	1,00%
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	R\$4.086.864,85	R\$4.009.460,76	R\$0,00	-R\$77.404,09	-1,89%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	R\$15.387.377,28	R\$14.586.782,83	R\$0,00	-R\$800.594,45	-5,20%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	R\$15.467.276,02	R\$15.261.818,86	R\$0,00	-R\$205.457,16	-1,33%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	R\$15.854.986,47	R\$15.450.817,60	R\$0,00	-R\$404.168,87	-2,55%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$15.556.369,98	R\$15.496.972,45	R\$0,00	-R\$59.397,53	-0,38%
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE FI	R\$16.206.378,03	R\$16.322.226,12	R\$0,00	R\$115.848,09	0,71%
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	R\$16.644.960,00	R\$16.372.660,00	R\$0,00	R\$187.471,79	1,13%
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	R\$16.519.960,58	R\$16.437.079,83	R\$0,00	-R\$82.880,75	-0,50%
BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO I FIC DE FI	R\$16.540.461,00	R\$16.678.569,59	R\$0,00	R\$138.108,59	0,83%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS BDR ETF NÍVEL I	R\$16.099.730,39	R\$16.937.880,80	R\$1.504.000,00	-R\$665.849,59	-3,78%
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	R\$22.881.744,99	R\$23.094.406,26	R\$0,00	R\$212.661,27	0,93%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO BDR ETF NÍVEL I	R\$25.269.457,52	R\$26.235.887,58	R\$1.504.000,00	-R\$537.569,94	-2,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$27.329.651,04	R\$27.461.917,97	R\$0,00	R\$132.266,93	0,48%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$36.303.113,64	R\$36.860.348,56	R\$1.504.000,00	-R\$946.765,08	-2,50%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	R\$36.741.903,76	R\$37.467.015,18	R\$1.504.000,00	-R\$778.888,58	-2,04%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$49.759.247,62	R\$47.705.537,26	R\$1.504.000,00	-R\$3.557.710,36	-6,94%
BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	R\$50.069.112,75	R\$48.687.543,92	R\$1.504.000,00	-R\$2.885.568,83	-5,60%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC	R\$113.737.284,60	R\$63.370.299,27	-R\$51.000.000,00	R\$633.014,67	0,56%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	R\$69.126.844,78	R\$69.706.002,59	R\$0,00	R\$579.157,81	0,84%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FI	R\$118.160.337,35	R\$119.406.174,23	R\$0,00	R\$1.245.836,88	1,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$147.745.821,71	R\$149.298.518,77	R\$0,00	R\$1.552.697,06	1,05%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	R\$172.012.498,00	R\$169.478.869,93	R\$0,00	R\$1.804.696,99	1,05%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	R\$211.301.530,39	R\$212.715.070,59	R\$0,00	R\$1.413.540,20	0,67%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 FI	R\$210.539.292,39	R\$212.974.564,58	R\$0,00	R\$2.435.272,19	1,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	R\$225.718.687,28	R\$228.305.988,98	R\$0,00	R\$2.587.301,70	1,15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	R\$0,00	R\$251.955.166,16	R\$250.000.000,00	R\$1.955.166,16	0,78%
CAIXA FI BRASIL DI LP	R\$258.367.041,81	R\$261.967.358,66	R\$1.729.013,38	R\$1.871.303,47	0,36%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	R\$459.952.547,40	R\$467.141.822,06	R\$3.663.083,42	R\$3.526.191,24	0,53%
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	R\$0,00	R\$763.414.392,61	R\$756.815.996,90	R\$6.598.395,71	0,87%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$3.358.891.005,48</b>	<b>R\$3.370.588.461,38</b>	<b>-R\$3.455.163,15</b>	<b>R\$19.950.715,90</b>	<b>0,59%</b>





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

169 **4. DISTRIBUIÇÃO DE RECURSOS DA CARTEIRA**

170 **4.1. ADERÊNCIA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022**

171

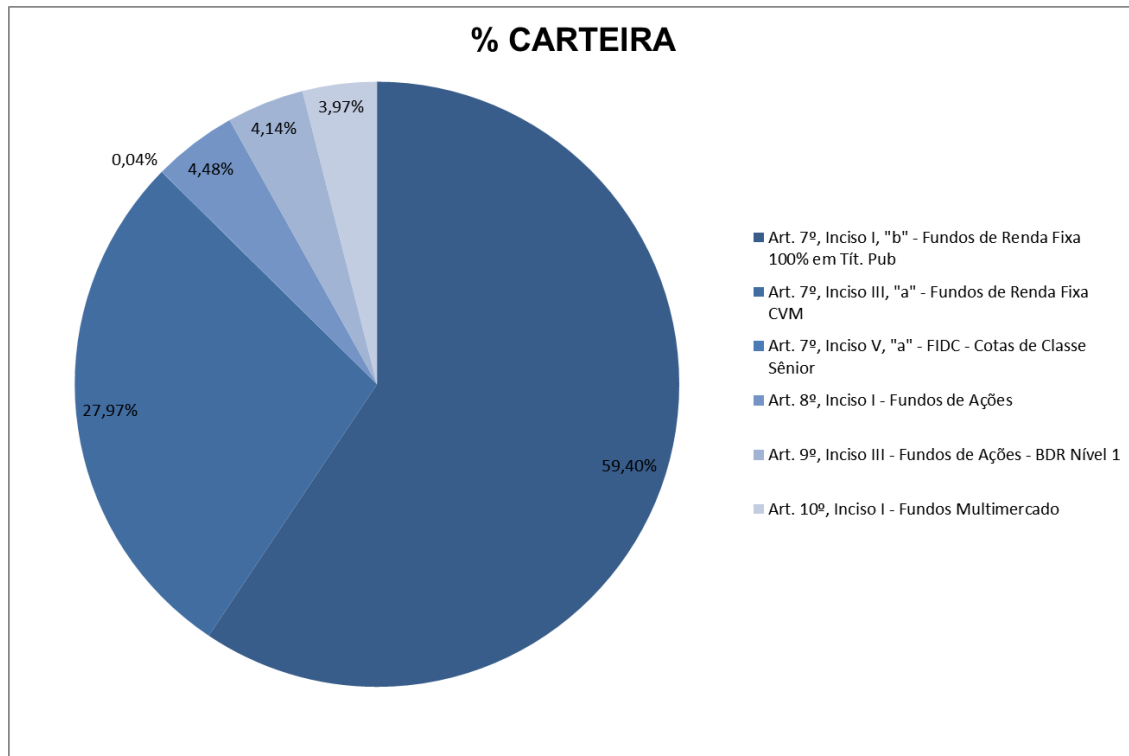
<b>ADERÊNCIA DA CARTEIRA EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 4963/2021 E À PAI 2022</b>							
Artigo/Fundo	Indicador	% Carteira	% Limite Resolução	% Limite PAI 2022	% Limite dos Recursos do RPPS	% Participação no PL do Fundo	Total
<b>Art. 7º, Inciso I, "b" - Fundos de Renda Fixa 100% em Tit. Pub</b>		<b>59,40%</b>	<b>100,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>100,00%</b> ✓	<b>R\$2.002.038.552,50</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP	IRF-M 1	1,88%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	1,26% ✓	R\$63.370.299,27
BB PREVID RF IDKA 2 FI	IDKA 2A	6,32%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	2,36% ✓	R\$212.974.564,58
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF	IDKA 2A	6,77%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	2,14% ✓	R\$228.305.988,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP	IMA-B 5	3,54%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	1,87% ✓	R\$119.406.174,23
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	IMA-B 5	4,43%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	1,29% ✓	R\$149.298.518,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	IPCA+6%	7,48%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	15,38% ✓	R\$251.955.166,16
FI CAIXA BRASIL 2022 I TP RF	IPCA+6%	0,49%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	17,22% ✓	R\$16.372.660,00
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	IPCA+5%	22,65%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	35,43% ✓	R\$763.414.392,61
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	IMA-B	5,03%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	10,11% ✓	R\$169.478.869,93
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+	IRF-M 1+	0,81%	100,00% ✓	100,00% ✓	100,00% ✓	16,07% ✓	R\$27.461.917,97
<b>Art. 7º, Inciso III, "a" - Fundos de Renda Fixa CVM</b>		<b>27,97%</b>	<b>65,00%</b> ✓	<b>65,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$942.826.499,23</b>
BB PREVID RF PERFIL FI EM COTAS	CDI	13,86%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	6,12% ✓	R\$467.141.822,06
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO	CDI	0,03%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,03% ✓	R\$996.443,08
CAIXA FI BRASIL DI LP	CDI	7,77%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	2,46% ✓	R\$261.967.358,66
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES	CDI	0,00%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	0,00% ✓	R\$5.804,84
BB PREV RF ALOC ATIVA RET TOTAL	IPCA	6,31%	65,00% ✓	65,00% ✓	20,00% ✓	5,11% ✓	R\$212.715.070,59
<b>Art. 7º, Inciso V, "a" - FIDC - Cotas de Classe Sênior</b>		<b>0,04%</b>	<b>5,00%</b> ✓	<b>0,50%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>5,00%</b> ✓	<b>R\$1.332.458,37</b>
FIDC MULTISECTORIAL BVA ITÁLIA -	CDI	0,04%	5,00% ✓	0,50% ✓	20,00% ✓	3,64% ✓	R\$1.332.458,37
<b>Art. 8º, Inciso I - Fundos de Ações</b>		<b>4,48%</b>	<b>35,00%</b> ✓	<b>35,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$151.104.076,60</b>
BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC DE F	IBOVESPA	0,48%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	8,90% ✓	R\$16.322.226,12
BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO I FIC	IBOVESPA	0,49%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	6,56% ✓	R\$16.678.569,59
BB AÇÕES AGRO FIC DE FI	IBOVESPA	0,49%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	4,27% ✓	R\$16.437.079,83
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	S&P 500	1,09%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	1,63% ✓	R\$36.860.348,56
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	IBOVESPA	0,46%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	1,20% ✓	R\$15.450.817,60
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC	IBOVESPA	0,12%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	1,16% ✓	R\$4.009.460,76
CAIXA FIA SMALL CAPS ATIVO	SMLL	0,43%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	1,71% ✓	R\$14.586.782,83
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	IBOVESPA	0,45%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	1,83% ✓	R\$15.261.818,86
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	IBOVESPA	0,46%	35,00% ✓	35,00% ✓	20,00% ✓	2,98% ✓	R\$15.496.972,45
<b>Art. 9º, Inciso III - Fundos de Ações - BDR Nível 1</b>		<b>4,14%</b>	<b>10,00%</b> ✓	<b>10,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$139.566.849,56</b>
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	MSCI USA Extended ESG Focus Index	1,44%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	2,70% ✓	R\$48.687.543,92
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS - BDR ETF NÍVEL I	MSCI EUROPE	0,50%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	8,33% ✓	R\$16.937.880,80
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO - BDR ETF NÍVEL I	MSCI ACWI	0,78%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	3,71% ✓	R\$26.235.887,58
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR	BDRX	1,42%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	1,60% ✓	R\$47.705.537,26
<b>Art. 10º, Inciso I - Fundos Multimercado</b>		<b>3,97%</b>	<b>10,00%</b> ✓	<b>10,00%</b> ✓	<b>20,00%</b> ✓	<b>15,00%</b> ✓	<b>R\$133.720.025,12</b>
BB PREVIDENCIÁRIO MULT ALOCAÇÃO	CDI	0,10%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	2,94% ✓	R\$3.452.601,09
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIME	CDI	2,07%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	2,31% ✓	R\$69.706.002,59
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRAT LIVRE	CDI	0,69%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	8,57% ✓	R\$23.094.406,26
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA	CDI	1,11%	10,00% ✓	10,00% ✓	20,00% ✓	1,20% ✓	R\$37.467.015,18
<b>Total:</b>							<b>R\$3.370.588.461,38</b>

172

173



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



174

175

176

**4.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

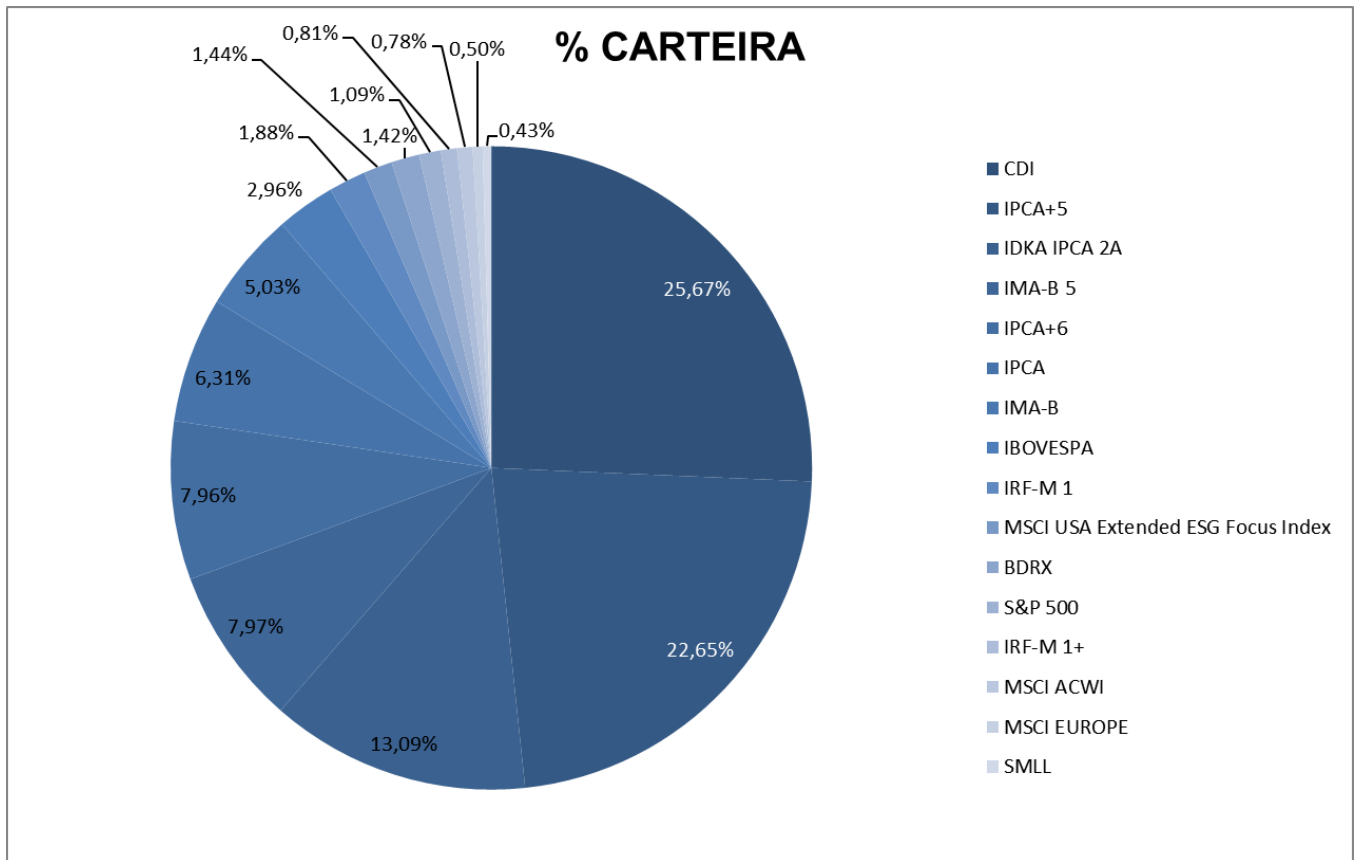
**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 28/02/2022	Participação
CDI	R\$865.163.912,13	25,67%
IPCA+5	R\$763.414.392,61	22,65%
IDKA IPCA 2A	R\$441.280.553,56	13,09%
IMA-B 5	R\$268.704.693,00	7,97%
IPCA+6	R\$268.327.826,16	7,96%
IPCA	R\$212.715.070,59	6,31%
IMA-B	R\$169.478.869,93	5,03%
IBOVESPA	R\$99.656.945,21	2,96%
IRF-M 1	R\$63.370.299,27	1,88%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$48.687.543,92	1,44%
BDRX	R\$47.705.537,26	1,42%
S&P 500	R\$36.860.348,56	1,09%
IRF-M 1+	R\$27.461.917,97	0,81%
MSCI ACWI	R\$26.235.887,58	0,78%
MSCI EUROPE	R\$16.937.880,80	0,50%
SMLL	R\$14.586.782,83	0,43%
<b>Total</b>	<b>R\$3.370.588.461,38</b>	<b>100,00%</b>

177



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



178

179

180

**181 4.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

182

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

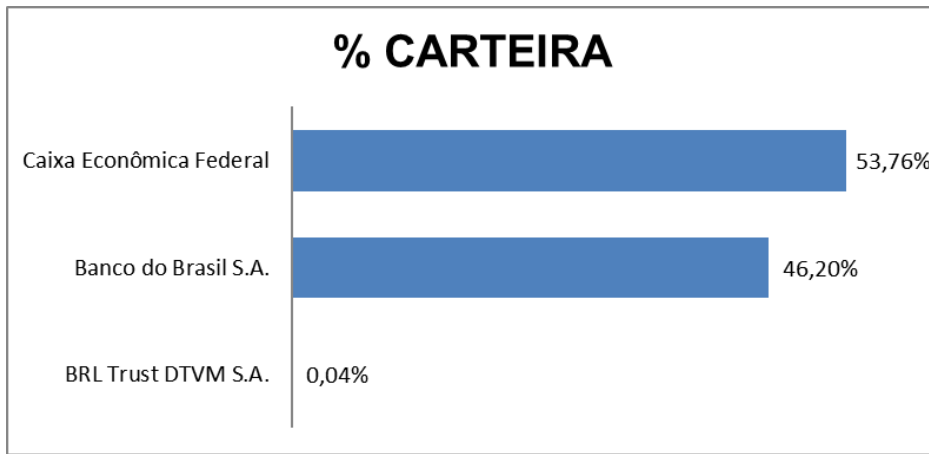
Instituição Financeira	Saldo	Rentabilidade	Participação
BRL Trust DTVM S.A.	R\$1.332.458,37	-0,34%	0,04%
Banco do Brasil S.A.	R\$1.557.093.873,79	0,45%	46,20%
Caixa Econômica Federal	R\$1.812.162.129,22	0,70%	53,76%

183

184



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



185

186

187

**5. ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES**

**MOVIMENTAÇÕES**

APLICAÇÕES			RESGATES		
Data	Valor	Ativo	Data	Valor	Ativo
01/02/2022	R\$329,63	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	02/02/2022	R\$4.126,53	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
03/02/2022	R\$3.327,36	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	03/02/2022	R\$188.728,24	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
07/02/2022	R\$1.764,08	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	04/02/2022	R\$608.284,55	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
08/02/2022	R\$464.561.059,15	FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	07/02/2022	R\$3.327,36	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
08/02/2022	R\$233.011.440,08	FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	08/02/2022	R\$259.007.449,96	CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO
08/02/2022	R\$59.243.497,67	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	08/02/2022	R\$161.715.539,13	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP
08/02/2022	R\$697.572.499,23	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	08/02/2022	R\$120.108.208,27	CAIXA FI BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP
08/02/2022	R\$700.000,00	BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC FIA BDR ETF NÍVEL I	08/02/2022	R\$115.984.799,47	CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF
08/02/2022	R\$700.000,00	BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC FIA BDR ETF NÍVEL I	08/02/2022	R\$100.000.000,00	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA
08/02/2022	R\$495.133,89	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	08/02/2022	R\$697.572.485,94	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
09/02/2022	R\$59.243.497,67	FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	08/02/2022	R\$13,29	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
09/02/2022	R\$700.000,00	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	09/02/2022	R\$90.921.075,73	CAIXA FI MULTIMERCADO RV 30 L P
09/02/2022	R\$700.000,00	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO	09/02/2022	R\$58.725.204,53	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
09/02/2022	R\$700.000,00	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	09/02/2022	R\$169.795.463,34	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI
09/02/2022	R\$4.330.827,09	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	10/02/2022	R\$1.218.293,14	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
10/02/2022	R\$164.765.502,07	CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	11/02/2022	R\$19.924,27	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
10/02/2022	R\$700.000,00	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14/02/2022	R\$76.566.998,51	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA
10/02/2022	R\$700.000,00	BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I	14/02/2022	R\$199.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
10/02/2022	R\$11.793,04	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	14/02/2022	R\$5.025.969,93	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
11/02/2022	R\$90.941.000,00	CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	14/02/2022	R\$51.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP FIC
11/02/2022	R\$49.020,69	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	15/02/2022	R\$76.566.998,52	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
14/02/2022	R\$7.684.074,26	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	16/02/2022	R\$123.071.084,90	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI
14/02/2022	R\$68.882.924,26	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	17/02/2022	R\$3.743.144,65	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
14/02/2022	R\$250.000.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	21/02/2022	R\$804.000,00	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
15/02/2022	R\$5.029.961,27	CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	21/02/2022	R\$4.020.000,00	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF
15/02/2022	R\$76.566.998,52	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC	21/02/2022	R\$15.452.472,56	BB RF REFERENCIADO DI TP
15/02/2022	R\$33.960,91	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	22/02/2022	R\$469.852,47	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC
16/02/2022	R\$4.798.096,80	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	23/02/2022	R\$6.335.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC
16/02/2022	R\$119.296.098,71	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC			
16/02/2022	R\$3.774.986,19	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
17/02/2022	R\$3.774.986,19	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC			
18/02/2022	R\$287.385,77	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
21/02/2022	R\$804.000,00	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO			
21/02/2022	R\$804.000,00	BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC FIA BDR ETF NÍVEL I			
21/02/2022	R\$804.000,00	BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS FIC FIA BDR ETF NÍVEL I			
21/02/2022	R\$472.390,38	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
22/02/2022	R\$804.000,00	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA			
22/02/2022	R\$804.000,00	BB AÇÕES ESG FIA BDR NÍVEL I			
22/02/2022	R\$804.000,00	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I			
23/02/2022	R\$479,03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
24/02/2022	R\$9.360.000,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC			
24/02/2022	R\$544.621,14	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
25/02/2022	R\$11.627,06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC			
			<b>TOTAL DAS MOVIMENTAÇÕES</b>		
			Aplicações	R\$2.334.473.282,14	
			Resgates	-R\$2.337.928.445,29	
			Saldo	-R\$3.455.163,15	

188

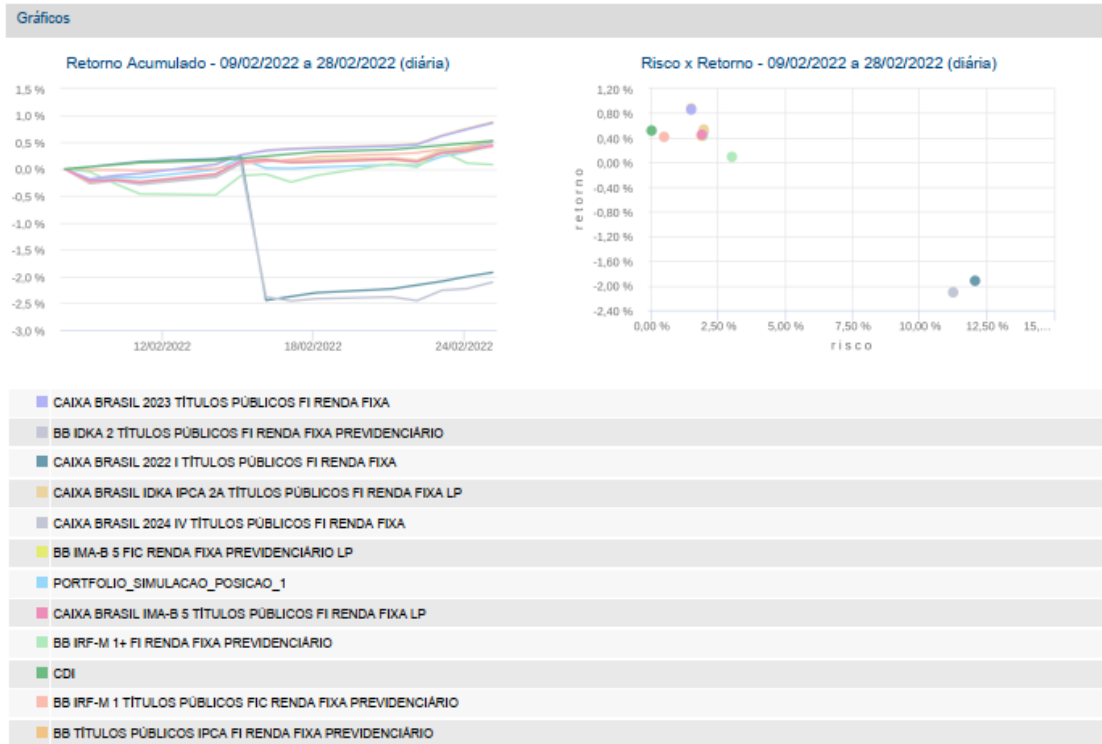


**Estado do Rio de Janeiro**  
**Município de Macaé**  
**Instituto de Previdência Social**  
**Comitê de Investimentos**

189  
 190  
 191  
 192

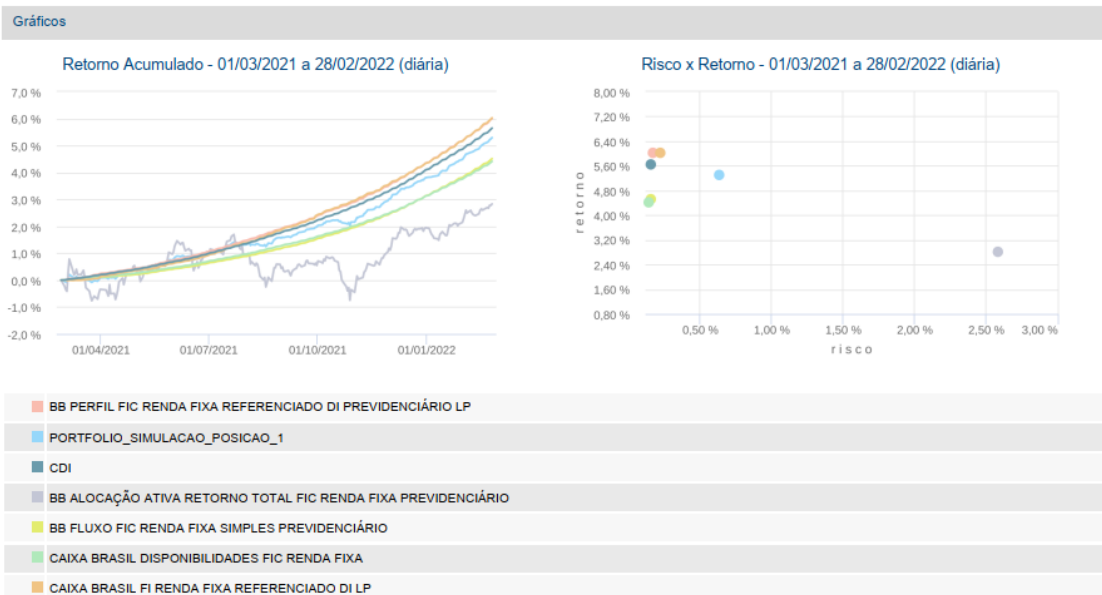
**6. MONITORAMENTO DE RISCOS**

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



193  
 194  
 195  
 196

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



197

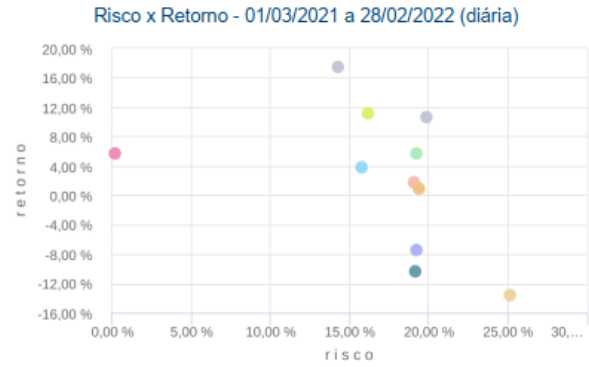
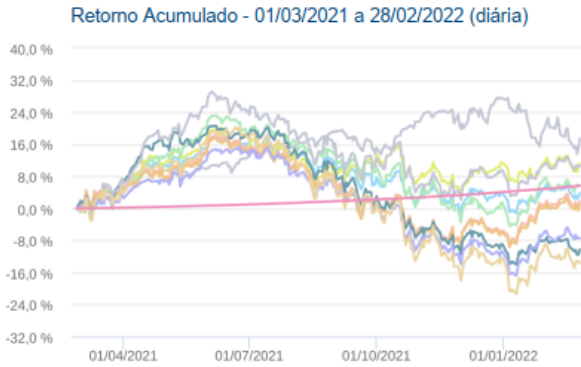


**Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Comitê de Investimentos**

198

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

Gráficos

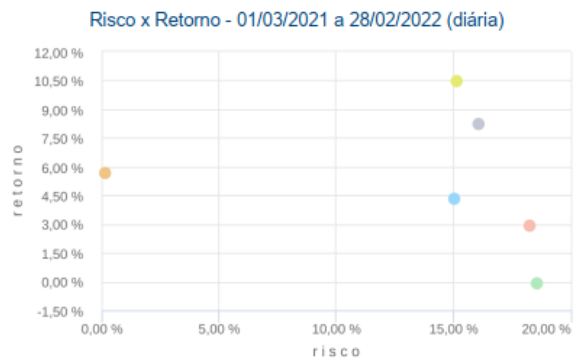
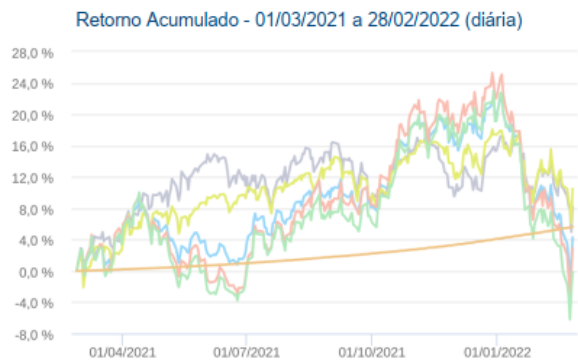


CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES
PORTFOLIO_SIMULACAO_POSICAO_1
CDI
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES
BB AGRO FIC AÇÕES
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES
BB BOLSA BRASILEIRA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

199  
200  
201  
202

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

Gráficos



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

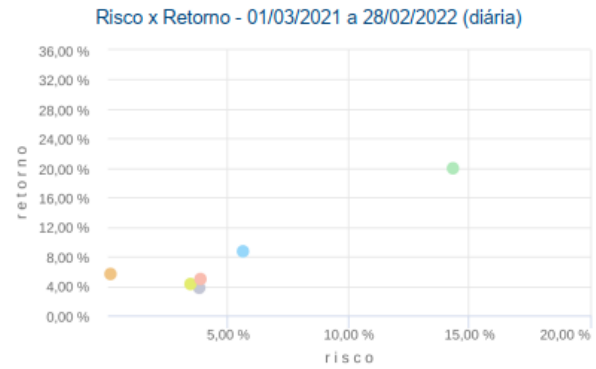
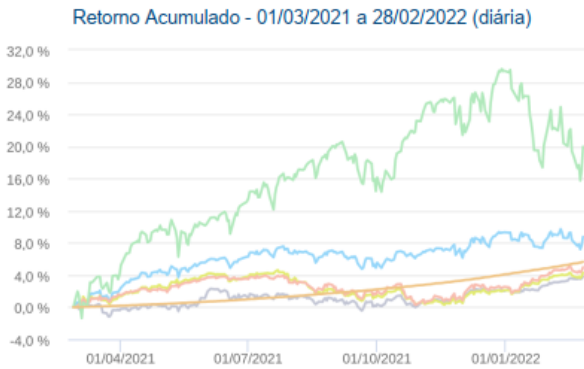
203



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

204 **6.5. ART. 10º, INCISO I – FUNDOS MULTIMERCADO**

Gráficos



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

205

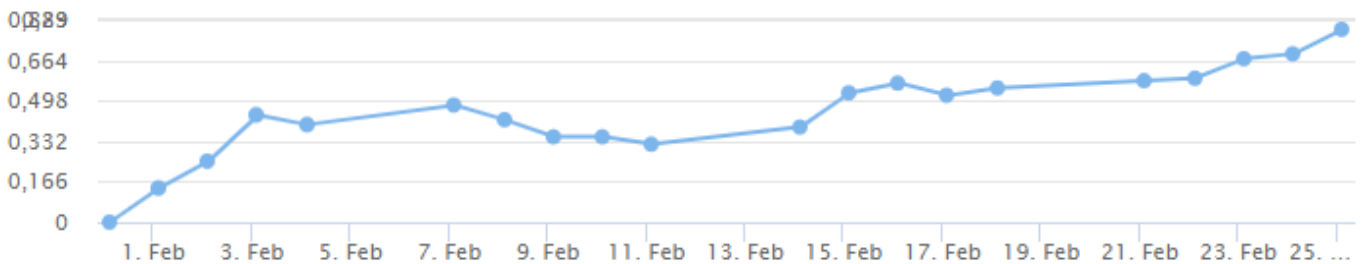
206

207 **7. RECURSOS DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO**

208

209 **7.1. RENTABILIDADE** – A carteira da taxa de administração teve um resultado de 0,79% no  
 210 mês de fevereiro, totalizando um saldo de R\$ 188.398.937,81 (cento e oitenta e oito milhões  
 211 e trezentos e noventa e oito mil e novecentos e trinta e sete reais e oitenta e um centavos).  
 212 A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira ao longo do mês.

213



214

215

216 **7.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**



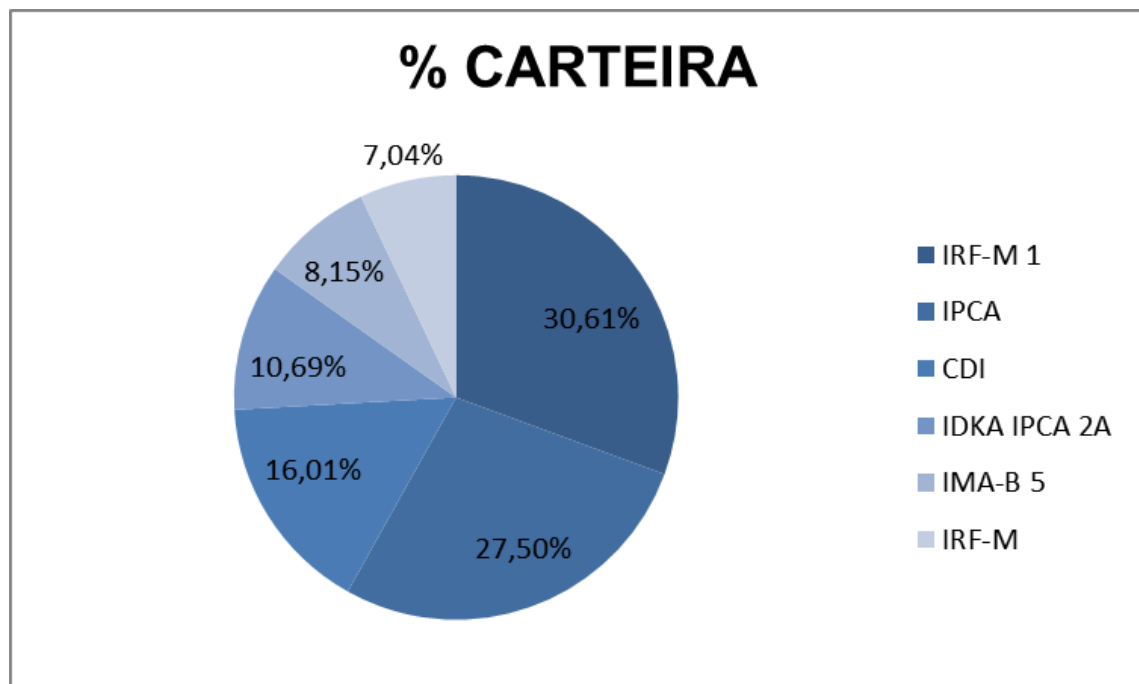
**Estado do Rio de Janeiro**  
**Município de Macaé**  
**Instituto de Previdência Social**  
**Comitê de Investimentos**

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 28/02/2022	Participação
IRF-M 1	R\$57.664.572,35	30,61%
IPCA	R\$51.811.362,00	27,50%
CDI	R\$30.168.738,94	16,01%
IDKA IPCA 2A	R\$20.135.513,90	10,69%
IMA-B 5	R\$15.346.272,27	8,15%
IRF-M	R\$13.272.478,35	7,04%
	<b>R\$188.398.937,81</b>	<b>100,00%</b>

217

218



219

220

221

222

**7.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Caixa Econômica Federal	R\$23.327.100,66	12,38%
Banco do Brasil S.A.	R\$165.071.837,15	87,62%

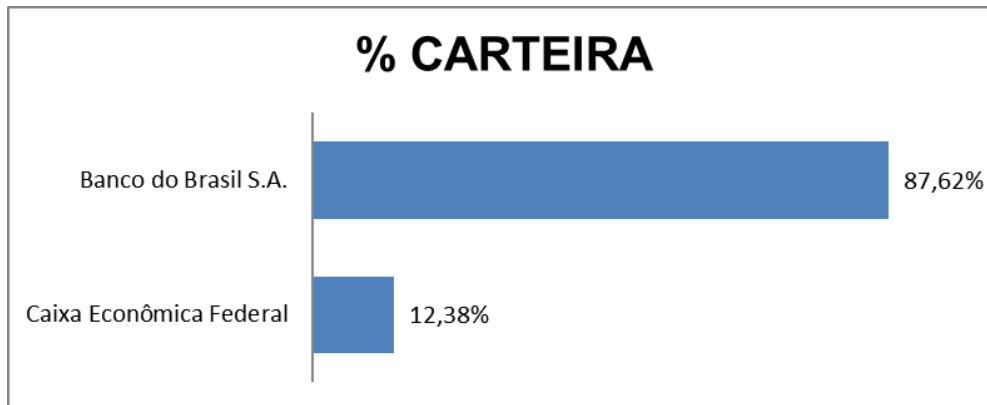
223

224





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

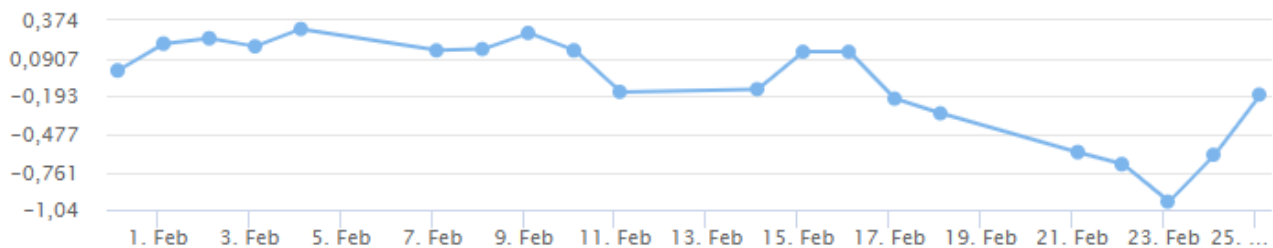


225

226 **8. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2021**

227 **8.1. RENTABILIDADE** - A carteira para cobertura de déficit atuarial (anualidade 2021)  
 228 apresentou um resultado negativo de -0,18% e fechou o mês com o saldo de R\$  
 229 22.889.131,92 (vinte e dois milhões e oitocentos e oitenta e nove mil e cento e trinta e um  
 230 reais e noventa e dois centavos). A imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira  
 231 no mês de fevereiro.

232



233

234

235 **8.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

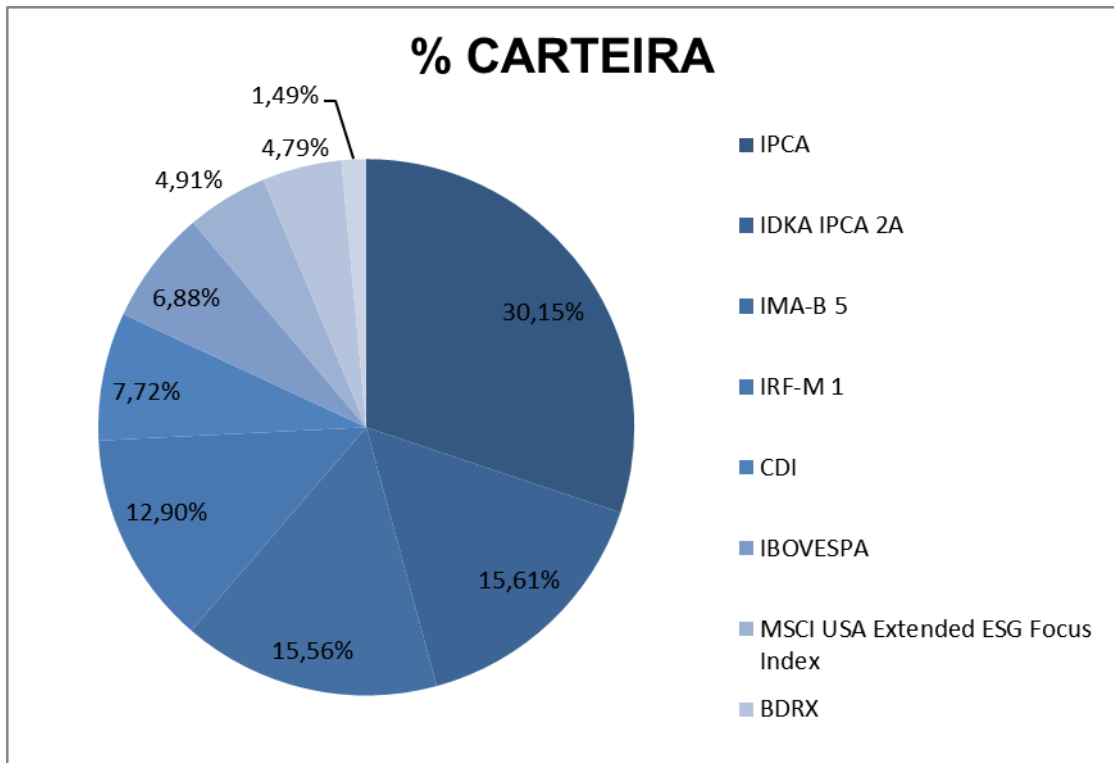
**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 28/02/2022	Participação
IPCA	R\$6.899.953,78	30,15%
IDKA IPCA 2A	R\$3.573.893,59	15,61%
IMA-B 5	R\$3.560.923,51	15,56%
IRF-M 1	R\$2.952.561,24	12,90%
CDI	R\$1.766.223,76	7,72%
IBOVESPA	R\$1.575.221,61	6,88%
MSCI USA Extended ESG Focus Index	R\$1.124.654,14	4,91%
BDRX	R\$1.095.555,15	4,79%
SMLL	R\$340.145,14	1,49%
	<b>R\$22.889.131,92</b>	<b>100,00%</b>

236



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



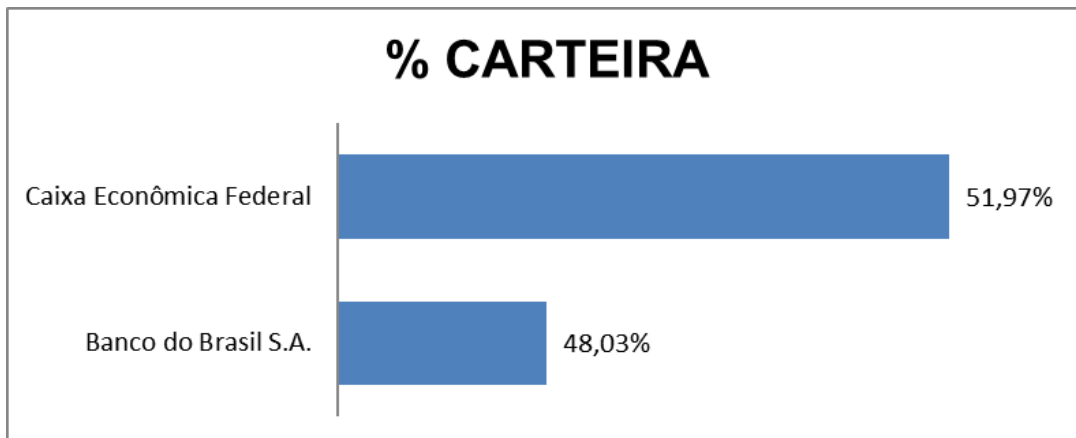
237  
238  
239  
240

**8.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$10.994.555,47	48,03%
Caixa Econômica Federal	R\$11.894.576,45	51,97%

241  
242



243



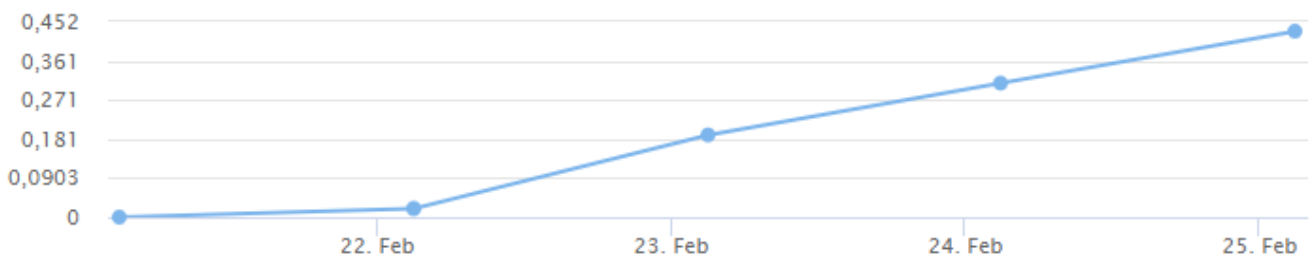
Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Comitê de Investimentos

244 **9. RECURSOS PARA COBERTURA DE DÉFICIT ATUARIAL 2022**

245

246 **9.1. RENTABILIDADE** - A Carteira para Cobertura de Déficit Atuarial (anualidade 2022)  
247 apresentou um resultado 0,43% e fechou o mês com o saldo de R\$ 15.518.902,14 (quinze  
248 milhões e quinhentos e dezoito mil e novecentos e dois reais e quatorze centavos). A  
249 imagem a seguir apresenta o comportamento da carteira no mês de fevereiro.

250



251

252

253

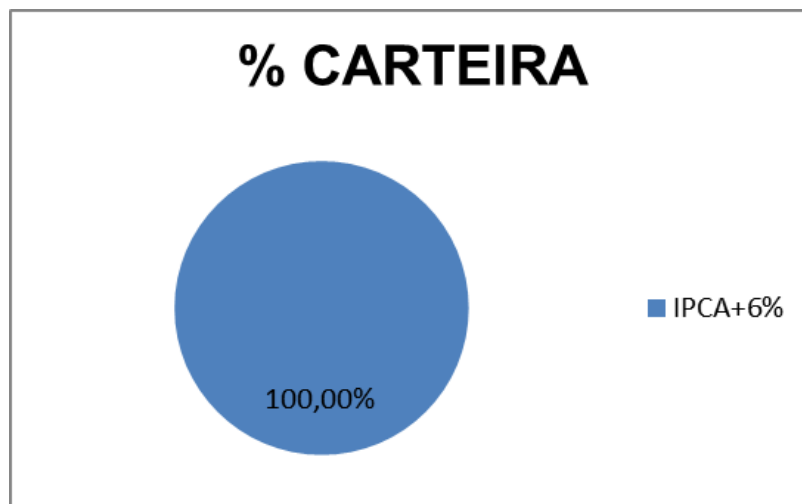
254 **9.2. DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

Indicador	Saldo em 28/02/2022	Participação
IPCA+6%	R\$15.518.902,14	100,00%
	<b>R\$15.518.902,14</b>	<b>100,00%</b>

255

256



257



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

258

259

**9.3. DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

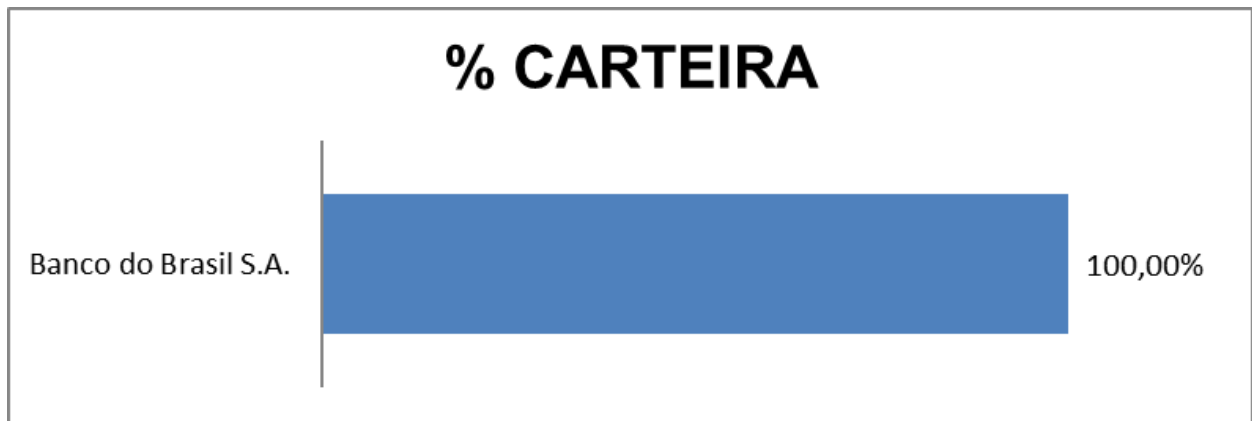
260

**DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

Instituição Financeira	Saldo	Participação
Banco do Brasil S.A.	R\$15.518.902,14	100,00%

261

262



263

264

**10. CUSTOS DECORRENTES DAS APLICAÇÕES**

266

**10.1. TAXAS DE ADMINISTRAÇÃO E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS**

269



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

<b>CUSTOS DOS FUNDOS</b>		
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 IBOVESPA INDEXADO I FIC DE FI	1,00%	0,00%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC DE FI	2,00%	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 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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	0,50%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA FI	0,15%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DI LP	0,20%	0,00%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,80%	0,00%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,20%	0,00%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	2,00%	0,00%
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	0,20%	0,00%
FI CAIXA BRASIL 2023 TP RF	0,20%	0,00%
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,20%	0,00%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	0,80%	0,00%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,70%	0,00%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1,50%	0,00%
FIC DE FI CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LP	1,50%	0,00%
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	0,40%	0,00%
FIC DE FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	1,50%	0,00%
FIC DE FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	2,00%	0,00%
FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR	0,20%	0,00%

270

271



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

272 **11. CONCLUSÃO** - O Macaeprev encerrou o mês de fevereiro de 2022 com o patrimônio  
273 consolidado de R\$ 3.597.395.433,25 (três bilhões e quinhentos e noventa e sete milhões e  
274 trezentos e noventa e cinco mil e quatrocentos e trinta e três reais e vinte e cinco centavos).  
275 **III – PRÓXIMA REUNIÃO:** Por unanimidade, ficou convocada reunião extraordinária para o  
276 dia trinta de março de 2022, às dezessete horas, de forma híbrida. **IV - ENCERRAMENTO:**  
277 Antes de encerrar a reunião, o membro **Miriam** agradeceu o carinho e acolhimento de todos.  
278 Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada e a ata será enviada para o e-mail e  
279 *whatsapp* de todos os membros, para leitura, aprovação e posterior assinatura de seus  
280 membros.

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

Miriam Amaral Queiroz

Patric Alves de Vasconcellos