

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	Administrador	Ativos	Vol%	Mes	Ano	Contratação Aplic./Resg	Valor(R\$) (26/02/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	Pl do Fundo	% no Pl do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,58%	0,00%	0,04%	D0/D0	409.330,20	9,68%	100%	8.878.861,822,11	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	12,85%	-1,53%	-2,38%	D0/D+1	274.808,84	6,50%	100%	7.633,261,120,04	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,06%	-0,61%	-0,52%	D0/D+1	581.004,33	13,74%	100%	5.161,161,829,74	0,01%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	5,09%	-0,62%	-0,54%	D0/D0	371.575,23	8,78%	100%	13.590,481,322,92	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	4,27%	-0,55%	-0,37%	D0/D+1	475.518,18	11,24%	100%	8.720.364,653,89	0,01%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-GERAL EX C TP FI	5,47%	-0,09%	-0,09%	D0/D+1	97.231,60	2,30%	100%	540.201,422,01	0,02%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN			2.209.458,37				52,24%					
CAIXA	CAIXA	CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP	12,82%	-1,55%	-2,42%	D0/D0	86.523,11	2,05%	20%	2.938.131,383,90	0,00%	15%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"			86.523,11				2,05%					
BB DTVM	BB DTVM	BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID	5,55%	-0,93%	-1,39%	D0/D+3	732.372,57	17,32%	20%	2.927.274,793,11	0,03%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,22%	0,10%	0,26%	D0/D0	121.246,84	2,87%	20%	2.967.791,040,55	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,15%	0,05%	0,13%	D0/D0	52.021,55	1,23%	20%	2.459.371,188,78	0,00%	15%
BRAM	Banco BRADESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,47%	-0,79%	-0,81%	D0/D+1	0,00	0,00%	20%	1.027.856,150,22	0,00%	15%
ITAU UNIBANCO	ITAU UNIBANCO	ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	1,67%	0,06%	0,19%	D0/D0	116.663,95	2,76%	20%	3.571.921,057,61	0,00%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral			1.022.304,91				24,17%					
Sub-total Renda Fixa			3.318.296,40				78,45%					
Renda Variável												
BB DTVM	BB DTVM	BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	46,07%	-4,85%	-9,57%	D+1/D+1	276.785,20	6,54%	20%	701.088,974,79	0,04%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	38,22%	-4,66%	-8,17%	D0/D0	136.887,00	3,24%	20%	129.438,505,35	0,11%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	33,14%	-2,79%	-5,29%	D+1/D+23	96.955,05	2,29%	20%	988.656,272,19	0,01%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral			510.627,26				12,07%					
BB DTVM	BB DTVM	BB ALOCAÇÃO FI MULTIM PREVID	1,91%	-1,10%	-0,62%	D+1/D+4	99.379,40	2,35%	20%	99.369,731,38	0,10%	5%
BB DTVM	BB DTVM	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4,48%	-0,30%	-0,23%	D+1/D+1	10.399,09	0,25%	20%	2.200.496,659,58	0,00%	5%
ITAU UNIBANCO	ITAU UNIBANCO	ITAU PRIVATE MULT S&P500 BRL FC	32,76%	2,70%	2,52%	D0/D0	161.780,68	3,82%	20%	2.083.741,174,16	0,01%	5%

Handwritten signatures and initials:
 [Signature]
 [Signature]
 [Signature]
 [Signature]
 [Signature]

Cliente: RJ IBASMA

Data Início: 31/12/2020

Data Extrato: 26/02/2021

Índice de comparação: IPCA + 5,41%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cofização Aplic/Resg	Valor(R\$) (26/02/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
			Sub-total Artigo 8º III - FI Multimercado				271.559,17	6,42%				
			Sub-total Renda Variável				782.186,43	18,49%				
Investimentos no Exterior												
BB DTVM	BB DTVM	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI	36,03%	-2,85%	-2,85%	D+1/D+1	129.213,87	3,05%	10%	872,02;455,80	0,01%	15%
			Sub-total Artigo 9 A III - Fundo de Ações BDR Nivel 1				129.213,87	3,05%				
			Sub-total Investimentos no Exterior				129.213,87	3,05%				
Total							4.229.696,70	100%				

Handwritten signatures and initials in blue ink.

Cliente: RJ IBASMA
Data Início: 31/12/2020

Data Extrato: 26/02/2021
Índice de comparação: IPCA + 5,41%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor (R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/2010
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	2.209.458,37	52,24%	50,66%	100,00%
Artigo 7º II, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	86.523,11	2,05%	0,00%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	1.022.304,91	24,17%	20,43%	40,00%
	Total Renda Fixa	3.318.296,40	78,46%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	510.627,26	12,07%	18,91%	20,00%
Artigo 8º III	FI Multimercado	271.559,17	6,42%	6,14%	10,00%
	Total Renda Variável	782.186,43	18,49%		
Investimentos no Exterior					
Artigo 9 A III	Fundo de Ações BDR Nivel 1	129.213,87	3,05%	0,43%	10,00%
	Total Investimentos no Exterior	129.213,87	3,05%		

Handwritten signatures and initials:




Cliente: RJ IBASMA

Data Início: 31/12/2020

Data Extrato: 26/02/2021

Índice de comparação: IPCA + 5,41%

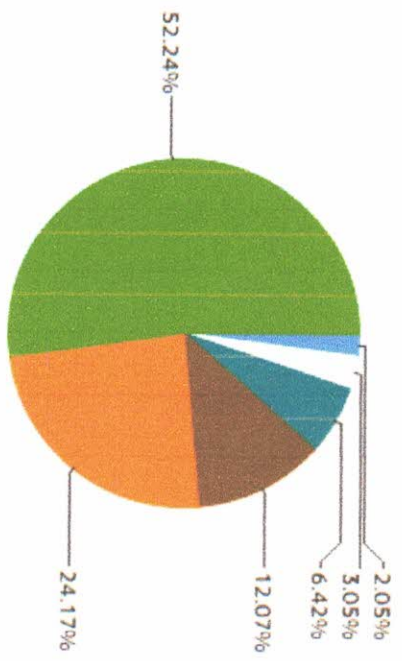
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)					Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mes	No Ano	12 meses	24 meses	Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,60 -442,6	-0,62 -219,1	Artigo 7º I, Alínea b	-12.882,09
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,55 -1.153,0	-2,42 -851,2	Artigo 7º III, Alínea a	-1.363,23
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,64 -473,4	-0,90 -317,5	Artigo 7º IV, Alínea a	-7.175,08
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	-4,37 -3.245,6	-8,51 -2.992,9	Artigo 8º II, Alínea a	-32.318,31
Artigo 8º III % do CDI	-0,28 -211,1	-0,07 -25,7	Artigo 8º III	227,03
Artigo 9 A III Var. Dólar Comercial p.p	-2,85 -4,9	-2,85 -4,9	Artigo 9 A III	-3.793,61
Total					Total	-57.305,29

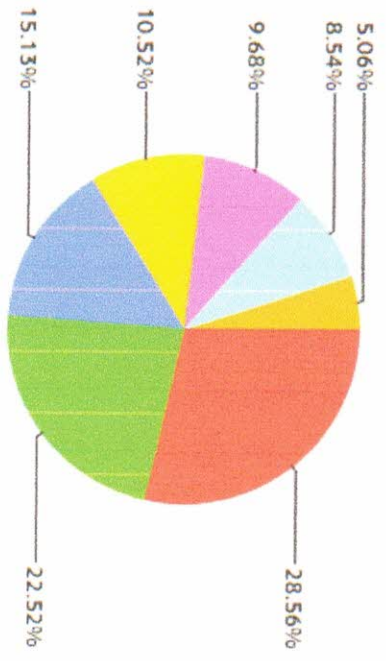
Handwritten signatures and initials in blue ink.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



- Artigo 7º III, Alínea a (2,05%)
- Artigo 9 A III (3,05%)
- Artigo 8º III (6,42%)
- Artigo 8º II, Alínea a (12,07%)
- Artigo 7º IV, Alínea a (24,17%)
- Artigo 7º I, Alínea b (52,24%)



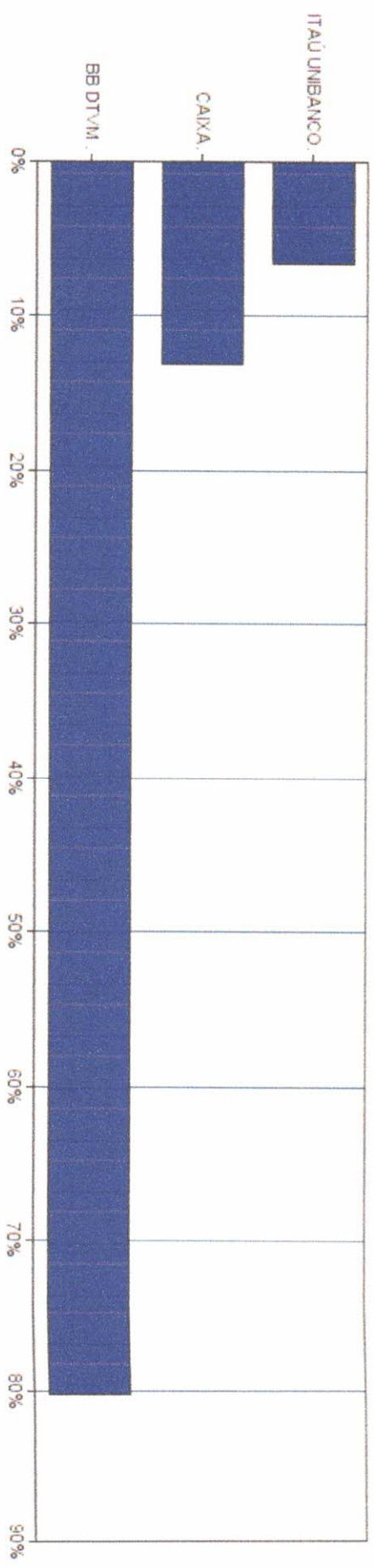
- IPCA (28,56%)
- IMA - B 5 (22,52%)
- IBOVESPA (15,13%)
- CDI (10,52%)
- IRF - M 1 (9,68%)
- IMA - B (8,54%)
- IMA - GERAL (5,06%)

Indexadores

Handwritten signatures and initials:
 [Signature] [Signature] [Signature] [Signature]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

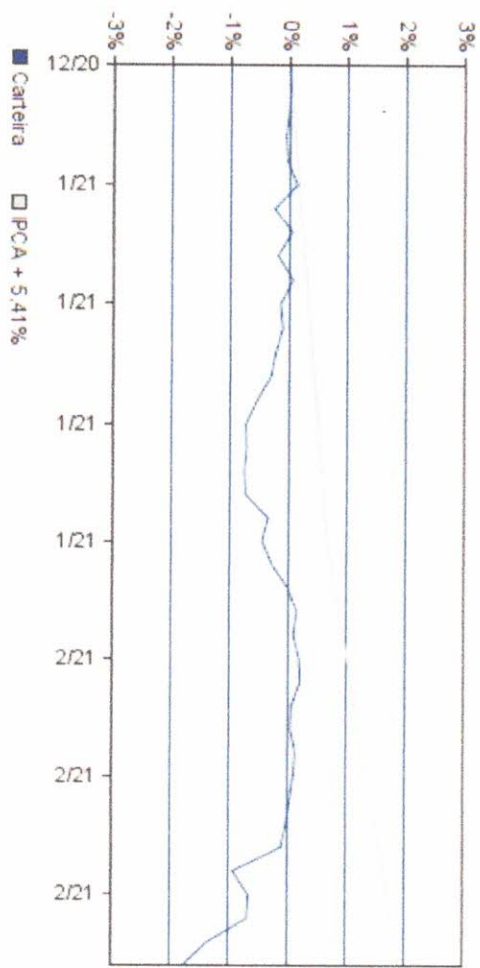


Handwritten signatures and initials:
 [Signature]
 [Signature]
 [Signature]
 [Signature]
 [Signature]

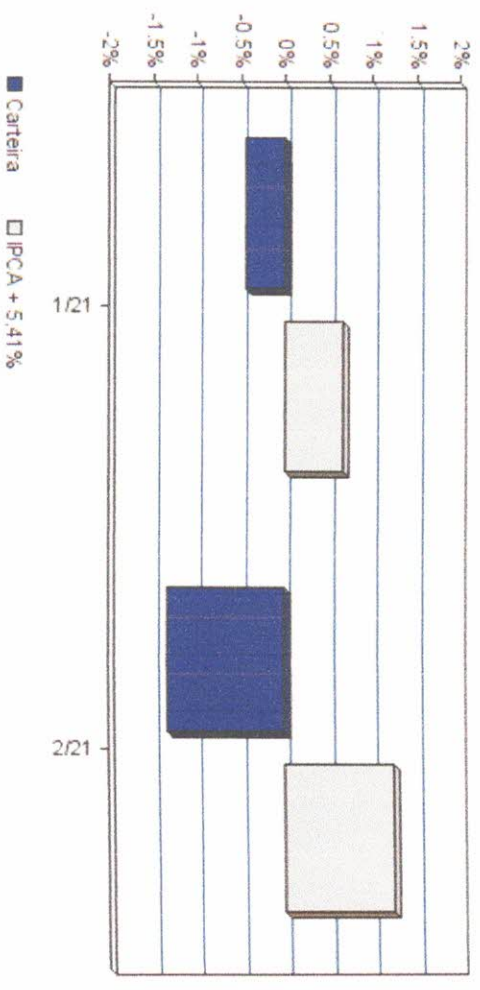
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,45	-1,33	-1,77
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,92
P.p. Índx	-1,12	-2,57	-3,69

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Handwritten signatures and initials in blue ink.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Annual
				Carteira	IPCA + 5,41%	P.p. Índx.	
Meses acima do Benchmark	0	0,0%	03 meses	-1,77	1,92	-3,7	3,792
Meses abaixo do Benchmark	2	100,0%	06 meses	--	--	--	--
			12 meses	--	--	--	--
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
Maior rentabilidade da Carteira	-0,45%	Jan/21	Desde o início	-1,77	1,92	-3,7	3,792
Menor rentabilidade da Carteira	-1,33%	fev/21					

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Fundo / Indexador	Rentabilidades em Períodos Fechados (%)						
	No Mes	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,00 -0,04	0,04 -0,05	0,04 -0,05	0,04 -0,05	0,04 -0,05	0,04 -0,05	0,04 -0,05
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-2,38 -0,03	-2,38 -0,03	-2,38 -0,03	-2,38 -0,03	-2,38 -0,03	-2,38 -0,03
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,61 -0,02	-0,52 -0,03	-0,52 -0,03	-0,52 -0,03	-0,52 -0,03	-0,52 -0,03	-0,52 -0,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,62 -0,02	-0,54 -0,05	-0,54 -0,05	-0,54 -0,05	-0,54 -0,05	-0,54 -0,05	-0,54 -0,05
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 Var. do IPCA p.p.	-0,55 -1,41	-0,37 -1,48	-0,37 -1,48	-0,37 -1,48	-0,37 -1,48	-0,37 -1,48	-0,37 -1,48
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-GERAL EX C TP FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,09 -0,00	-0,09 -0,00	-0,09 -0,00	-0,09 -0,00	-0,09 -0,00	-0,09 -0,00	-0,09 -0,00
CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,55 -0,03	-2,42 -0,06	-2,42 -0,06	-2,42 -0,06	-2,42 -0,06	-2,42 -0,06	-2,42 -0,06
BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID Var. do IPCA p.p.	-0,93 -1,79	-1,39 -2,50	-1,39 -2,50	-1,39 -2,50	-1,39 -2,50	-1,39 -2,50	-1,39 -2,50

gallalho

R

gallon



PARECER Nº 02/2021 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 05/2021 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 10 de março de 2021, no desempenho de suas competências de que trata o item 1.4 da Lei Municipal nº 154 DE 14 DE OUTUBRO DE 2019, APROVAM o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de fevereiro de 2021.

Elaine Aparecida Correia Lopes
DAFIN

Daniel Cassiano Miranda
ASTECOIN

Mônica Souza dos Santos Costa
SUPREV



PARECER Nº 01/2021 – CONSELHO FISCAL

Os membros participantes da Reunião Ordinária do Conselho Fiscal - CONFIS do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 30 de março de 2021, no desempenho de suas competências de que trata o item 1.2 da Lei Municipal nº 154 DE 14 DE OUTUBRO DE 2019, APROVAM o Relatório Mensal de Investimentos referente aos meses de janeiro e fevereiro de 2021.

Carmen Lúcia Cescon Coelho

Carmen Lúcia Cescon Coelho
Secretária CONFIS

Martha Pavão

Martha Pavão
Membro Titular CONFIS

Isabella Oliveira de Paula Santos

Isabella Oliveira de Paula Santos
Membro Titular CONFIS