

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic./Resg	Valor(R\$) (30/07/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
BB DTM	BB DTM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	3,02%	-0,50%	0,10%	D0/D+1	222.019,05	2,67%	100%	6.941.606;074,16	0,00%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL TTT PUB RF LP	0,48%	0,16%	0,16%	D0/D0	234.717,45	2,82%	100%	5.483.866;382,38	0,00%	15%
BB DTM	BB DTM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,39%	0,16%	0,82%	D0/D0	58.957,22	0,71%	100%	6.744.375;720,34	0,00%	15%
BB DTM	BB DTM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,70%	-0,39%	-1,20%	D0/D+1	278.144,47	3,34%	100%	7.757.107;360,64	0,00%	15%
BB DTM	BB DTM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	2,58%	-0,13%	0,52%	D0/D+1	399.973,22	4,80%	100%	383.418;856,62	0,10%	15%
BB DTM	BB DTM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,63%	0,02%	1,19%	D0/D+1	1.614.235,83	19,39%	100%	5.928.711;027,28	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,59%	0,01%	1,17%	D0/D0	990.228,51	11,90%	100%	11.707.172;620,85	0,01%	15%
BB DTM	BB DTM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	2,36%	0,08%	1,50%	D0/D+1	1.813.734,71	21,79%	100%	10.405.647;705,04	0,02%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							5.612.010,45	67,41%				
BB DTM	BB DTM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,19%	0,39%	1,72%	D0/D0	123.010,06	1,48%	20%	4.167.355;289,66	0,00%	15%
BB DTM	BB DTM	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,16%	0,25%	1,01%	D0/D0	24.292,16	0,29%	20%	2.238.891;986,28	0,00%	15%
BB DTM	BB DTM	BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID	3,38%	-0,11%	-0,50%	D0/D+3	738.954,98	8,88%	20%	4.460.514;993,96	0,02%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	0,51%	0,15%	1,16%	D0/D0	117.794,06	1,42%	20%	3.344.605;737,75	0,00%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							1.004.051,26	12,06%				
Sub-total Renda Fixa							6.616.061,71	79,48%				
Renda Variável												
BB DTM	BB DTM	BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	21,32%	-2,78%	2,87%	D+1/D+1	413.413,47	4,97%	20%	1.269.495;027,18	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	18,18%	-4,81%	2,64%	D+1/D+23	196.597,90	2,36%	20%	1.084.997;968,28	0,02%	15%
BB DTM	BB DTM	BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	20,58%	-3,10%	5,90%	D0/D0	197.548,65	2,37%	20%	398.541;145,81	0,05%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							807.560,02	9,70%				
BB DTM	BB DTM	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,11%	0,04%	1,23%	D+1/D+1	32.575,56	0,39%	20%	2.294.011;057,33	0,00%	5%
BB DTM	BB DTM	BB ALOCAÇÃO FI MULTIM PREVID	3,11%	-0,28%	0,38%	D+1/D+4	150.947,89	1,81%	20%	124.877;353,74	0,12%	5%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ PRIVATE MULT S&P500 BRL FC	15,09%	2,58%	19,12%	D0/D0	289.708,13	3,48%	20%	2.325.607;807,10	0,01%	5%
Sub-total Artigo 8º III - FI Multimercado							473.231,58	5,68%				

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

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

Data Extrato: 30/07/2021
Índice de comparação: IPCA + 5,41%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mes	Ano	Catização Aplic/Resq	Valor(R\$) (30/07/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Investimentos no Exterior												
BB DTVM	BB DTVM	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI	18,69%	1,95%	4,62%	D+1/D+1	427.754,21	5,14%	10%	1.107.587.533,90	0,04%	15%
Sub-total Artigo 9 A III - Fundo de Ações BDR Nivel 1							427.754,21	5,14%				
Sub-total Investimentos no Exterior							427.754,21	5,14%				
Total							8.324.607,51	100%				

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

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data Extrato: 30/07/2021
Índice de comparação: IPCA + 5,41%

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	5.612.010,45	67,41%	50,66%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	1.004.051,26	12,06%	20,43%	40,00%
	Total Renda Fixa	6.616.061,71	79,47%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	807.560,02	9,70%	18,91%	20,00%
Artigo 8º III	FI Multimercado	473.231,58	5,68%	6,14%	10,00%
	Total Renda Variável	1.280.791,60	15,38%		
Investimentos no Exterior					
Artigo 9 A III	Fundo de Ações BDR Nivel 1	427.754,21	5,14%	0,43%	10,00%
	Total Investimentos no Exterior	427.754,21	5,14%		

Handwritten signature

Handwritten signature

Handwritten signatures and initials

Cliente: RJ IBASMA

Data Início: 31/12/2020

Data Extrato: 30/07/2021

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	0,01 3,1	0,70 43,2	--	--	Artigo 7º I, Alínea b	-1.549,41
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,31 -997,3	-3,20 -622,2	--	--	Artigo 7º IV, Alínea a	-97,65
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,01 -2,7	0,06 3,5	--	--	Artigo 8º II, Alínea a	-28.082,87
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	-3,36 -945,0	3,53 216,7	--	--	Artigo 8º III	6.864,63
Artigo 8º III % do CDI	1,47 413,9	10,20 626,1	--	--	Artigo 9 A III	5.647,86
Artigo 9 A III Var. Dólar Comercial p.p	1,95 -0,4	4,62 10,1	--	--	Total	-17.217,44

Handwritten signature

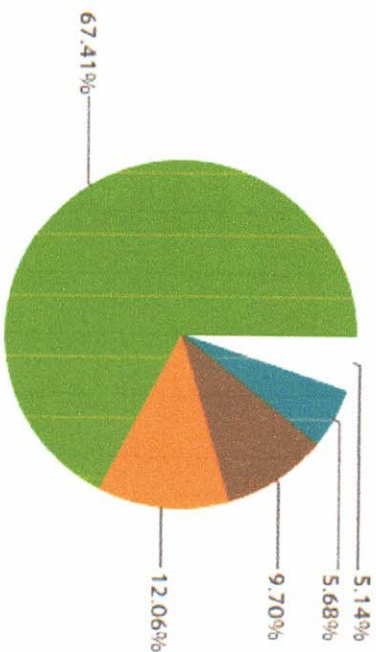
Handwritten signature

Handwritten signature

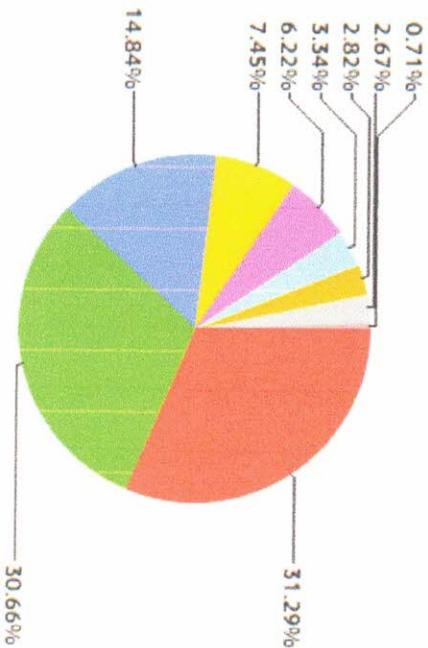
Handwritten signature

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



- Artigo 9 A III (5,14%)
- Artigo 8º III (5,68%)
- Artigo 8º II, Alínea a (9,70%)
- Artigo 7º IV, Alínea a (12,06%)
- Artigo 7º I, Alínea b (67,41%)



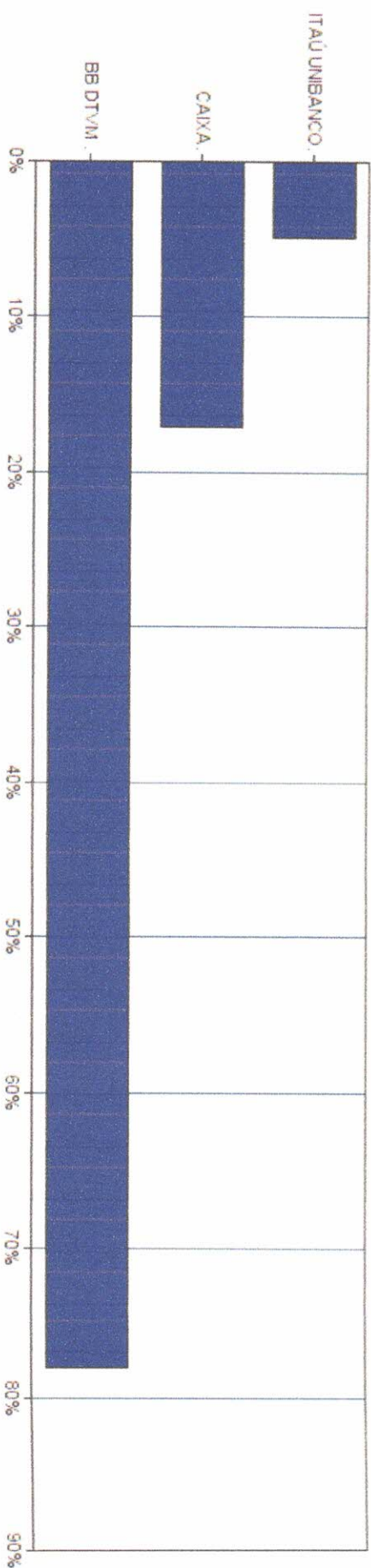
- IMA - B 5 (31,29%)
- IPCA (30,66%)
- IBOVESPA (14,84%)
- CDI (7,45%)
- IMA - GERAL (6,22%)
- IMA - B (3,34%)
- IPCA + 6% (2,82%)
- IRF - M (2,67%)
- IRF - M 1 (0,71%)

Indexadores

Handwritten signatures and initials in blue ink.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

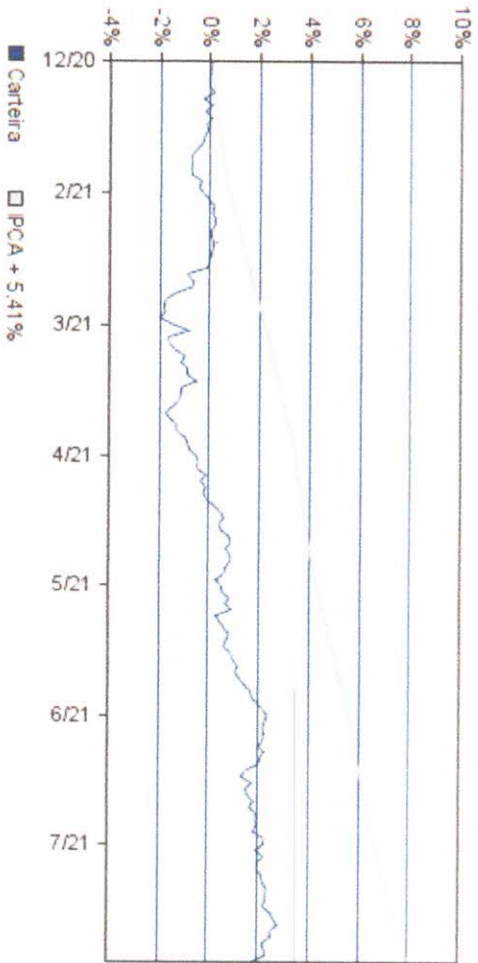


Handwritten signatures and initials:
 [Signature]
 [Signature]
 [Signature]
 [Signature]

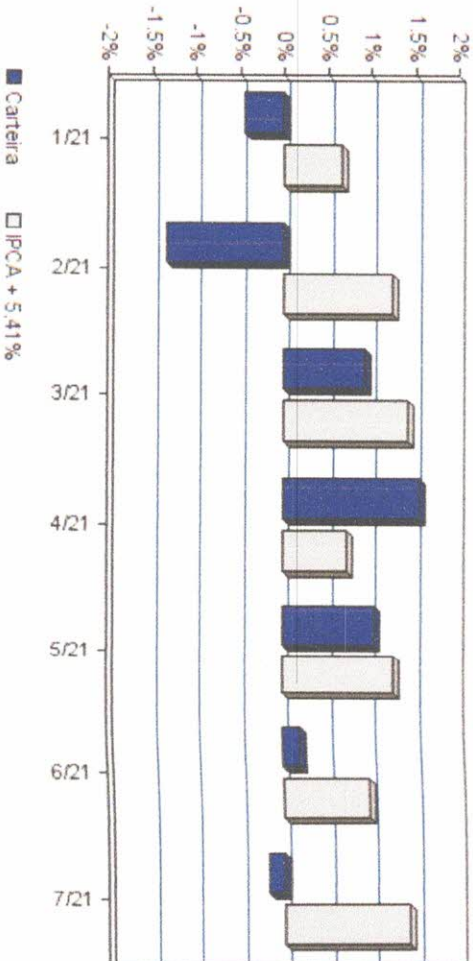
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2021	-0,45	-1,33	0,92	1,55	1,05	0,21	-0,18	1,75
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	7,99
p.p. Índx	-1,12	-2,57	-0,49	0,82	-0,23	-0,77	-1,61	-6,24

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

Mês	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	IPCA + 5,41%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	1	14,3%	03 meses	1,07	3,72	-2,6	3,405
Meses abaixo do Benchmark	6	85,7%	06 meses	2,21	7,27	-5,1	3,962
			12 meses	--	--	--	--
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
Maior rentabilidade da Carteira	1,55%	abr/21	Desde o inicio	1,75	7,99	-6,2	3,841
Menor rentabilidade da Carteira	-1,33%	fev/21					

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Fundo / Indexador	Rentabilidades em Períodos Fechados (%)						
	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	-0,50	0,10	0,10	0,10	0,10	0,10	0,10
Var. do IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,10	-0,10	-0,10	-0,10	-0,10	-0,10
FI CAIXA BRASIL TIT PUB RF LP	0,16	0,16	0,16	0,16	0,16	0,16	0,16
Var. do IPCA + 6% p.p.	-0,44	-0,44	-0,44	-0,44	-0,44	-0,44	-0,44
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,16	0,82	0,52	0,79	0,82	0,82	0,82
Var. do IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,18	-0,08	-0,17	-0,18	-0,18	-0,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	-0,38	-1,20	1,05	-0,34	-1,20	-1,20	-1,20
Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,11	-0,06	-0,09	-0,11	-0,11	-0,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-GERAL EX C TP FI	-0,13	-0,52	0,60	0,52	0,52	0,52	0,52
Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,03	-0,37	-0,27	-0,37	-0,37	-0,37	-0,37
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,02	0,02	0,52	1,09	1,19	1,19	1,19
Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,12	-0,07	-0,11	-0,12	-0,12	-0,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	0,01	1,17	0,53	1,08	1,17	1,17	1,17
Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,15	-0,05	-0,12	-0,15	-0,15	-0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	0,08	1,50	0,66	1,32	1,50	1,50	1,50
Var. do IPCA p.p.	-0,88	-3,26	-1,68	-3,18	-3,26	-3,26	-3,26

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 PERFIL FIC FI % do CDI	0,39	1,72	1,01	1,55	1,72	1,72	1,72
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI % do CDI	110,56	105,51	108,46	104,99	105,51	105,51	105,51
BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID Var. do IPCA p.p.	0,25	1,01	0,66	0,93	1,01	1,01	1,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID Var. do IPCA p.p.	69,29	61,74	71,31	62,71	61,74	61,74	61,74
TTAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,11	-0,50	-1,80	-0,04	-0,50	-0,50	-0,50
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES Var. do IBOVESPA p.p.	-1,07	-5,27	0,54	-4,54	-5,27	-5,27	-5,27
CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR Var. do IBOVESPA p.p.	0,16	1,16	0,71	1,03	1,16	1,16	1,16
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES Var. do IBOVESPA p.p.	0,26	1,13	-0,15	0,75	1,13	1,13	1,13
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP % do CDI	-2,78	2,87	2,04	8,25	2,87	2,87	2,87
BB ALOCAÇÃO FI MULTIM PREVID % do CDI	1,16	0,53	-0,40	2,40	0,53	0,53	0,53
TTAU PRIVATE MULT S&P500 BRL FC % do CDI	-4,81	2,64	1,63	5,36	2,64	2,64	2,64
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI Var. do IBOVESPA p.p.	-0,87	0,31	-0,81	-0,50	0,31	0,31	0,31
IPCA + 5,41%	-3,10	5,90	2,57	9,95	5,90	5,90	5,90
CDI	0,84	3,56	0,13	4,10	3,56	3,56	3,56
IMA - B	0,04	1,23	0,84	1,15	1,23	1,23	1,23
IMA - B 5	11,57	75,32	90,39	78,12	75,32	75,32	75,32
	-0,28	0,38	0,89	-0,11	0,38	0,38	0,38
	-79,26	23,41	95,77	-7,25	23,41	23,41	23,41
	2,58	19,12	5,74	19,34	19,12	19,12	19,12
	724,63	1.173,91	616,40	1.308,85	1.173,91	1.173,91	1.173,91
	1,95	4,62	3,44	4,62	4,62	4,62	4,62
	5,89	-0,68	1,00	-0,68	-0,68	-0,68	-0,68
	1,43	7,99	3,72	7,27	14,84	23,87	34,73
	0,36	1,63	0,93	1,48	2,43	6,77	13,54
	-0,37	-1,09	1,10	-0,24	2,53	10,89	41,35
	0,03	1,31	0,59	1,21	5,06	14,34	30,43

Handwritten signatures and initials in blue ink.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
IMA - B 5+	-0,76	-3,29	1,44	-1,63	0,34	8,18	49,88
IMA - GERAL	-0,10	0,04	0,87	0,28	1,67	9,12	25,92
IRF - M	-0,47	-2,04	-0,06	-1,25	-1,40	8,27	24,82
IRF - M 1	0,19	1,00	0,60	0,96	1,99	7,50	15,44
IRF - M 1+	-0,83	-4,11	-0,42	-2,76	-3,34	8,28	28,38
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75
IFIX	2,51	-1,60	-1,29	-1,92	3,33	6,19	31,08
SMALL CAP	-5,80	4,96	1,45	8,69	20,13	29,57	86,53
IPCA + 6%	1,47	8,33	3,66	7,56	15,48	25,26	36,99
INPC + 6%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51
Dolar Comercial	2,39	-1,45	-5,22	-6,47	-1,57	36,04	36,40
IBRX 100	-3,99	4,47	2,33	7,73	20,73	23,34	61,40
IBRX 50	-3,85	4,91	2,77	7,91	22,23	22,51	54,85
IGPM	0,78	15,99	5,54	13,08	33,84	46,24	55,61
INPC	1,02	5,01	2,60	4,73	9,85	12,81	16,38

Manoel
Manoel
Manoel
Manoel
Manoel



PARECER Nº 05/2021 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 14/2021 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 20 de agosto 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 julho de 2021.

Elaine Aparecida Correia Lopes
DAFIN

Daniel Cassiano Miranda
ASTECOIN

Mônica Souza dos Santos Costa
SUPREV



PARECER Nº 04/2021 – 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 10 de setembro 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 ao mês de julho de 2021.

Paulo Roberto dos Santos Rocha
Presidente do CONFIS

Martha Pavão
Membro Titular CONFIS

Isabella Oliveira de Paula Santos
Membro Titular CONFIS