



PARECER Nº 01/2022 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 01/2022 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 14 de janeiro de 2022, 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 dezembro de 2021.

Elaine Aparecida Correia Lopes
DAFIN

Daniel Cassiano Miranda
ASTECOIN

Mônica Souza dos Santos Costa
SUPREV

Martha Pavião
Secretária de Administração
Mat. 9950469

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resq	Valor(R\$) (31/12/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	Pl do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
--------	---------------	--------	------	-----	-----	-------------------------	----------------------------	------------	----------------------	-------------	---------------------	----------------------

Renda Fixa

BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	3,52%	1,88%	0,01%	D0/D+1	221.810,95	0,99%	100%	4.897.855.877,38	0,00%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL TIT PUB RF LP	0,15%	0,78%	2,92%	D0/D0	298.268,55	1,33%	100%	13.602.429.580,61	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M I TP FIC FI	0,66%	0,84%	2,64%	D0/D0	60.022,16	0,27%	100%	6.208.104.156,65	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,79%	0,20%	-1,51%	D0/D+1	2.183.963,98	9,72%	100%	7.081.253.604,41	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,78%	0,77%	4,31%	D0/D0	1.226.097,57	5,46%	100%	12.444.051.491,75	0,01%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	2,61%	0,71%	4,65%	D0/D+1	4.646.601,38	20,67%	100%	9.277.694.744,55	0,05%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	9,15%	-0,33%	-1,44%	D0/D+2	5.234.341,56	23,29%	100%	1.022.290.416,95	0,51%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	8,99%	-0,34%	-1,57%	D0/D0	1.645.006,44	7,32%	100%	1.353.637.713,77	0,12%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-GERAL EX C TP FI	2,72%	0,92%	1,43%	D0/D+1	201.308,47	0,90%	100%	331.401.986,59	0,06%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,82%	0,76%	4,27%	D0/D+1	2.995.145,79	13,33%	100%	6.458.635.592,00	0,05%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							18.712.566,85	83,25%				

ITAU UNIBANCO	ITAU UNIBANCO	ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	1,10%	0,86%	4,53%	D0/D0	121.712,34	0,54%	20%	2.626.754.965,65	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID	2,78%	0,76%	0,53%	D0/D+3	1.049.584,01	4,67%	20%	4.514.029.795,13	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,15%	0,80%	4,62%	D0/D0	272.732,44	1,21%	20%	7.206.695.128,79	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,13%	0,67%	3,27%	D0/D0	24.835,98	0,11%	20%	3.073.023.342,66	0,00%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							1.468.864,76	6,54%				
Sub-total Renda Fixa							20.181.431,62	89,79%				

Renda Variável

BB DTVM	BB DTVM	BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	20,25%	3,41%	-6,84%	D0/D0	173.783,07	0,77%	20%	351.114.622,38	0,05%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	20,13%	3,56%	-6,26%	D+1/D+1	376.708,96	1,68%	20%	1.417.181.864,81	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	19,81%	2,19%	-15,47%	D+1/D+23	161.901,88	0,72%	20%	826.907.180,52	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB AÇÕES AGRO FIC AÇÕES	-%	3,29%	3,29%	D0/D0	82.628,72	0,37%	20%	413.788.528,28	0,02%	15%

Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral

BB DTVM	BB DTVM	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,16%	1,15%	2,31%	D+1/D+1	32.925,43	0,15%	20%	2.326.198.271,43	0,00%	5%
Sub-total Renda Variável							795.022,63	3,54%				

Handwritten signatures and initials at the bottom of the page.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotação Aplic/Resg	Valor/(R\$) (31/12/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
BB DTM	BB DTM	BB ALOCAÇÃO FI MULTIM PREVID	3,97%	1,34%	1,40%	D+1/D+4	152.482,46	0,68%	20%	117.814.282,98	0,13%	5%
ITAU UNIBANCO	ITAU UNIBANCO	ITAU PRIVATE MULT S&P500 BRL FC	13,40%	5,54%	32,74%	D0/D0	322.830,68	1,44%	20%	2.374.573.482,34	0,01%	5%
		Sub-total Artigo 8º III - FI Multimercado					508.238,57	2,26%				
		Sub-total Renda Variável					1.303.261,20	5,80%				
Investimentos no Exterior												
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	17,60%	1,70%	-0,70%	D+1/D+1	99.304,19	0,44%	10%	3.890.658.229,39	0,00%	15%
BB DTM	BB DTM	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI	19,00%	-0,13%	-13,11%	D+1/D+1	892.529,62	3,97%	10%	795.243.970,77	0,11%	15%
		Sub-total Artigo 9 A III - Fundo de Ações BDR Nivel 1					991.833,81	4,41%				
		Sub-total Investimentos no Exterior					991.833,81	4,41%				
		Total					22.476.526,63	100%				

[Handwritten signatures and initials]

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

Data Extrato: 31/12/2021
Índice de comparação: IPCA + 5,41%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.972/2010	Margem
Renda Fixa						
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	18.712.566,85	83,25%	50,66%	100,00%	-7.325.958,46
Artigo 7º II, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	0,00	0,00%	0,00%	60,00%	-0,00
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	1.468.864,76	6,54%	20,43%	40,00%	3.123.089,63
	Total Renda Fixa	20.181.431,62	89,79%			
Renda Variável						
Artigo 8º II, Alínea b	FI de Ações - Geral	795.022,63	3,54%	18,91%	20,00%	3.455.288,56
Artigo 8º III	FI Multimercado	508.238,57	2,26%	6,14%	10,00%	871.820,16
	Total Renda Variável	1.303.261,20	5,80%			
Investimentos no Exterior						
Artigo 9 A III	Fundo de Ações BDR Nível 1	991.833,81	4,41%	0,43%	10,00%	-895.184,75
	Total Investimentos no Exterior	991.833,81	4,41%			

[Handwritten signatures and initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)					Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses	Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,24 31,8	2,63 59,8	2,63 59,8	--	Artigo 7º I, Alínea b	34.094,83
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,31 -997,3	-3,20 -622,2	--	--	Artigo 7º IV, Alínea a	11.293,77
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,77 101,5	1,49 33,8	1,49 33,8	--	Artigo 8º II, Alínea a	24.786,44
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	3,63 475,2	-8,30 -188,9	-8,30 -188,9	--	Artigo 8º III	19.349,59
Artigo 8º III % do CDI	3,96 518,4	18,35 417,5	18,35 417,5	--	Artigo 9 A III	526,69
Artigo 9 A III Var. Dólar Comercial p.p	0,05 0,8	-12,72 -15,7	--	--	Total	90.051,31

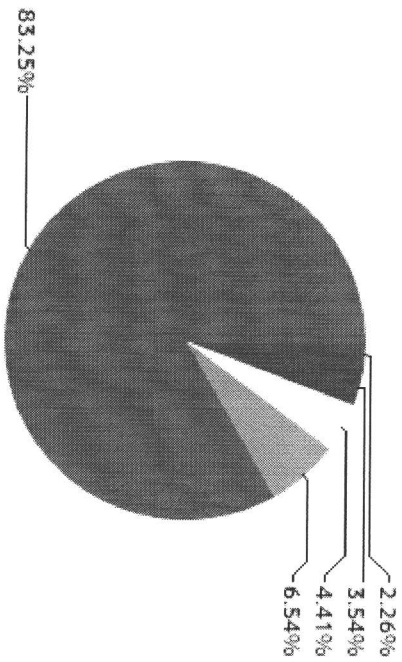




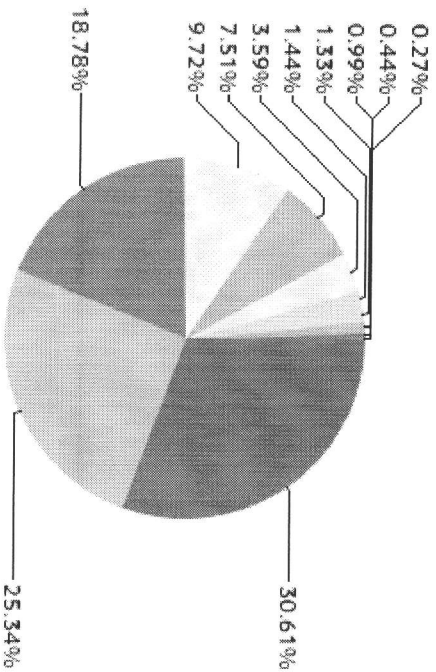


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



- Artigo 8º III (2,26%)
- Artigo 8º II, Alínea a (3,54%)
- Artigo 9º A III (4,41%)
- Artigo 7º IV, Alínea a (6,54%)
- Artigo 7º I, Alínea b (83,25%)



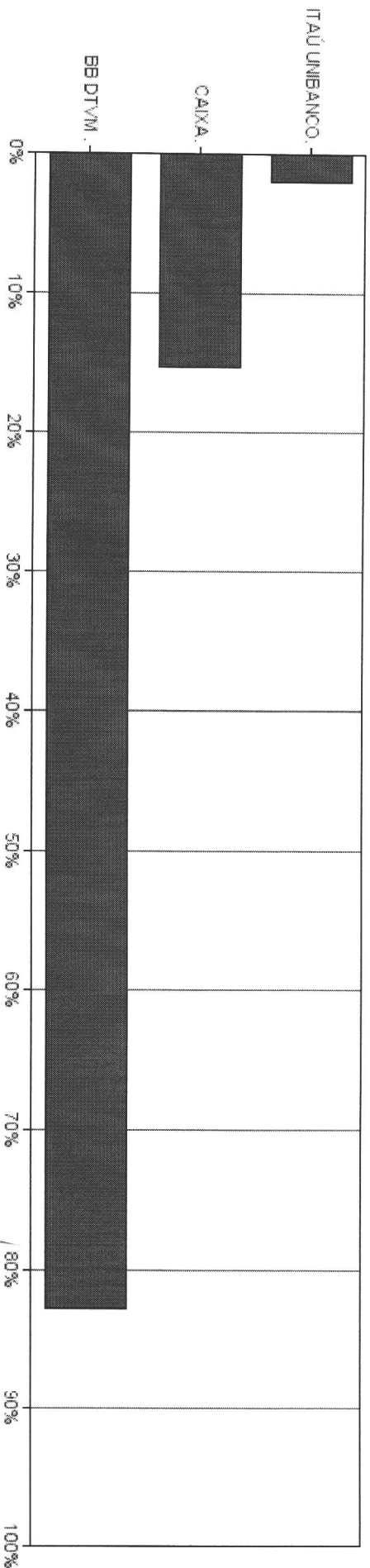
- IMA - B 5+ (30,61%)
- IPCA (25,34%)
- IMA - B 5 (18,78%)
- IMA - B (9,72%)
- IBOVESPA (7,51%)
- CDI (3,59%)
- IMA - GERAL (1,44%)
- IPCA + 6% (1,33%)
- IRF - M (0,99%)
- Dolar Comercial (0,44%)
- IRF - M 1 (0,27%)






Indexadores

[Handwritten signatures and initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



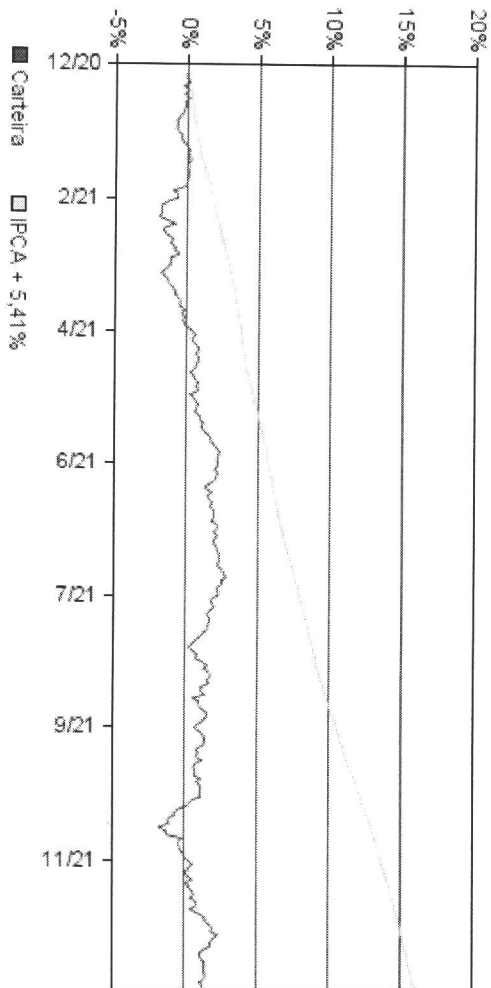






EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

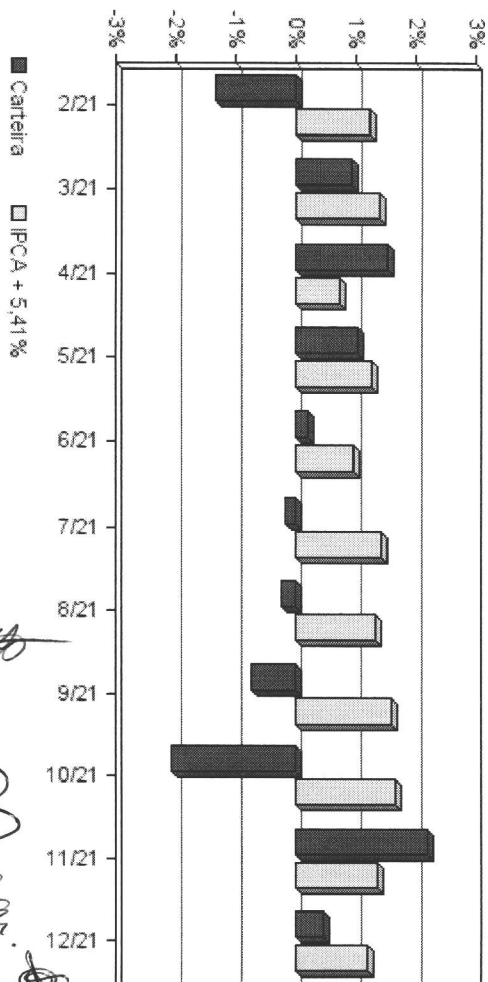
Rentabilidades da Carteira

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	-0,24	-0,72	-2,07	2,18	0,47	1,33
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
P.P. Índx	-1,12	-2,57	-0,49	0,82	-0,23	-0,77	-1,61	-1,57	-2,32	-3,74	0,81	-0,75	-14,67

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



[Handwritten signatures and initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

Mês	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	IPCA + 5,41%	p.p. Índx.	
Meses acima do Benchmark	2	16,7%	03 meses	0,54	4,32	-3,8	5,088
Meses abaixo do Benchmark	10	83,3%	06 meses	-0,60	8,94	-9,5	4,606
			12 meses	1,33	15,99	-14,7	4,273
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	1,33	15,99	-14,7	4,273

Índice	Período	Retorb.	Mês
Maiores rentabilidade da Carteira	2,18%	nov/21	
Menor rentabilidade da Carteira	-2,07%	out/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 Var. do IRF-M TOTAL p.p.	1,88 -0,01	0,01 -0,25	0,93 -0,05	-0,59 -0,17	0,01 -0,25	0,01 -0,25	0,01 -0,25
FI CAIXA BRASIL TIT PUB RF LP Var. do IPCA + 6% p.p.	0,78 -0,49	2,92 -5,39	1,90 -2,57	2,92 -5,39	2,92 -5,39	2,92 -5,39	2,92 -5,39
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,03	2,64 -0,29	1,10 -0,03	1,97 -0,12	2,64 -0,29	2,64 -0,29	2,64 -0,29
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-1,51 -0,25	0,97 -0,09	-0,70 -0,16	-1,51 -0,25	-1,51 -0,25	-1,51 -0,25
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,31 -0,25	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	4,31 -0,25	4,31 -0,25
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 Var. do IPCA p.p.	0,71 -0,02	4,65 -5,42	1,86 -1,10	3,18 -2,88	4,65 -5,42	4,65 -5,42	4,65 -5,42
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,33 0,01	-1,44 -0,10	0,01 -0,08	-1,44 -0,10	-1,44 -0,10	-1,44 -0,10	-1,44 -0,10
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,34 -0,00	-1,57 -0,22	-0,14 -0,23	-1,57 -0,22	-1,57 -0,22	-1,57 -0,22	-1,57 -0,22

Handwritten signatures and initials at the bottom of the page.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-GERAL EX C TP FI Var. do IMA-GERAL TOTAL P.P.	0,92 0,05	1,43 -0,39	1,31 -0,03	0,78 -0,04	1,43 -0,39	1,43 -0,39	1,43 -0,39
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 P.P.	0,76 -0,02	4,27 -0,30	1,94 -0,09	3,06 -0,17	4,27 -0,30	4,27 -0,30	4,27 -0,30
ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL P.P.	0,86 -0,01	4,53 3,57	2,16 0,81	3,49 2,67	4,53 3,57	4,53 3,57	4,53 3,57
BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID Var. do IPCA P.P.	0,76 0,03	0,53 -9,53	1,40 -1,56	0,93 -5,14	0,53 -9,53	0,53 -9,53	0,53 -9,53
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 104,63	4,62 105,21	1,93 104,82	3,26 105,62	4,62 105,21	4,62 105,21	4,62 105,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI % do CDI	0,67 87,65	3,27 74,33	1,58 85,85	2,49 80,68	3,27 74,33	3,27 74,33	3,27 74,33
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES Var. do IBOVESPA P.P.	3,41 0,56	-6,84 5,09	-6,92 -1,37	-14,76 2,58	-6,84 5,09	-6,84 5,09	-6,84 5,09
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES Var. do IBOVESPA P.P.	3,56 0,71	-6,26 5,66	-3,10 2,44	-11,41 5,92	-6,26 5,66	-6,26 5,66	-6,26 5,66
CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR Var. do IBOVESPA P.P.	2,19 -0,66	-15,47 -3,54	-10,34 -4,79	-21,61 -4,28	-15,47 -3,54	-15,47 -3,54	-15,47 -3,54
BB AÇÕES AGRO FIC AÇÕES Var. do IBOVESPA P.P.	3,29 4,67	3,29 4,67	3,29 4,67	3,29 4,67	3,29 4,67	3,29 4,67	3,29 4,67
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP % do CDI	1,15 150,93	2,31 52,65	1,30 70,48	1,12 36,14	2,31 52,65	2,31 52,65	2,31 52,65
BB ALOCAÇÃO FI MULTIM PREVID % do CDI	1,34 175,31	1,40 31,90	1,91 103,67	0,73 23,71	1,40 31,90	1,40 31,90	1,40 31,90
ITAU PRIVATE MULT S&P500 BRL FC % do CDI	5,54 726,20	32,74 744,96	13,02 707,02	14,30 463,36	32,74 744,96	32,74 744,96	32,74 744,96
CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. do Dolar Comercial P.P.	1,70 2,40	-0,70 -1,09	-0,70 -1,09	-0,70 -1,09	-0,70 -1,09	-0,70 -1,09	-0,70 -1,09
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI Var. do IBOVESPA P.P.	-0,13 -2,98	-13,11 -3,73	-9,21 -3,66	-15,33 2,01	-13,11 -3,73	-13,11 -3,73	-13,11 -3,73

[Handwritten signatures and initials]

Cliente: RJ IBASMA

Data Início: 31/12/2020

Data Extrato: 31/12/2021

Índice de comparação: IPCA + 5,41%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5,41%	1,22	15,99	4,32	8,94	15,99	27,76	40,50
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IMA - B	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17
IMA - B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83
IMA - B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53
IMA - GERAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98
IRF - M	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15
IRF - M 1	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10
IRF - M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	--
IPCA + 6%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87
IMPC + 6%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
Dólar Comercial	-0,70	7,39	2,59	11,56	7,39	38,45	44,02

[Handwritten signatures and initials]

[Handwritten initials]

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

Data Extrato: 31/12/2021
Índice de comparação: IPCA + 5,41%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	--
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	--
IGPM	0,87	17,79	1,54	2,34	17,79	45,04	55,64
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37
IPCA	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99

[Handwritten signatures and initials]