



PARECER Nº 02/2022 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 02/2022 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 02 de fevereiro 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 janeiro de 2022.

Elaine Aparecida Correia Lopes
DAFIN

Daniel Cassiano Miranda
ASTECOIN

Mônica Souza dos Santos Costa
SUPREV

Martha Dória
Secretaria de Administração
Mat. 9950469

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotação Aplic/Resg	Valor(R\$) (31/01/2022)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
--------	---------------	--------	------	-----	-----	--------------------	-------------------------	------------	-------------------	-------------	------------------	-------------------

BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	3,54%	-0,13%	-0,13%	D0/D+1	221.528,63	0,99%	100%	4.743.847.539,71	0,00%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL TIT PUB RF LP	0,17%	0,79%	0,79%	D0/D0	300.637,00	1,35%	100%	14.693.290.660,98	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,70%	0,61%	0,61%	D0/D0	60.390,72	0,27%	100%	5.049.727.685,75	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,71%	-0,77%	-0,77%	D0/D+1	2.167.193,60	9,71%	100%	6.778.952.571,30	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,77%	0,09%	0,09%	D0/D0	1.227.205,69	5,50%	100%	12.040.160.059,77	0,01%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	2,63%	0,01%	0,01%	D0/D+1	4.647.048,92	20,83%	100%	9.258.989.052,65	0,05%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	9,04%	-1,63%	-1,63%	D0/D+2	5.149.128,65	23,08%	100%	954.093.578,76	0,54%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	8,88%	-1,62%	-1,62%	D0/D0	1.618.382,93	7,25%	100%	1.336.256.948,50	0,12%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-GERAL EX C TP FI	2,68%	0,08%	0,08%	D0/D+1	201.463,01	0,90%	100%	262.049.983,99	0,08%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,81%	0,08%	0,08%	D0/D+1	2.997.446,45	13,43%	100%	6.406.714.372,41	0,05%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN			18.590.425,62				18.590.425,62	83,32%				

ITAU UNIBANCO	ITAU UNIBANCO	ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	1,12%	0,52%	0,52%	D0/D0	122.348,12	0,55%	20%	2.545.578.020,48	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID	2,65%	0,19%	0,19%	D0/D+3	1.051.586,51	4,71%	20%	4.210.770.280,16	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,17%	0,78%	0,78%	D0/D0	274.868,91	1,23%	20%	7.223.462.787,00	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,15%	0,65%	0,65%	D0/D0	24.997,96	0,11%	20%	3.101.943.229,29	0,00%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral			1.473.801,51				1.473.801,51	6,61%				
Sub-total Renda Fixa			20.064.227,12				20.064.227,12	89,93%				

Renda Variável

BB DTVM	BB DTVM	BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	20,29%	6,24%	6,24%	D0/D0	184.626,31	0,83%	20%	362.173.691,73	0,05%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	19,51%	6,49%	6,49%	D+1/D+1	401.140,21	1,80%	20%	1.502.868.240,22	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	19,98%	5,72%	5,72%	D+1/D+23	171.164,48	0,77%	20%	849.367.313,22	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB AÇÕES AGRO FIC AÇÕES	17,11%	0,29%	0,29%	D0/D0	82.868,68	0,37%	20%	404.112.894,17	0,02%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral			839.799,67				839.799,67	3,76%				
BB DTVM	BB DTVM	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,16%	1,32%	1,32%	D+1/D+1	33.359,61	0,15%	20%	2.298.597.190,94	0,00%	5%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS







Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (31/01/2022)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
BB DTVM	BB DTVM	BB ALOCAÇÃO FI MULTIM PREVID	3,99%	0,73%	0,73%	D+1/D+4	153.596,11	0,69%	20%	118.441.860,89	0,13%	5%
ITAU UNIBANCO	ITAU UNIBANCO	ITAU PRIVATE MULT SRP500 BRL FC	13,60%	-5,29%	-5,29%	D0/D0	305.763,35	1,37%	20%	2.221.853.983,54	0,01%	5%
Sub-total Artigo 8º III - FI Multimercado							492.719,07	2,21%				
Investimentos no Exterior							1.332.518,75	5,97%				
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	17,37%	-9,75%	-9,75%	D+1/D+1	89.625,97	0,40%	10%	3.479.303.240,79	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI	19,46%	-7,58%	-7,58%	D+1/D+1	824.908,62	3,70%	10%	677.797.398,12	0,12%	15%
Sub-total Artigo 9 A III - Fundo de Ações BDR Nivel 1							914.534,59	4,10%				
Sub-total Investimentos no Exterior							914.534,59	4,10%				
Total							22.311.280,46	100%				

[Handwritten signatures and initials]
 SP
 Govern
 R

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor (R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3-9/21/2010	Margem
Renda Fixa						
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	18.590.425,62	83,32%	50,66%	100,00%	-7.287.530,93
Artigo 7º III, 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	1.473.801,51	6,61%	20,43%	40,00%	3.084.393,09
	Total Renda Fixa	20.064.227,12	89,93%			
Renda Variável						
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	839.799,67	3,76%	18,91%	20,00%	3.379.263,46
Artigo 8º III	FI Multimercado	492.719,07	2,21%	6,14%	10,00%	877.193,55
	Total Renda Variável	1.332.518,75	5,97%			
Investimentos no Exterior						
Artigo 9 A III	Fundo de Ações BDR Nível 1	914.534,59	4,10%	0,43%	10,00%	-818.596,08
	Total Investimentos no Exterior	914.534,59	4,10%			

Cliente: RJ IBASMA

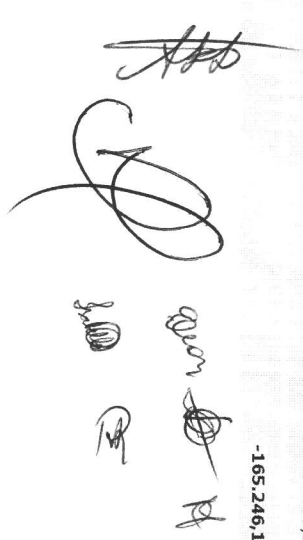
Data Início: 31/12/2020

Data Extrato: 31/01/2022

Índice de comparação: IPCA + 5,41%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

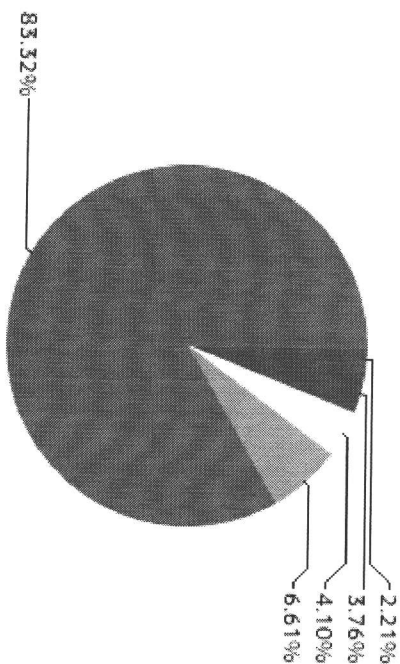
Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)					Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses	Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,65 -89,1	-0,65 -89,1	1,99 39,7	--	Artigo 7º I, Alínea b	-122.141,24
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,31 -997,3	-3,20 -622,2	--	--	Artigo 7º IV, Alínea a	4.936,74
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,34 45,9	0,34 45,9	2,10 42,0	--	Artigo 8º II, Alínea a	44.777,05
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	5,63 769,1	5,63 769,1	1,25 24,9	--	Artigo 8º III	-15.519,50
Artigo 8º III % do CDI	-3,05 -417,0	-3,05 -417,0	14,49 289,7	--	Artigo 9 A III	-77.299,22
Artigo 9 A III Var. Dolar Comercial p.p	-7,79 -3,8	-7,79 -3,8	-19,52 -18,4	--	Total	-165.246,17



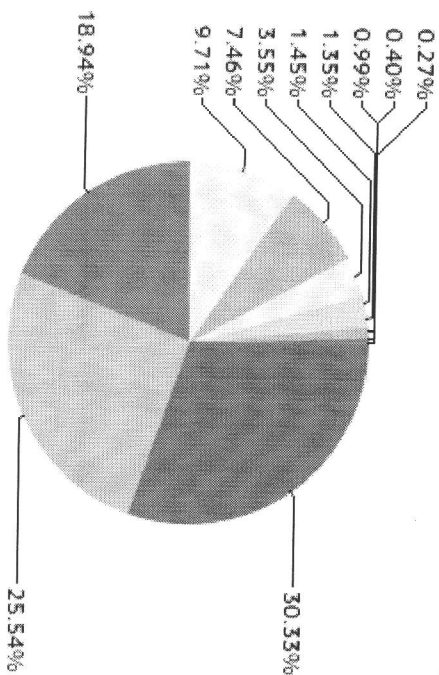
Handwritten signatures and initials, including a large signature and several smaller ones, likely representing the client and the advisor.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



- Artigo 8º III (2,21%)
- Artigo 8º II, Alínea a (3,76%)
- Artigo 9º A III (4,10%)
- Artigo 7º IV, Alínea a (6,61%)
- Artigo 7º I, Alínea b (83,32%)



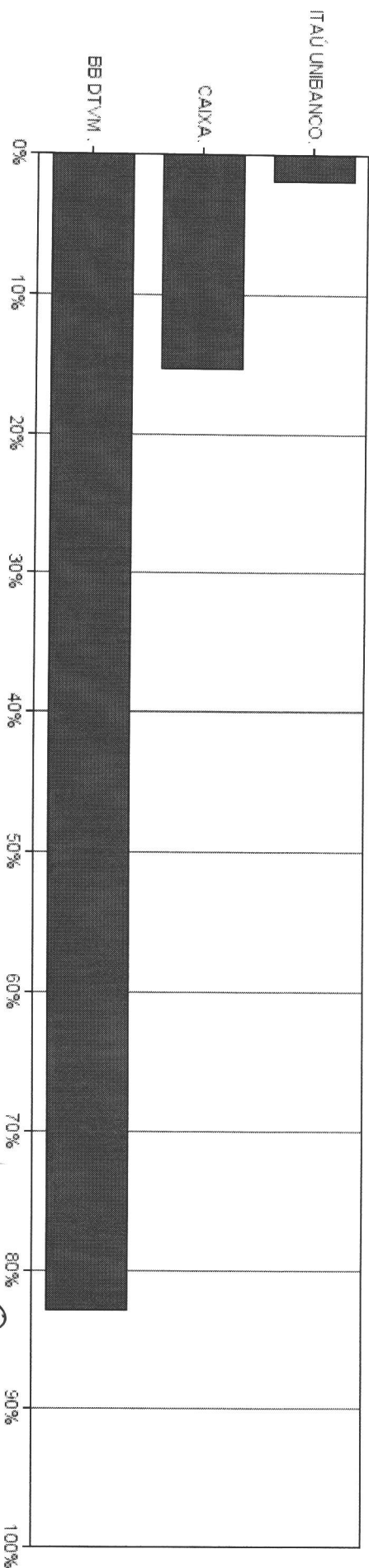
- IMA - B 5+ (30,33%)
- IPCA (25,54%)
- IMA - B 5 (18,94%)
- IMA - B (9,71%)
- IBOVESPA (7,46%)
- CDI (3,55%)
- IMA - GERAL (1,45%)
- IPCA + 6% (1,35%)
- IRF - M (0,99%)
- Dolar Comercial (0,40%)
- IRF - M 1 (0,27%)

Indexadores


[Handwritten signatures and initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor







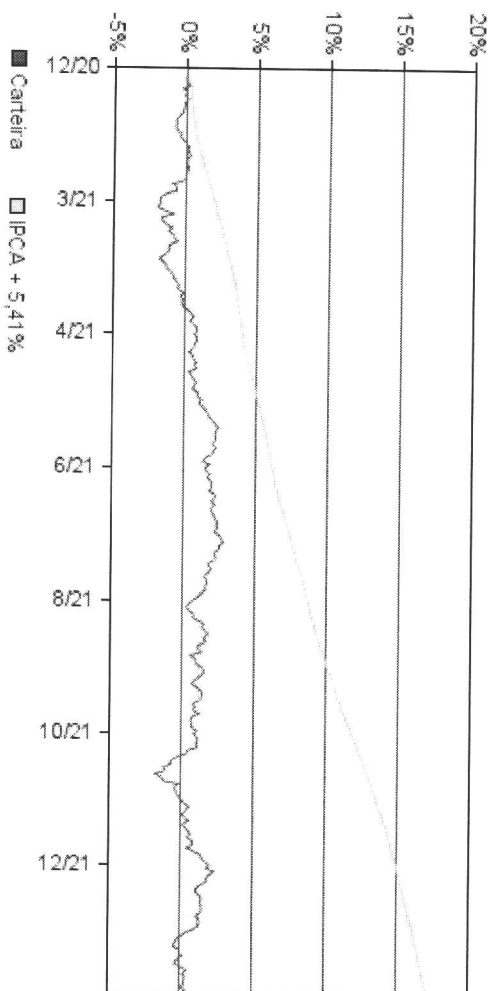


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

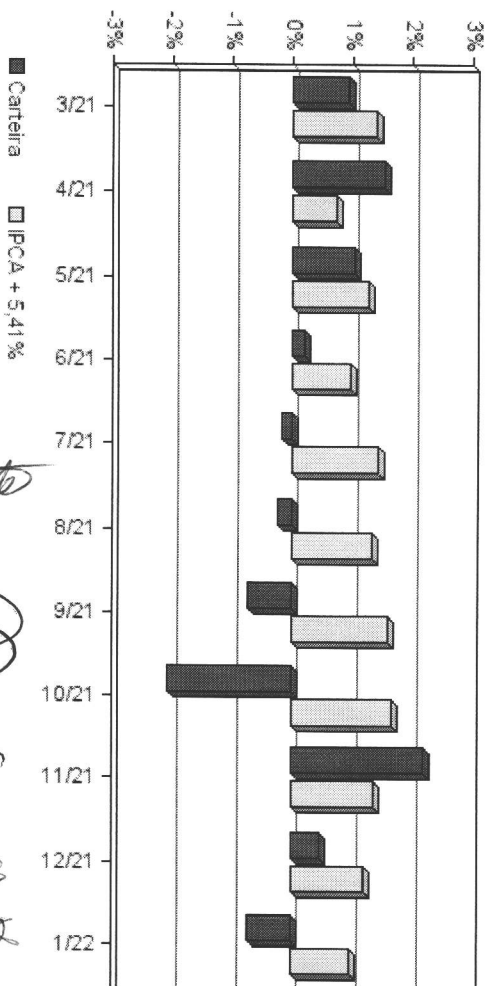
Rentabilidades da Carteira

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	1,72	15,99
P.p. Indx	-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
2022	-0,74	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,74
IPCA + 5,41%	0,98	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,98
P.p. Indx	-1,72	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-1,72

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



[Handwritten signatures and initials]

Cliente: RJ IBASMA

Data Início: 31/12/2020

Data Extrato: 31/01/2022

Índice de comparação: IPCA + 5,41%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

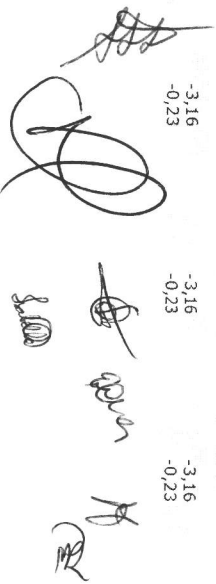
Análise de Risco / Retorno da Carteira

Mês	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	IPCA + 5,41%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	2	15,4%	03 meses	1,91	3,61	-1,7	4,569
Meses abaixo do Benchmark	11	84,6%	06 meses	-1,15	8,47	-9,6	4,758
			12 meses	1,03	16,35	-15,3	4,355
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	0,58	17,13	-16,6	4,268

Índice	Período	Retab.	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 Mes	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	-0,13	-0,13	3,58	-0,22	-0,12	-0,12	-0,12
Var. do IRF-M TOTAL p.p.	-0,05	-0,05	-0,05	-0,19	-0,29	-0,29	-0,29
FI CAIXA BRASIL TIT PUB RF LP	0,79	0,79	2,18	3,57	3,74	3,74	3,74
Var. do IPCA + 6% p.p.	-0,24	-0,24	-1,58	-5,20	-5,69	-5,69	-5,69
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,61	0,61	2,25	2,43	3,24	3,27	3,27
Var. do IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,01	-0,06	-0,11	-0,29	-0,30	-0,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	-0,77	-0,77	2,85	-1,09	-1,42	-2,27	-2,27
Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,03	-0,08	-0,18	-0,27	-0,28	-0,28
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	0,09	0,09	3,35	3,20	4,32	4,41	4,41
Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,02	-0,08	-0,12	-0,25	-0,28	-0,28
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	0,01	0,01	3,16	3,11	4,47	4,66	4,66
Var. do IPCA p.p.	-0,53	-0,53	0,93	-2,52	-5,91	-6,00	-6,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	-1,63	-1,63	2,40	-3,05	-3,05	-3,05	-3,05
Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,02	-0,04	-0,12	-0,12	-0,12	-0,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	-1,62	-1,62	2,31	-3,16	-3,16	-3,16	-3,16
Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,01	-0,01	-0,13	-0,23	-0,23	-0,23	-0,23



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	0,08	0,08	2,82	0,99	1,51	1,51	1,51
Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,13	-0,13	-0,08	-0,14	-0,52	-0,52	-0,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,08	0,08	3,33	3,12	4,25	4,35	4,35
Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,04	-0,04	-0,09	-0,20	-0,32	-0,33	-0,33
ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	0,52	0,52	3,06	3,87	4,93	5,08	5,08
Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,31	0,31	0,16	2,73	3,52	3,91	3,91
BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID	0,19	0,19	2,51	1,24	1,20	0,73	0,73
Var. do IPCA p.p.	-0,35	-0,35	0,27	-4,39	-9,18	-9,93	-9,93
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFL FIC FI	0,78	0,78	2,23	3,66	5,27	5,44	5,44
% do CDI	106,98	106,98	106,30	105,41	105,34	105,50	105,50
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,65	0,65	1,84	2,91	3,86	3,94	3,94
% do CDI	89,07	89,07	87,65	83,63	77,14	76,37	76,37
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6,24	6,24	7,40	-6,54	2,76	-1,03	-1,03
Var. do IBOVESPA p.p.	-0,74	-0,74	-0,95	1,39	5,30	4,75	4,75
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,49	6,49	8,64	-2,97	5,03	-0,19	-0,19
Var. do IBOVESPA p.p.	-0,50	-0,50	0,29	4,96	7,57	5,59	5,59
CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	5,72	5,72	5,48	-12,94	-8,27	-10,63	-10,63
Var. do IBOVESPA p.p.	-1,26	-1,26	-2,87	-5,01	-5,73	-4,86	-4,86
BB AÇÕES AGRO FIC AÇÕES	0,29	0,29	3,59	3,59	3,59	3,59	3,59
Var. do IBOVESPA p.p.	-6,69	-6,69	-1,92	-1,92	-1,92	-1,92	-1,92
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,32	1,32	2,02	2,41	3,59	3,66	3,66
% do CDI	180,08	180,08	96,47	69,28	71,73	71,00	71,00
BB ALOCAÇÃO FI MULTIM PREVID	0,73	0,73	2,73	1,75	1,65	2,14	2,14
% do CDI	99,74	99,74	130,04	50,50	32,89	41,52	41,52
ITAU PRIVATE MULT S&P500 BRL FC	-5,29	-5,29	-0,54	5,54	25,95	25,72	25,72
% do CDI	-721,97	-721,97	-25,94	159,52	518,70	498,57	498,57
CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	-9,75	-9,75	-10,37	-10,37	-10,37	-10,37	-10,37
Var. do Dólar Comercial p.p.	-5,75	-5,75	-6,76	-6,76	-6,76	-6,76	-6,76
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI	-7,58	-7,58	-10,88	-22,24	-19,69	-19,69	-19,69
Var. do IBOVESPA p.p.	-14,56	-14,56	-19,23	-15,31	-16,65	-16,65	-16,65

[Handwritten signatures and initials]

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
IPCA + 5,41%	0,98	0,98	3,61	8,47	16,35	28,16	40,78
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IMA - B	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86
IMA - B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04
IMA - B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62
IMA - GERAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98
IRF - M	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45
IRF - M 1	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16
IRF - M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49
IPCA + 6%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15
INPC + 6%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
Dólar Comercial	-4,00	-4,00	-5,06	4,60	-2,16	25,48	46,70








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	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71
IGPM	1,82	1,82	2,73	3,40	16,92	46,98	58,46
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74
IPCA	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25