



## PARECER Nº 03/2022 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 04/2022 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 04 de março 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 fevereiro de 2022.

Elaine Aparecida Correia Lopes  
DAFIN

Daniel Cassiano Miranda  
ASTECOIN

Mônica Souza dos Santos Costa  
SUPREV






Martha Paão  
Secretaria de Administração  
Mat. 9950469

# 2022

## Relatório Mensal

### Fevereiro Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MPB nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.834.978,09	20,53%	9.012.864.987,26	0,05%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.029.050,38	12,86%	6.375.804.434,87	0,05%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.148.053,50	21,86%	936.801.809,27	0,55%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.178.757,13	9,25%	6.297.272.157,92	0,03%	7º I b
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	202.816,59	0,88%	210.569.175,42	0,10%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.835,90	0,26%	5.025.689.167,39	0,00%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	222.786,70	0,95%	4.398.251.592,64	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	705.000,00	2,99%	1.638.119.424,99	0,04%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	341.492,50	1,45%	1.676.536.603,63	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.240.102,69	5,27%	11.612.568.005,11	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.618.725,15	6,87%	1.307.933.038,85	0,12%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.058.621,29	4,50%	4.159.933.633,04	0,03%	7º III a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.167,37	0,11%	3.177.445.522,66	0,00%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	277.063,23	1,18%	7.639.104.845,31	0,00%	7º III a
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	303.273,83	1,29%	16.227.045.266,95	0,00%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	123.484,15	0,52%	2.413.852.979,92	0,01%	7º III a
BB AGRO FIC AÇÕES	82.452,94	0,35%	427.919.840,15	0,02%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	181.129,52	0,77%	344.862.629,20	0,05%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	399.790,17	1,70%	1.491.112.952,73	0,03%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	168.890,84	0,72%	827.336.565,82	0,02%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NIVEL I	772.653,69	3,28%	593.209.756,84	0,13%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	83.247,45	0,35%	2.975.370.153,41	0,00%	9º III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	155.126,53	0,66%	117.589.319,58	0,13%	10º I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	33.672,88	0,14%	2.297.951.935,11	0,00%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	299.086,40	1,27%	2.075.819.919,23	0,01%	10º I

Investimentos

\$ 23.546.258,92

Disponibilidades Financeiras

\$ 847.176,72

Total Carteira

\$ 24.393.435,64

Governança (Pró Gestão)

2º NIVEL 2 29/09/2024

Artigos -	Limite (%)	Utilizado	Livre	Política de Investimentos			GAP - Superior	Governança (Pró Gestão)
				Inferior %	Alvo %	Superior %		
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	0,00	23.546.258,92	0,00%	5,00%	100,00%	23.546.258,92	NIVEL 2 29/09/2024
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	19.582.598,63	3.963.660,29	0,00%	0,00%	0,00%	-19.582.598,63	Renda Fixa \$ 21.370.208,50 90,76%
7º I c - ETF 100% Títulos TN	100,00%	0,00	23.546.258,92	0,00%	50,00%	100,00%	23.546.258,92	Renda Variável \$ 832.263,47 3,53%
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	1.787.609,87	14.694.771,37	0,00%	5,00%	60,00%	12.340.145,48	Estruturados \$ 487.885,81 2,07%
8º I - Fundos de Ações	40,00%	832.263,47	8.586.240,10	0,00%	28,00%	30,00%	6.231.614,21	Exterior \$ 855.901,14 3,63%
8º II - ETF de Ações	40,00%	0,00	9.418.503,57	0,00%	1,00%	30,00%	7.063.877,68	
9º III - Ações - BDR Nivel I	10,00%	855.901,14	1.498.724,75	0,00%	10,00%	10,00%	1.498.724,75	
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	487.885,81	1.866.740,08	0,00%	0,00%	0,00%	-487.885,81	
11º - Fundos Imobiliários	10,00%	0,00	2.354.625,89	0,00%	1,00%	5,00%	1.177.312,95	

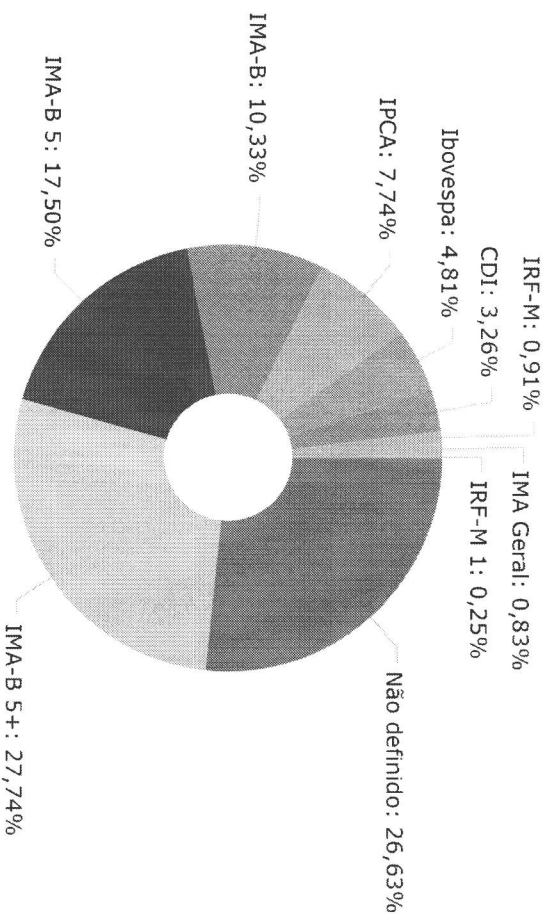
*[Handwritten signatures and initials]*

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var - Mês	Volatilidade - Mês
<b>NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)</b>								
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-1,91	3,70	5,98	-12,15	-7,44	-5,78	6,20	13,06
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,89	4,23	7,78	-6,83	5,74	4,99	5,60	11,80
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-2,18	-7,36	-2,22	-0,12	19,95	49,66	10,43	21,96
BB AGRO FIC AÇÕES	-0,50	-0,24	7,00	2,55	11,19	6,24	6,24	13,14
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16	1,17	1,88	4,11	6,26	13,10	1,13	2,38
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	-7,12	-16,17	-14,74	-6,50	-0,12	68,54	13,05	27,49
<b>CDI (BENCHMARK)</b>								
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	0,02	0,03
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,68	1,33	2,01	3,29	4,51	5,83	0,02	0,03
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,00	1,73	3,10	2,94	3,80	4,76	0,76	1,60
BB PERFL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,94	2,27	3,45	3,11	4,87	8,71	0,61	1,29
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80	1,59	2,40	4,02	6,01	8,16	0,02	0,05
IBOVESPA (BENCHMARK)	0,88	1,68	2,47	4,06	5,80	7,96	0,06	0,13
<b>BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NIVEL I</b>								
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	12,70	26,75
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-6,33	-13,43	-13,54	-26,97	-22,57	-4,63	6,00	12,63
BB IMA-GERAL (BENCHMARK)	-0,34	6,13	9,91	-1,26	10,01	20,93	6,00	12,63
<b>CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA</b>								
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	0,83	1,75
BB IMA-B (BENCHMARK)	0,67	0,75	1,67	2,06	2,29	4,60	0,83	1,75
<b>CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA</b>								
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	4,58	9,65
BB IMA-B (BENCHMARK)	-1,47	-1,50	-0,67	1,47	0,33	0,88	1,77	3,73
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53	-0,24	-0,04	0,58	0,65	3,56	1,77	3,73
BB IMA-B (BENCHMARK)	1,06	1,18	1,97	4,27	6,32	12,94		

*[Handwritten signature]*

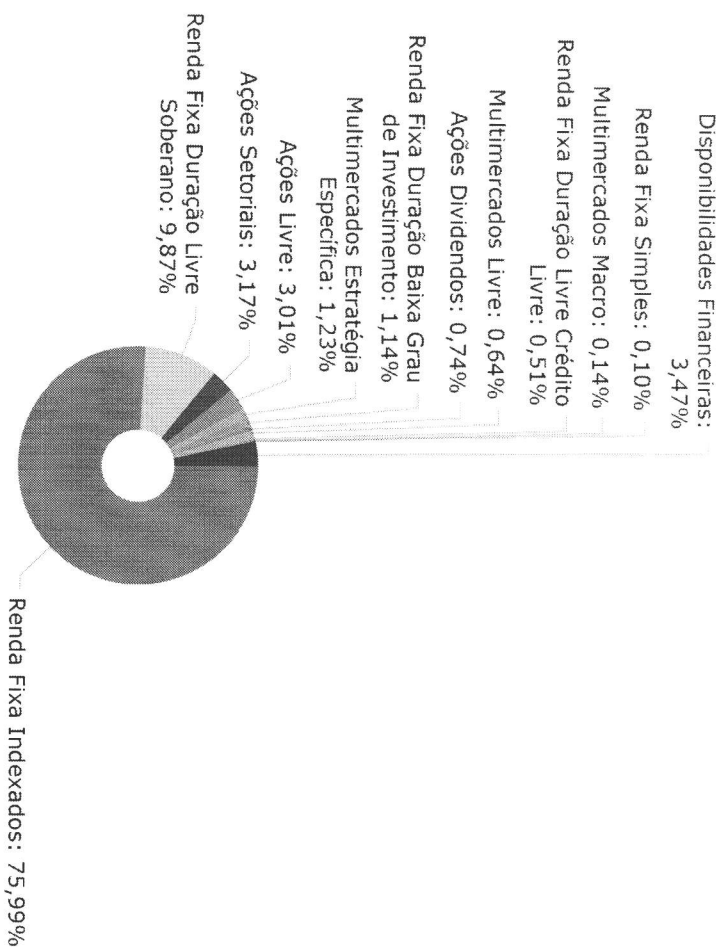
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05	1,14	1,92	4,15	6,07	12,36	1,06	2,24
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,05	1,13	1,90	4,10	6,00	12,29	1,07	2,25
<b>IMA-B 5+ (BENCHMARK)</b>	<b>0,01</b>	<b>-1,60</b>	<b>-1,93</b>	<b>-2,75</b>	<b>-4,24</b>	<b>-3,33</b>		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02	-1,60	-1,93	-2,98	-4,67	-3,94	2,65	5,59
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,02	-1,65	-1,97	-2,92	-4,52	-4,01	2,67	5,62
<b>IPCA (BENCHMARK)</b>	<b>1,01</b>	<b>1,56</b>	<b>2,30</b>	<b>5,77</b>	<b>10,54</b>	<b>16,29</b>		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38	1,47	2,03	4,19	6,58	13,51	0,75	1,57
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67	0,86	1,63	2,38	2,83		0,60	1,27
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,93	1,46	2,33	4,51	5,85	8,44	0,45	0,96
<b>IRF-M (BENCHMARK)</b>	<b>0,58</b>	<b>0,50</b>	<b>2,40</b>	<b>1,16</b>	<b>0,48</b>	<b>3,51</b>		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57	0,44	2,32	1,00	0,13	2,89	1,22	2,58
<b>IRF-M 1 (BENCHMARK)</b>	<b>0,74</b>	<b>1,38</b>	<b>2,27</b>	<b>2,93</b>	<b>4,26</b>	<b>7,47</b>		
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74	1,36	2,21	2,84	4,00	6,81	0,32	0,67

*[Handwritten signatures and initials]*



■ Não definido	6.496.961,96
■ IMA-B 5+	6.766.778,65
■ IMA-B 5	4.269.153,07
■ IMA-B	2.520.249,63
■ IPCA	1.887.105,44
■ Ibovespa	1.172.443,86
■ CDI	794.303,84
■ IRF-M	222.786,70
■ IMA Geral	202.816,59
■ IRF-M 1	60.835,90

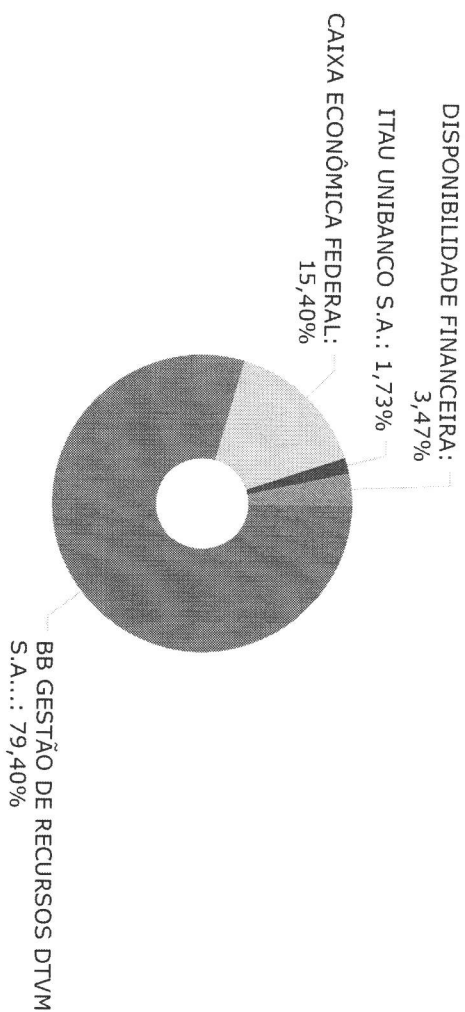
*[Handwritten signatures and initials]*



Renda Fixa Indexados	18.536.106,13
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.408.387,62
Ações Setoriais	772.653,69
Ações Livre	734.381,40
Multimercados Estratégia Específica	299.086,40
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	277.063,23
Ações Dividendos	181.129,52
Multimercados Livre	155.126,53
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	123.484,15
Multimercados Macro	33.672,88
Renda Fixa Simples	25.167,37
Disponibilidades Financeiras	847.176,72

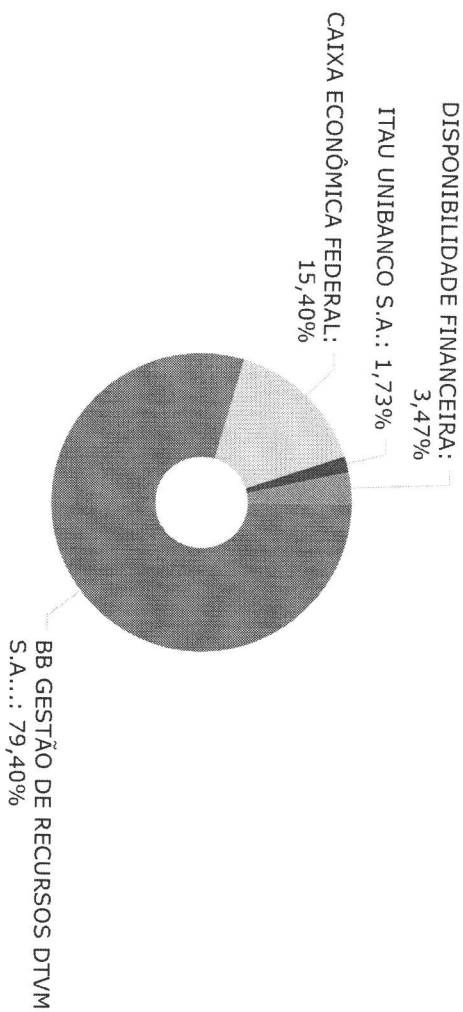
*[Handwritten signatures and initials]*





BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	19.367.955,91
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.755.732,46
ITAU UNIBANCO S.A.	422.570,55
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	847.176,72

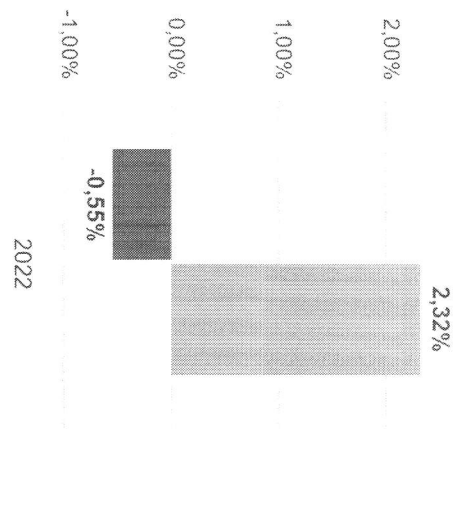
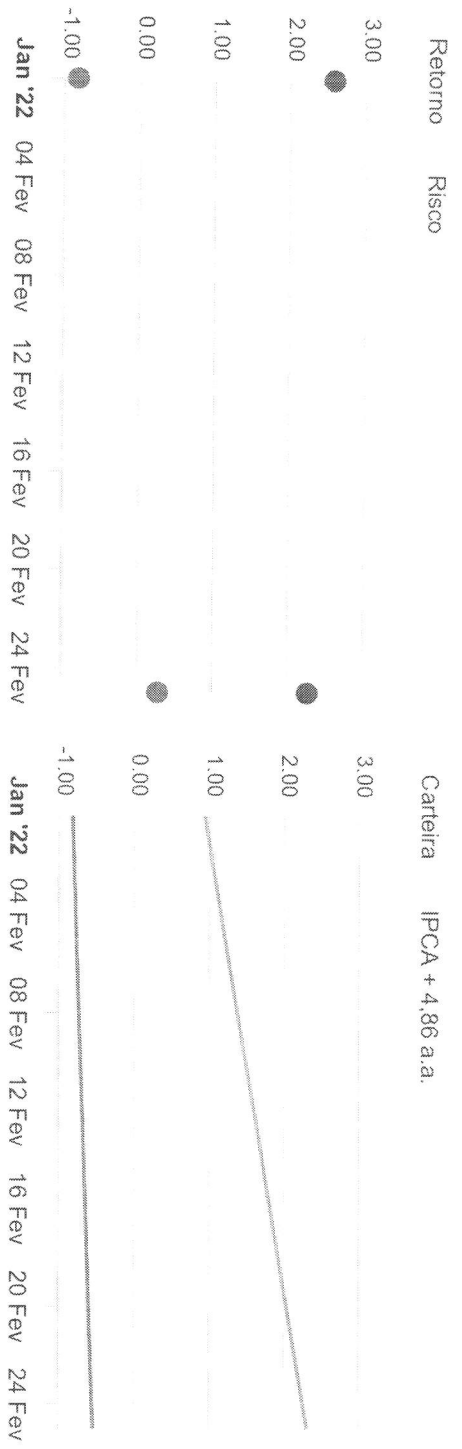
*[Handwritten signatures and initials]*



■	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	19.367.955,91
■	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.755.732,46
■	ITAU UNIBANCO S.A.	422.570,55
■	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	847.176,72

*Handwritten signatures and initials:*  
 - Top signature: *[Signature]*  
 - Middle signature: *[Signature]*  
 - Bottom signature: *[Signature]*  
 - Initials: *[Initials]*

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	19.085.989,46	0,00	0,00	18.937.400,66	-158.588,80	-0,83%	0,94%	2,58%
Fevereiro	18.937.400,66	759.194,43	8.741,53	19.743.913,44	56.059,88	0,28%	1,37%	2,27%
<b>Acumulado</b>					<b>-102.528,92</b>	<b>-0,55%</b>	<b>2,32%</b>	




RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VAR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.051.586,51	0,00	0,00	1.058.621,29	7.034,78	0,67% ▲	0,60%
BB FLUXO FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.997,96	0,00	0,00	25.167,37	169,41	0,68% ▲	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.647.048,92	134.177,54	0,00	4.834.978,09	53.751,63	1,12% ▲	1,13%
BB IMA-B 5 FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.997.446,46	0,00	0,00	3.029.050,38	31.603,92	1,05% ▲	1,07%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.149.128,61	0,00	0,00	5.148.053,50	-1.075,11	-0,02% ▼	2,67%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.167.193,59	0,00	0,00	2.178.757,13	11.563,54	0,53% ▲	1,77%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	201.463,01	0,00	0,00	202.816,59	1.353,58	0,67% ▲	0,83%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.390,72	0,00	0,00	60.835,90	445,18	0,74% ▲	0,32%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	221.528,64	0,00	0,00	222.786,70	1.258,06	0,57% ▲	1,22%
BB PERFIL FIG RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	274.868,90	0,00	0,00	277.063,23	2.194,33	0,80% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.227.205,68	0,00	0,00	1.240.102,69	12.897,01	1,05% ▲	1,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.618.382,93	0,00	0,00	1.618.725,15	342,22	0,02% ▲	2,65%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	300.637,01	0,00	0,00	303.273,83	2.636,82	0,88% ▲	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIG RENDA FIXA	122.348,11	0,00	0,00	123.484,15	1.136,04	0,93% ▲	0,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	705.000,00	0,00	705.000,00	0,00	0,00%	0,75%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	349.016,89	8.741,53	341.492,50	1.217,14	0,35% ▲	4,58%
	20.064.227,05	1.188.194,43	8.741,53	21.370.208,50	126.528,55	0,60%	1,65%

*[Handwritten signatures and initials]*

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AGRO FIC AÇÕES	82.868,69	0,00	0,00	82.452,94	-415,75	-0,50% ▼	6,24%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	153.596,12	0,00	0,00	155.126,53	1.530,41	1,00% ▲	0,76%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	184.626,30	0,00	0,00	181.129,52	-3.496,78	-1,89% ▼	5,60%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	33.359,61	0,00	0,00	33.672,88	313,27	0,94% ▲	0,61%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	401.140,21	0,00	0,00	399.790,17	-1.350,04	-0,34% ▼	6,00%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	171.164,47	0,00	0,00	168.890,84	-2.273,63	-1,33% ▼	6,20%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	305.763,36	0,00	0,00	299.086,40	-6.676,96	-2,18% ▼	10,43%
	1.332.518,76	0,00	0,00	1.320.149,28	-12.369,48	-0,93%	6,24%

*Handwritten signatures and initials:*  
  
  
  


INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NIVEL I	824.908,62	0,00	0,00	772.653,69	-52.254,93	-6,33% ▼	12,70%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	89.625,97	0,00	0,00	83.247,45	-6.378,52	-7,12% ▼	13,05%
	914.534,59	0,00	0,00	855.901,14	-58.633,45	-6,41%	12,73%

*com*  
*[Handwritten signatures]*