



PARECER Nº 05/2022 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 08/2022 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 06 de maio 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 abril de 2022.

Elaine Aparecida Correia Lopes
DAFIN

Daniel Cassiano Miranda
ASTECOIN

Mônica Souza dos Santos Costa
SUPREV

Martha Paço
Secretaria de Administração
Mat. 9950469

2022

Relatório Mensal

Abril

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria NPS 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	5.207.810,33	20,27%	9.105.588,612,53	0,06%	7º Ib
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.154.621,56	12,28%	6.683.332,099,62	0,05%	7º Ib
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.547.448,53	21,59%	798.675,926,28	0,69%	7º Ib
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.262.370,53	8,80%	6.560.550,656,04	0,03%	7º Ib
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	206.967,13	0,81%	210.810,927,62	0,10%	7º Ib
BB IR-FM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	61.792,81	0,24%	4.963.381,608,10	0,00%	7º Ib
BB IR-FM TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	224.435,75	0,87%	3.917.681,897,90	0,01%	7º Ib
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.655.895,45	6,44%	2.006.763,440,73	0,08%	7º Ib
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	364.945,25	1,38%	1.805.286,612,95	0,02%	7º Ib
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.291.714,02	5,03%	11.887.667,806,21	0,01%	7º Ib
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.676.634,95	6,52%	1.252.857,658,57	0,13%	7º Ib
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	308.230,67	1,20%	14.758,991,126,98	0,00%	7º Ib
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.079.629,90	4,20%	3.852.860,598,25	0,03%	7º III a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.561,55	0,10%	3.457.499,653,78	0,00%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	281.920,78	1,10%	9.511.719,590,81	0,00%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	125.890,25	0,49%	2.728,342,512,21	0,00%	7º III a
BB AGRO FIC AÇÕES	85.478,54	0,33%	473,089,338,97	0,02%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	185.528,59	0,72%	338,617,365,19	0,05%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	386.327,14	1,50%	1.416,485,258,71	0,03%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	163.711,35	0,64%	762,716,959,35	0,02%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	710.472,01	2,76%	521,646,703,52	0,14%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	221.993,45	0,86%	2.463,741,029,36	0,01%	9º III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	158.501,82	0,62%	119,327,370,05	0,13%	10º I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	34.501,35	0,13%	2.395,763,969,32	0,00%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	285.813,37	1,11%	1.839,221,480,88	0,02%	10º I

Investimentos

\$ 25.698.197,08

Disponibilidades Financeiras

\$ 766.457,50

Total Carteira

\$ 26.464.654,58

Governança (Pró Gestão)

5º NÍVEL 2 29/09/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre	Política de Investimentos			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	0,00%	25.698.197,08	0,00%	10,00%	100,00%	25.698.197,08
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	85,43%	3.745.330,10	0,00%	30,00%	100,00%	3.745.330,10
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	5,86%	16.475.735,48	0,00%	20,00%	60,00%	13.905.915,77
8º I - Fundos de Ações	40,00%	3,15%	821.045,62	0,00%	25,00%	30,00%	6.888.413,50
9º III - Ações - BDR Nivel I	10,00%	3,63%	932.465,46	0,00%	10,00%	10,00%	1.637.354,25
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	1,86%	478.816,54	0,00%	5,00%	10,00%	2.091.003,17

Governança (Pró Gestão)

29/09/2024

Renda Fixa

\$ 23.465.869,46 91,31%

Renda Variavel

\$ 821.045,62 3,19%

Estruturados

\$ 478.816,54 1,86%

Exterior

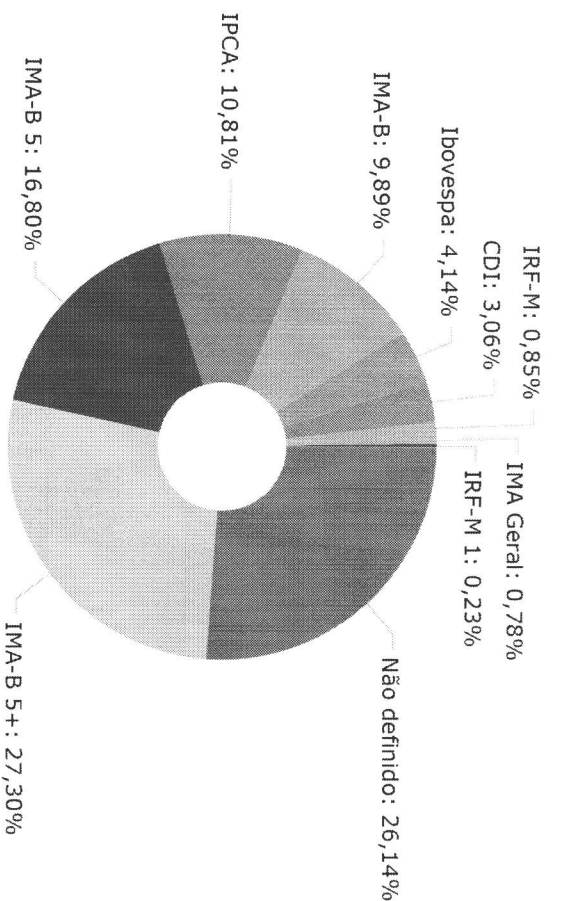
\$ 932.465,46 3,63%

Handwritten signatures and initials

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR - Mes	Volatilidade - Mes
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-8,62	-11,47	-6,52	-7,03	4,32	50,26	0,66	1,39
BB AGRO FIC AÇÕES	-3,74	3,45	3,15	8,63	3,96	3,96	5,43	11,43
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48	5,36	5,35	8,68	9,34	19,39	0,98	2,06
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,82	-25,10	-17,01	-24,50	-14,24	22,16	27,53	57,98
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-7,78	1,12	-4,35	0,88	-15,37	19,86	6,12	12,90
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-5,22	6,76	0,49	7,92	-3,67	42,66	4,60	9,69
CDI (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38		
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75	3,34	2,53	4,76	7,23	9,00	0,02	0,04
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,73	2,92	2,25	4,13	5,92	7,01	0,01	0,01
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,61	3,95	3,19	6,01	5,94	8,91	0,36	0,76
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,17	4,79	3,42	5,51	6,80	11,74	1,78	3,75
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78	3,37	2,57	4,85	7,39	9,81	0,01	0,01
IBOVESPA (BENCHMARK)								
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00		
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-11,37	-20,40	-13,87	-23,24	-31,61	-0,40	21,06	44,35
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-8,02	2,55	-3,69	4,62	-4,64	51,51	4,01	8,45
IMA GERAL (BENCHMARK)								
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54	3,09	2,88	5,86	4,95	9,79		
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48	2,81	2,73	5,63	4,37	8,06	0,50	1,06
IMA-B (BENCHMARK)								
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83	3,73	4,49	7,56	4,69	14,81		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80	3,59	4,39	7,37	4,34	14,13	0,79	1,66
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,25	2,38	2,41	6,04	2,69	7,01	0,97	2,04
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
IMA-B 5 (BENCHMARK)	1,56	5,43	5,31	8,92	9,45	19,21		

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var - Mes	Volatilidade - Mes
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.54	5.35	5.26	8.78	9.20	18.62	0.87	1.83
BB IMA-B 5 FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.53	5.32	5.24	8.75	9.09	18.51	0.89	1.88
IMA-B 5+ (BENCHMARK)	0,08	1,99	3,65	6,19	-0,03	10,27		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05	1,92	3,60	6,00	-0,51	9,55	0,74	1,55
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04	1,86	3,55	6,03	-0,40	9,46	0,81	1,70
IPCA (BENCHMARK)	1,06	4,30	3,73	6,05	12,13	19,71		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,23	6,24	6,14	9,06	10,09	20,14	0,62	1,30
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62	2,86	2,67	5,24	4,49	9,44	0,37	0,78
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIG RENDA FIXA	0,78	3,43	2,90	6,04	7,64	9,81	0,10	0,22
IRF-M (BENCHMARK)	-0,12	1,23	1,31	4,98	1,22	3,18		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,10	1,18	1,31	4,94	0,92	2,67	0,90	1,90
IRF-M 1 (BENCHMARK)	0,75	3,04	2,40	4,77	5,63	8,09		
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70	2,95	2,32	4,62	5,36	7,41	0,02	0,03

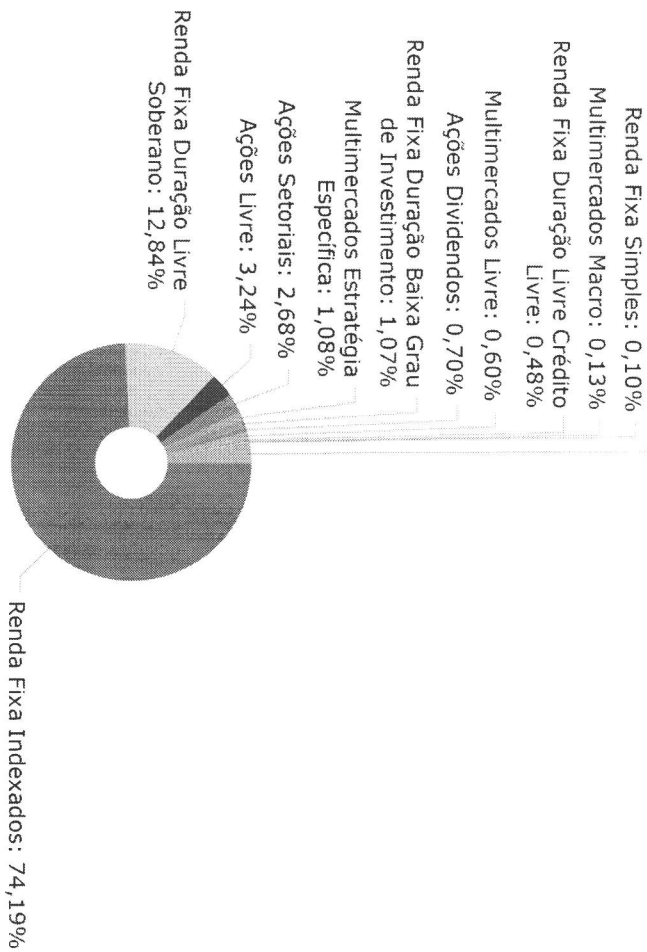
[Handwritten signatures and initials]



■ Não definido	6.916.793,13
▨ IMA-B 5+	7.224.083,48
■ IMA-B 5	4.446.335,58
▨ IPCA	2.861.415,60
▨ IMA-B	2.617.315,78
▨ Ibovespa	1.096.799,15
▨ CDI	808.716,17
▨ IRF-M	224.435,75
▨ IMA Geral	206.967,13
■ IRF-M 1	61.792,81

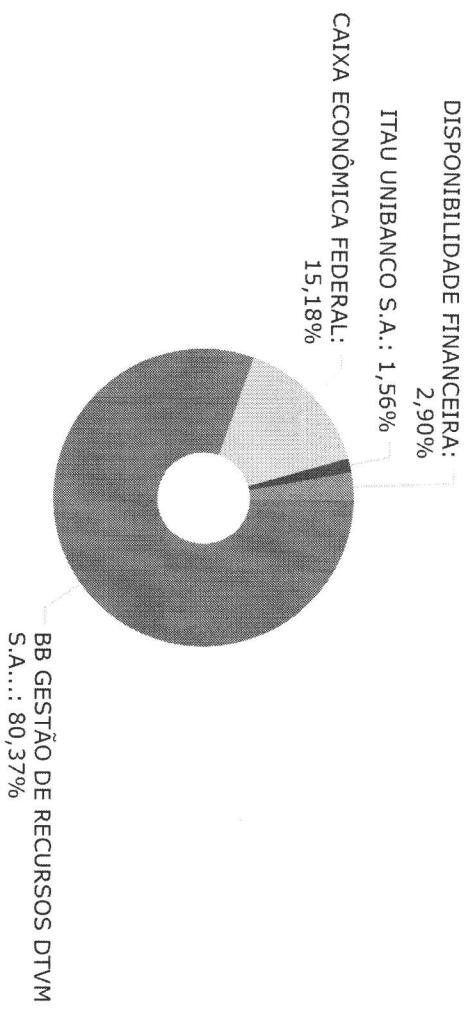
Handwritten signatures and initials:
 [Signature] [Signature] [Signature] [Signature]

Disponibilidades Financeiras:
2,90%

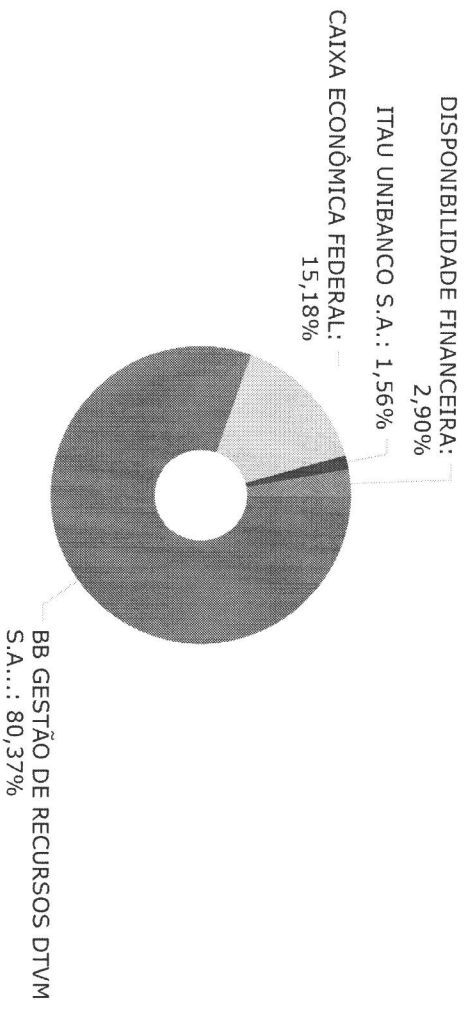


Renda Fixa Indexados	19.633.795,61
Renda Fixa Duração Livre Soberano	3.398.701,27
Agções Livre	857.510,48
Agções Setoriais	710.472,01
Multimercados Estratégia Específica	285.813,37
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	281.920,78
Agções Dividendos	185.528,59
Multimercados Livre	158.501,82
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	125.890,25
Multimercados Macro	34.501,35
Renda Fixa Simples	25.561,55
Disponibilidades Financeiras	766.457,50

[Handwritten signatures and initials]

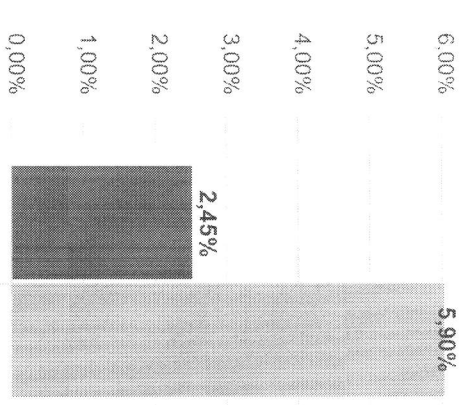
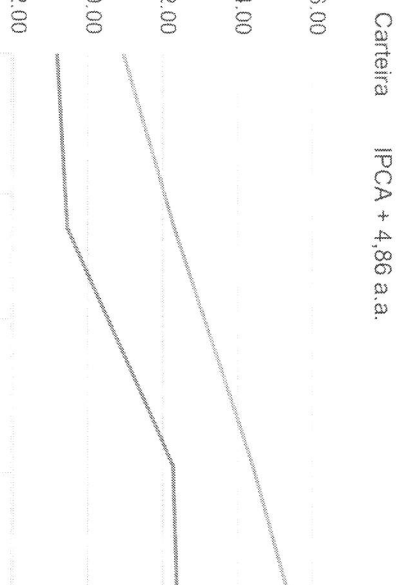
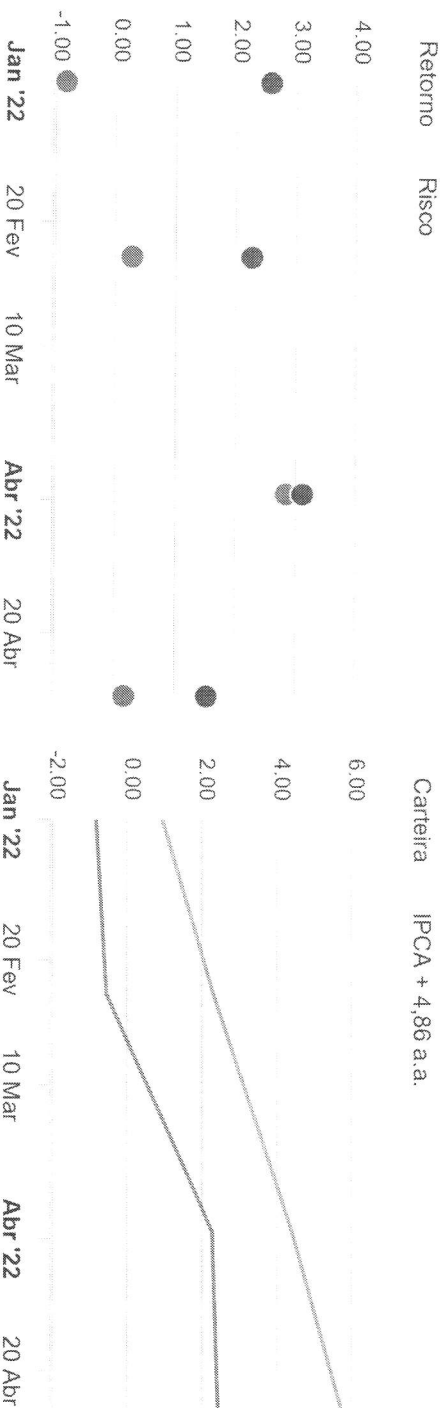


BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	21.269.263,77
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.017.229,69
ITAU UNIBANCO S.A.	411.703,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	766.457,50



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	21.269.263,77
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.017.229,69
ITAU UNIBANCO S.A.	411.703,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	766.457,50

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	19.044.908,88	0,00	0,00	18.885.947,01	-158.961,87	-0,83% ▼	0,94%	2,58%
Fevereiro	18.885.947,01	759.194,43	8.741,53	19.691.947,11	55.547,20	0,28% ▲	1,37%	2,27%
Março	19.691.947,11	456.698,63	0,00	20.723.625,96	574.980,22	2,85% ▲	2,04%	3,12%
Abril	20.723.625,96	644.004,53	0,00	21.403.183,69	35.553,20	0,17% ▲	1,42%	1,54%
Acumulado					507.118,75	2,45% ▲	5,90%	



Handwritten signatures and initials, including a large signature and several smaller ones.

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - Var
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.073.029,10	0,00	0,00	1.079.629,90	6.600,80	0,62% ▲	0,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.376,97	0,00	0,00	25.561,55	184,58	0,73% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.131.662,37	0,00	0,00	5.207.810,33	76.147,96	1,48% ▲	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.107.160,25	0,00	0,00	3.154.621,56	47.461,31	1,53% ▲	0,89%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.436.075,73	109.004,53	0,00	5.547.448,53	2.368,27	0,04% ▲	0,81%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.244.333,91	0,00	0,00	2.262.370,53	18.036,62	0,80% ▲	0,79%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	205.972,63	0,00	0,00	206.967,13	994,50	0,48% ▲	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	61.363,47	0,00	0,00	61.792,81	429,34	0,70% ▲	0,02%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	224.667,78	0,00	0,00	224.435,75	-232,03	-0,10% ▼	0,90%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	279.732,94	0,00	0,00	281.920,78	2.187,84	0,78% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.072.004,14	560.000,00	0,00	1.655.895,45	23.891,31	1,46% ▲	0,62%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	350.571,45	0,00	0,00	354.945,25	4.373,80	1,25% ▲	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.272.175,94	0,00	0,00	1.291.714,02	19.538,08	1,54% ▲	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.675.868,10	0,00	0,00	1.676.634,95	766,85	0,05% ▲	0,74%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	305.945,65	0,00	0,00	308.230,67	2.285,02	0,75% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	124.920,59	0,00	0,00	125.890,25	969,66	0,78% ▲	0,10%
	22.590.861,02	669.004,53	0,00	23.465.869,46	206.003,91	0,89%	0,80%

[Handwritten signatures and initials]

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VAR
BB AGRO FIC AÇÕES	88.801,89	0,00	0,00	85.478,54	-3.323,35	-3,74% ▼	5,43%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	157.536,46	0,00	0,00	158.501,82	965,36	0,61% ▲	0,36%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	195.736,56	0,00	0,00	185.528,59	-10.207,97	-5,22% ▼	4,60%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	34.100,88	0,00	0,00	34.501,35	400,47	1,17% ▲	1,78%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	420.031,65	0,00	0,00	386.327,14	-33.704,51	-8,02% ▼	4,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	177.518,46	0,00	0,00	163.711,35	-13.807,11	-7,78% ▼	6,12%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	312.789,42	0,00	0,00	285.813,37	-26.976,05	-8,62% ▼	0,66%
	1.386.515,32	0,00	0,00	1.299.862,16	-86.653,16	-6,25%	3,21%


 goon


INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NIVEL I		801.638,04	0,00	0,00	710.472,01	-91.166,03	-11,37% ▼	21,06%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I		79.824,48	155.000,00	0,00	221.993,45	-12.831,03	-5,46% ▼	27,53%
		881.462,52	155.000,00	0,00	932.465,46	-103.997,06	-10,03%	16,05%

