



PARECER Nº 06/2022 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 10/2022 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 07 de junho 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 maio de 2022.

Elaine Aparecida Correia Lopes
DAFIN

Daniel Cassiano Miranda
ASTECOIN

Mônica Souza dos Santos Costa
SUPREV

Martha Pinão
Secretária de Administração
Mat. 9950469







2022

Relatório Mensal

Maio

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MPS nº 519 de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V, e com o Manual de Prática de Gestão RPPS versão 3.2, Item 3.2.6, aprovado pela Portaria SPREV nº 3030, de 15 de Março de 2021.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.248.170,74	19,63%	9.450.283.491,65	0,06%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.178.908,57	11,89%	6.992.058.203,56	0,05%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.719.622,64	21,40%	772.476.623,73	0,74%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.354.077,23	8,81%	6.293.749.685,70	0,04%	7º I b
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	208.794,99	0,78%	181.553.052,80	0,12%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	62.362,29	0,23%	5.107.140.425,93	0,00%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	225.728,11	0,84%	3.694.753.029,30	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.752.957,76	6,56%	2.293.984.372,74	0,08%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	550.000,00	2,06%	2.988.175.949,12	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	358.096,06	1,34%	2.159.396.684,37	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.301.590,98	4,87%	12.390.634.636,61	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.695.687,42	6,34%	1.260.228.114,42	0,13%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	311.540,23	1,17%	17.208.166.278,38	0,00%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.089.665,37	4,08%	3.819.723.058,42	0,03%	7º III a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.804,92	0,10%	3.180.026.553,36	0,00%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	284.926,55	1,07%	9.967.340.356,95	0,00%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	127.134,42	0,48%	2.722.459.745,02	0,00%	7º III a
BB AGRO FIC AÇÕES	118.133,67	0,44%	516.378.510,19	0,02%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	186.012,67	0,70%	332.619.950,88	0,06%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	400.547,30	1,50%	1.478.507.662,79	0,03%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	166.255,83	0,62%	739.660.073,43	0,02%	8º I
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NIVEL I	670.832,31	2,51%	476.171.374,82	0,14%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	212.143,62	0,79%	2.266.073.116,40	0,01%	9º III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	160.218,92	0,60%	117.644.020,41	0,14%	10º I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	34.772,67	0,13%	2.478.526.613,81	0,00%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	288.518,87	1,08%	1.578.611.795,86	0,02%	10º I

Investimentos

\$ 26.732.504,14

Disponibilidades Financeiras

\$ 714.048,82

Total Carteira

\$ 27.446.552,96

Governança (Pró Gestão)

29 NIVEL 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%	26.732.504,14	0,00%	10,00%	100,00%	26.732.504,14
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	85,92%	22.967.537,02	14,08%	3,764.967,12	0,00%	3.764.967,12
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	5,71%	1.527.531,26	64,29%	17.185.221,64	0,00%	14.511.971,22
8º I - Fundos de Ações	40,00%	3,26%	870.949,47	36,74%	9.822.052,19	0,00%	7.148.801,77
9º III - Ações - BDR Nivel I	10,00%	3,30%	882.975,93	6,70%	1.790.274,48	0,00%	1.790.274,48
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	1,81%	483.510,46	8,19%	2.189.739,95	0,00%	2.189.739,95

Governança (Pró Gestão)

21/2 NIVEL 2 29/09/2024

Renda Fixa

\$ 24.495.068,28 91,63%

Renda Variável

\$ 870.949,47 3,26%

Estruturados

\$ 483.510,46 1,81%

Exterior

\$ 882.975,93 3,30%

[Handwritten signatures and initials]

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mes	Volatilidade - Mes
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1,55	2,69	-0,98	4,94	-18,17	13,08	9,18	19,33
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,75		1,80				5,43	11,44
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,26	7,04	2,70	10,68	-9,77	35,44	8,57	18,05
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	0,95	-10,63	-3,53	-5,67	4,89	44,06	14,45	30,42
BB AGRO FIC AÇÕES	3,11	6,66	6,89	14,38	1,45		8,19	17,25
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77	6,17	4,95	6,92	9,45	17,95	1,16	2,45
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	-4,44	-28,42	-14,62	-27,20	-14,82	13,58	11,66	24,55
CDI (BENCHMARK)								
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	0,02	0,04
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07	4,47	2,84	5,31	8,23	10,70	0,02	0,04
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07	4,45	2,73	5,26	8,07	9,89	0,02	0,04
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,95	3,90	2,53	4,60	6,73	7,86	0,01	0,03
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,08	5,07	3,28	6,48	6,02	9,66	0,66	1,40
	0,79	5,61	3,27	6,83	6,77	11,60	1,00	2,10
IBOVESPA (BENCHMARK)								
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	8,77	18,47
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NIVEL I	3,68	6,33	0,19	10,12	-6,56	43,71	8,77	18,47
	-5,58	-24,84	-13,18	-24,93	-35,09	-4,83	14,53	30,60
IMA GERAL (BENCHMARK)								
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	0,98	2,06
	0,88	3,72	2,95	4,67	4,81	8,00	0,98	2,06
IMA-B (BENCHMARK)								
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	2,15	4,53
	0,96	4,58	4,83	4,80	4,24	13,52	2,15	4,53
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89	3,29	4,86	4,16	3,05	4,66	1,28	2,70

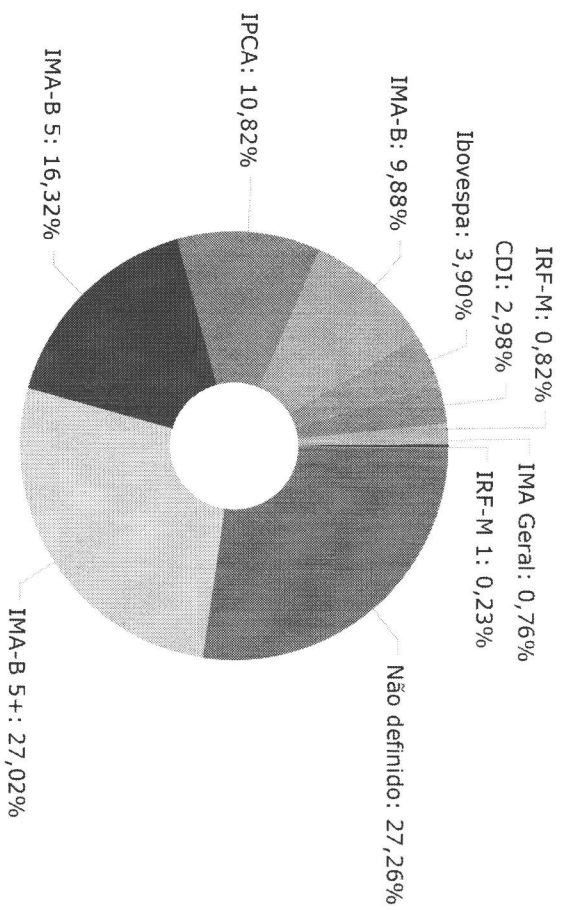
[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	1,03	2,16
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,77	6,14	4,95	6,94	9,18	16,95	1,04	2,18
IMA-B 5+ (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14	3,08	4,75	2,73	-0,76	9,69	3,60	7,59
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11	2,99	4,72	2,65	-0,64	9,58	3,57	7,51
IPCA (BENCHMARK)								
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,51	6,78	5,23	7,37	9,67	17,81	1,12	2,35
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93	3,82	2,93	4,61	4,84	9,18	0,80	1,69
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,99	4,45	2,96	5,35	8,41	10,30	0,11	0,24
IRF-M (BENCHMARK)								
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	1,85	3,19
IRF-M 1 (BENCHMARK)								
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	0,20	0,43

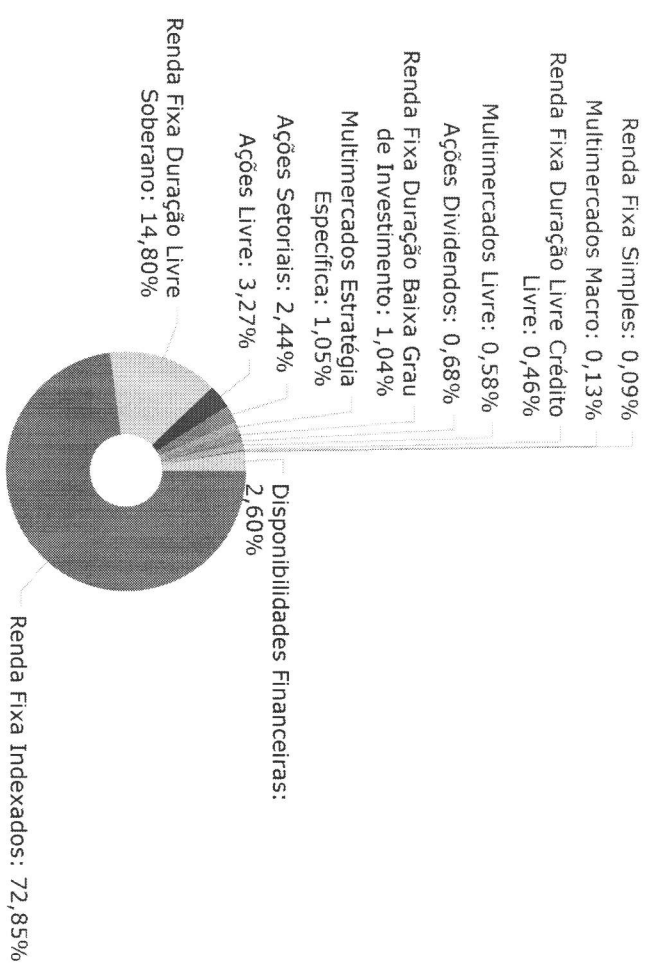




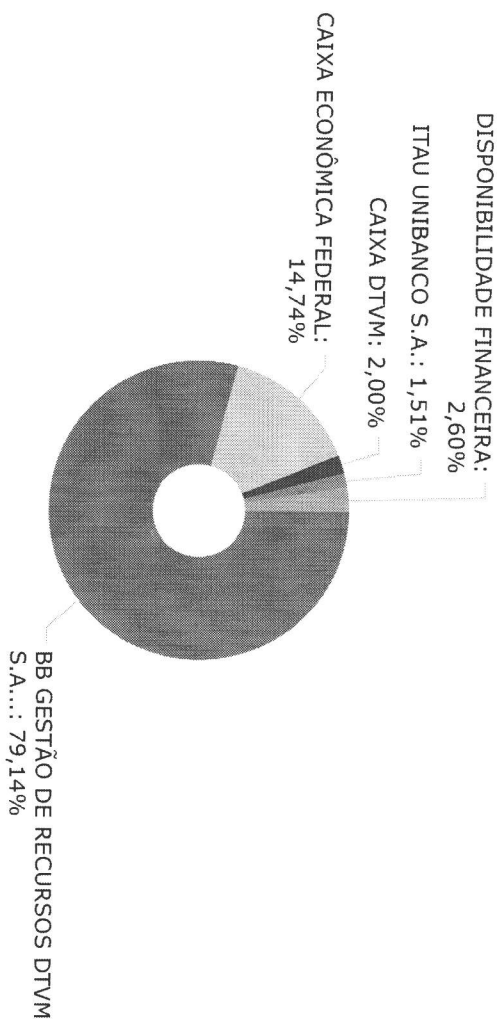
■ Não definido	7.483.284,22
▨ IMA-B 5+	7.415.310,06
■ IMA-B 5	4.480.499,55
▨ IPCA	2.969.757,55
▨ IMA-B	2.712.173,29
▨ Ibovespa	1.071.379,61
▨ CDI	817.263,29
▨ IRF-M	225.728,11
▨ IMA Geral	208.794,99
■ IRF-M 1	62.362,29

[Handwritten signatures and initials]



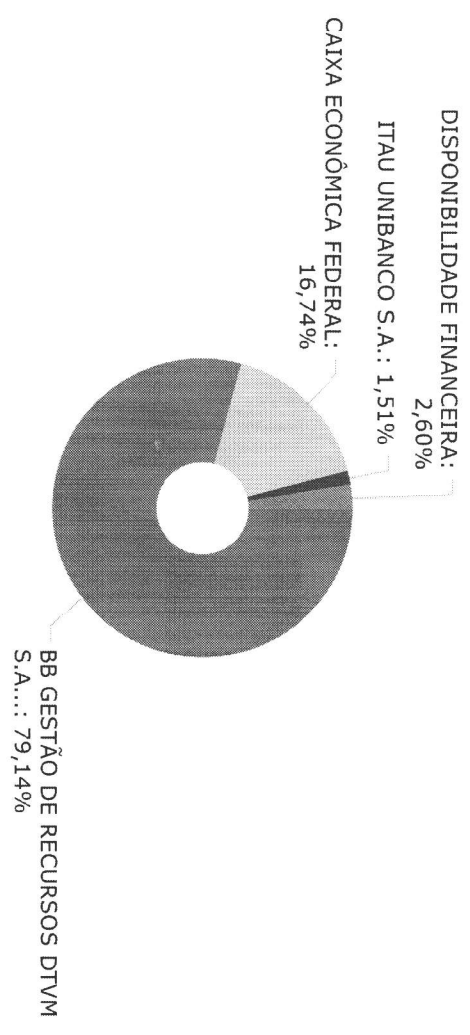
Renda Fixa Indexados	19.994.942,97
Renda Fixa Duração Livre Soberano	4.062.259,42
Ações Livre	897.080,42
Ações Setoriais	670.832,31
Multimercados Estratégia Específica	288.518,87
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	284.926,55
Ações Dividendos	186.012,67
Multimercados Livre	160.218,92
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	127.134,42
Multimercados Macro	34.772,67
Renda Fixa Simples	25.804,92
Disponibilidades Financeiras	714.048,82

[Handwritten signatures and initials]



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	21.721.536,71
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.045.314,14
CAIXA DTVM	550.000,00
ITAU UNIBANCO S.A.	415.653,29
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	714.048,82

[Handwritten signatures and initials]



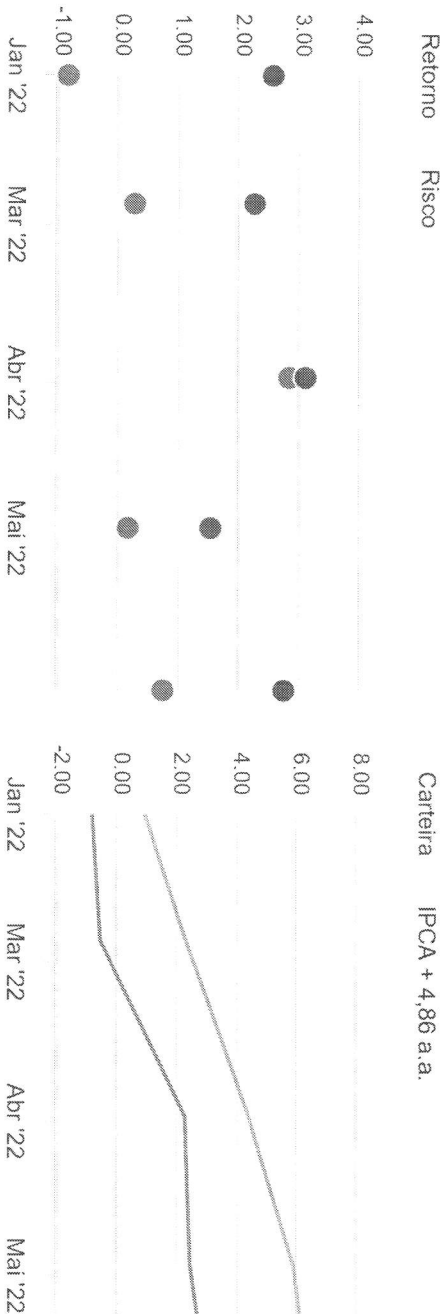
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... 21.721.536,71	
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.595.314,14
ITAU UNIBANCO S.A.	415.653,29
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	714.048,82

econ.

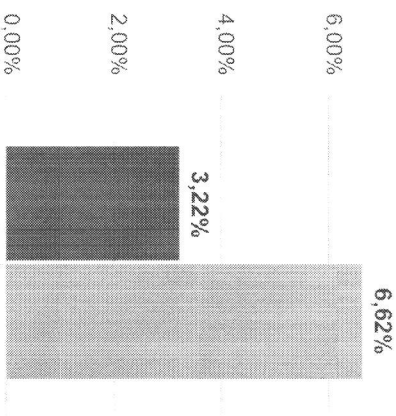
[Handwritten signatures]

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%
Mai	21.403.183,69	660.620,99	29.757,87	22.198.477,59	164.430,78	0,75% ▲	0,69%	2,76%

Acumulado 671.549,53 3,22% ▲ 6,62%



Carteira IPCA + 4,86 a.a.



[Handwritten signatures and initials]

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.079.629,90	0,00	0,00	1.089.665,37	10.035,47	0,93% ▲	0,80%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.561,55	0,00	0,00	25.804,92	243,37	0,95% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.207.810,33	0,00	0,00	5.248.170,74	40.360,41	0,77% ▲	1,16%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.154.621,56	0,00	0,00	3.178.908,57	24.287,01	0,77% ▲	1,04%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.547.448,53	110.620,99	0,00	5.719.622,64	61.553,12	1,09% ▲	3,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.262.370,53	70.000,00	0,00	2.354.077,23	21.706,70	0,93% ▲	2,15%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	206.967,13	0,00	0,00	208.794,99	1.827,86	0,88% ▲	0,98%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	61.792,81	0,00	0,00	62.362,29	569,48	0,92% ▲	0,20%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	224.435,75	0,00	0,00	225.728,11	1.292,36	0,58% ▲	1,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	281.920,78	0,00	0,00	284.926,55	3.005,77	1,07% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.655.895,45	135.000,00	46.613,45	1.752.957,76	8.675,76	0,48% ▲	1,12%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	354.945,25	0,00	0,00	358.096,06	3.150,81	0,89% ▲	1,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.291.714,02	0,00	0,00	1.301.590,98	9.876,96	0,76% ▲	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.676.634,95	0,00	0,00	1.695.687,42	19.052,47	1,14% ▲	3,60%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	308.230,67	0,00	0,00	311.540,23	3.309,56	1,07% ▲	0,02%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	125.890,25	0,00	0,00	127.134,42	1.244,17	0,99% ▲	0,11%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	550.000,00	0,00	550.000,00	0,00	0,00%	5,43%
	23.465.869,46	865.620,99	46.613,45	24.495.068,28	210.191,28	0,87%	2,01%

[Handwritten signatures and initials]

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - Var
BB AGRO FIC AÇÕES	85.478,54	30.000,00	0,00	118.133,67	2.655,13	2,30% ▲	8,19%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	158.501,82	0,00	0,00	160.218,92	1.717,10	1,08% ▲	0,66%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	185.528,59	0,00	0,00	186.012,67	484,08	0,26% ▲	8,57%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	34.501,35	0,00	0,00	34.772,67	271,32	0,79% ▲	1,00%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	386.327,14	0,00	0,00	400.547,30	14.220,16	3,68% ▲	8,77%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	163.711,35	0,00	0,00	166.255,83	2.544,48	1,55% ▲	9,18%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	285.813,37	0,00	0,00	288.518,87	2.705,50	0,95% ▲	14,45%
	1.299.862,16	30.000,00	0,00	1.354.459,93	24.597,77	1,85%	8,79%

[Handwritten signatures and initials]

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NIVEL I	710.472,01	0,00	0,00	670.832,31	-39.639,70	-5,58% ▼	14,53%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	221.993,45	0,00	0,00	212.143,62	-9.849,83	-4,44% ▼	11,66%
	932.465,46	0,00	0,00	882.975,93	-49.489,53	-5,31%	11,04%

[Handwritten signatures and initials]