



## PARECER Nº 08/2022 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 15/2022 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 05 de agosto 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 julho de 2022.

Elaine Aparecida Correia Lopes  
DAFIN

Mônica Souza dos Santos Costa  
SUPREV

Thayna Pacheco Coutinho  
DPP

Martha Paula  
Secretária de Administração  
Mat. 9980469

# 2022

## Relatório Mensal

# Julho

## 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 do Pró-Gestão RPPS versão 3.2, Item 3.2.6, aprovada pela Portaria SPREV nº 3030, de 15 de Março de 2021.



Handwritten signatures of the authors and reviewers of the report.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.250.512,74	18,97%	9.515.072.681,60	0,06%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.359.866,78	19,37%	6.564.821.510,69	0,08%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULO PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.551.519,24	20,06%	749.544.414,58	0,74%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.325.000,80	8,40%	5.189.856.068,29	0,04%	7º I b
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	110.199,70	0,40%	160.618.893,47	0,07%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	63.590,71	0,23%	4.977.668.769,91	0,00%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	229.054,11	0,83%	2.837.899.627,90	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.760.067,93	6,36%	3.068.003.584,32	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	552.198,93	2,00%	3.748.160.148,32	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	357.737,40	1,29%	2.597.816.482,92	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.306.202,90	4,72%	10.426.166.067,57	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.645.079,75	5,94%	1.156.132.227,79	0,14%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	317.945,43	1,15%	17.603.375.022,43	0,00%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	93.917,64	0,34%	3.323.314.760,57	0,00%	7º III a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.293,09	0,09%	3.157.315.937,43	0,00%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	290.832,39	1,05%	10.247.937.610,00	0,00%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	129.160,51	0,47%	2.528.329.321,30	0,01%	7º III a
BB AGRO FIC AÇÕES	105.668,42	0,38%	454.547.332,55	0,02%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	274.586,00	0,99%	301.366.693,21	0,09%	8º I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	363.553,75	1,31%	1.372.384.612,53	0,03%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	156.422,03	0,57%	662.923.806,58	0,02%	8º I
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NIVEL I	688.727,39	2,49%	464.904.422,68	0,15%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	230.747,97	0,83%	2.340.707.282,75	0,01%	9º III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	161.301,77	0,58%	119.066.875,94	0,14%	10º I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	34.974,44	0,13%	2.239.554.170,24	0,00%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	292.894,70	1,06%	1.437.147.092,41	0,02%	10º I

Investimentos

\$ 27.678.056,52

Disponibilidades Financeiras

\$ 1.507.021,36

Total Carteira

\$ 29.185.077,88

Governança (Pró Gestão)

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%	27.678.056,52	0,00%	10,00%	100,00%	27.678.056,52
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	24.828.976,42	10,29%	0,00%	30,00%	100,00%	2.849.080,10
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	540.203,63	68,05%	0,00%	20,00%	60,00%	16.066.630,28
8º I - Fundos de Ações	40,00%	900.230,20	36,75%	0,00%	25,00%	30,00%	7.403.186,76
9º III - Ações - BDR Nivel I	10,00%	919.475,36	6,68%	0,00%	10,00%	10,00%	1.848.330,29
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	489.170,91	8,23%	0,00%	5,00%	10,00%	2.278.634,74

Governança (Pró Gestão)

29/09/2024

Renda Fixa

\$ 25.369.180,05 91,66%

Renda Variável

\$ 900.230,20 3,25%

Estruturados

\$ 489.170,91 1,77%

Exterior

\$ 919.475,36 3,32%

**NÃO DEFINIDO - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,22	6,22	0,82	6,21	9,51	15,66	1,40	2,96
ITAU PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	10,09	-9,27	2,48	-4,21	1,10	36,82	8,94	18,83
BB AGRO FIC AÇÕES	3,28	-4,59	-7,77	-4,87	-5,32		7,37	15,53
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,88	-22,14	3,94	-13,74	-11,05	16,19	11,49	24,21
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3,73	-1,00	-7,27	-6,81	-12,91	9,10	6,30	13,26
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,11	-3,38	-4,45	-8,61	-20,44	-11,34	7,37	15,53
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,07		-2,36				0,76	1,61

**CDI - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)**

BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	0,01	0,03
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04	6,64	3,16	5,81	9,68	12,43	0,01	0,03
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02	6,60	3,15	5,76	9,53	11,70	0,02	0,03
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,95	5,87	2,86	5,18	8,24	9,65	0,00	0,01
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,64	6,22	1,37	4,84	7,36	10,51	0,89	1,87
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,65	5,78	1,77	5,02	6,86	9,09	0,84	1,78

**IBOVESPA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)**

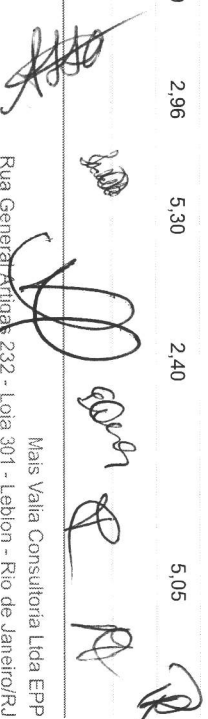
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4,05	-3,49	-5,89	-9,37	-12,06	8,74	7,97	16,78
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,38	-22,83	-3,06	-16,51	-35,91	-16,58	12,96	27,30

**IMA GERAL - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)**

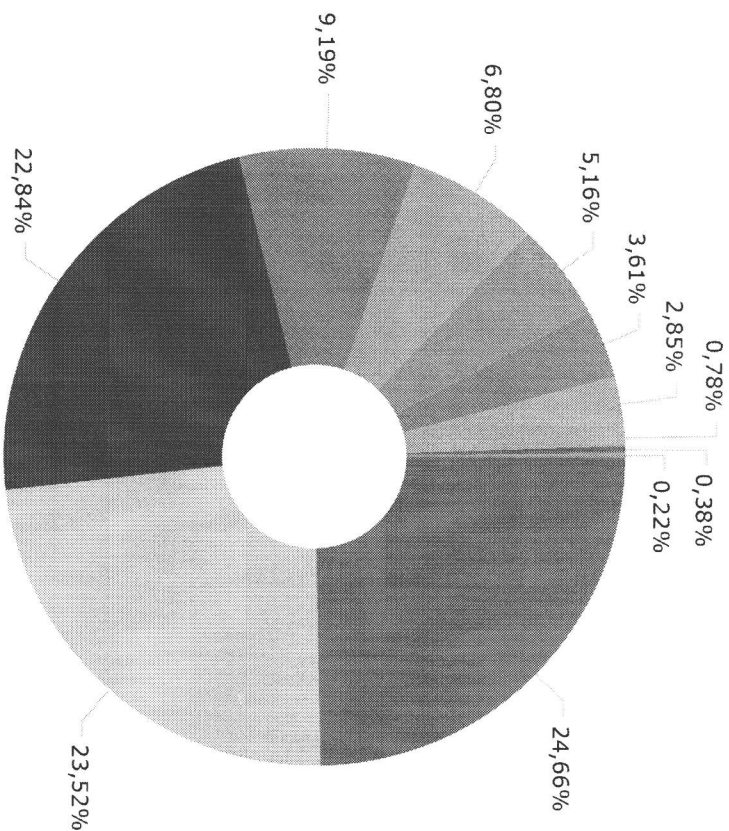
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47	4,98	1,83	4,76	5,95	7,72	1,03	2,18
---	------	------	------	------	------	------	------	------

**IMA-B - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)**

CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86	1,51	3,18
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,32	3,18	0,79	3,21	3,47	1,48	1,51	3,18
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89	3,29	-0,29	4,09	2,96	5,30	2,40	5,05

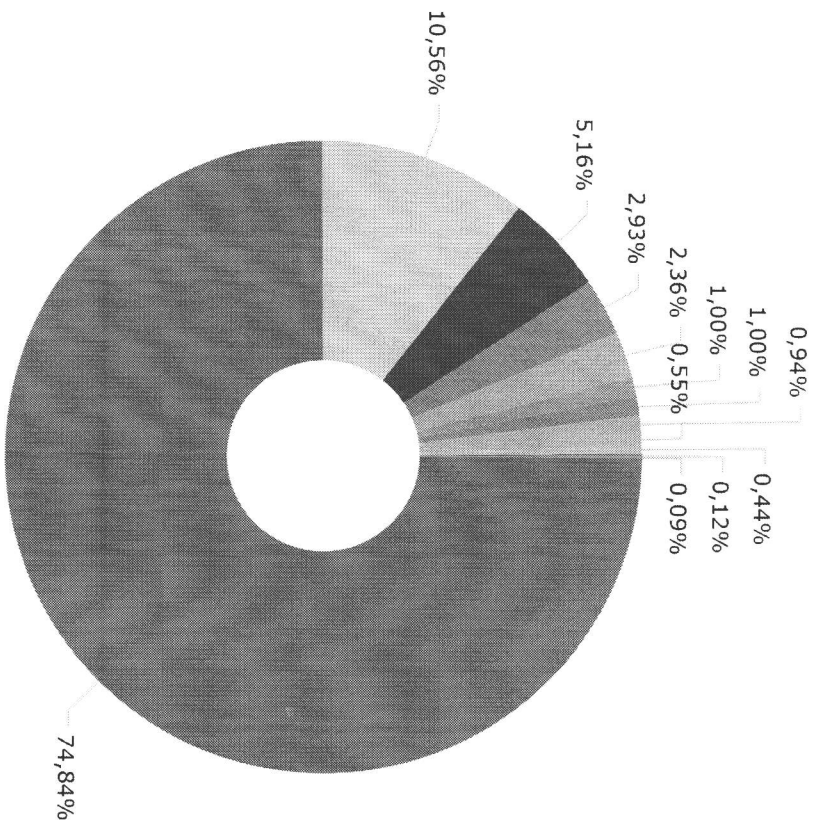


	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR - Mes	Volatilidade - Mes
<b>IMA-B 5 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61	1,21	2,55
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,02	6,53	1,12	6,44	9,84	15,08	1,22	2,56
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	6,47	1,09	6,39	9,71	14,96	1,22	2,56
<b>IMA-B 5+ - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89	3,92	8,26
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,86	-0,04	-1,86	1,62	-3,54	-3,55	3,99	8,41
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,91	0,00	-1,88	1,65	-3,73	-3,54	3,99	8,41
<b>IPCA - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09	5,58	1,23	5,01	10,92	20,90	0,76	1,61
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,08	7,21	0,92	7,11	10,41	15,65	0,36	0,76
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80	6,12	2,60	5,57	9,65	10,96	0,65	1,36
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64	4,97	2,04	4,77	6,06	7,29	0,65	1,36
<b>IRF-M - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15	3,36	2,11	3,45	3,42	1,97	1,48	3,11
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13	3,27	2,06	3,40	3,17	1,42	1,48	3,11
<b>IRF-M 1 - INDICADOR DE DESEMPENHO (CVM)</b>								
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26	0,25	0,53
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04	5,95	2,91	5,30	7,86	9,57	0,25	0,53



IMA-B 5+	7.196.598,99
Não definido	6.863.030,79
IMA-B 5	6.666.069,68
IMA-B	2.682.738,20
IPCA	1.983.146,08
Disponibilidades Financeiras	1.507.021,36
Ibovespa	1.052.281,14
CDI	831.347,12
IRF-M	229.054,11
IMA Geral	110.199,70
IRF-M 1	63.590,71

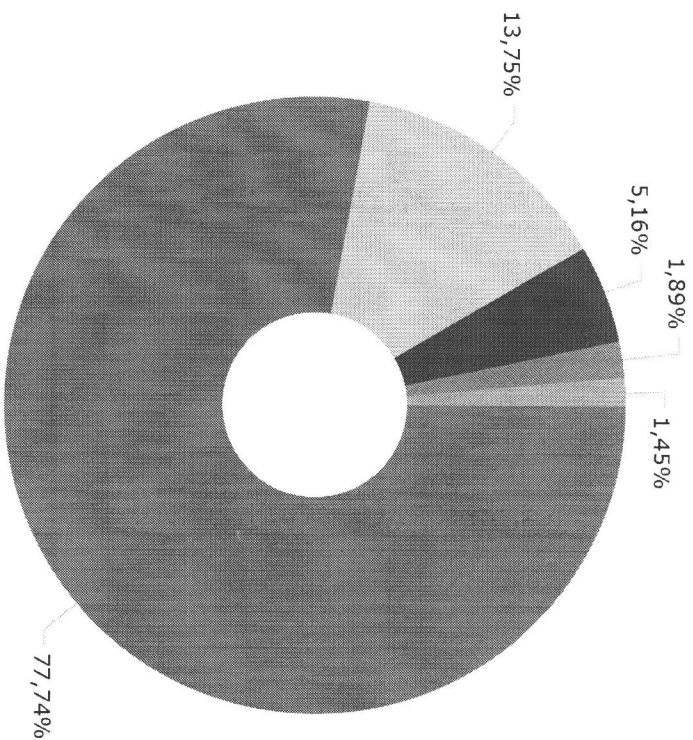
*[Handwritten signatures and initials]*



Renda Fixa Indexados	21.841.026,73
Renda Fixa Duração Livre Soberano	3.081.867,33
Disponibilidades Financeiras	1.507.021,36
Ações Livres	856.392,17
Ações Setoriais	688.727,39
Multimercados Estratégia Específica	292.894,70
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	290.832,39
Ações Dividendos	274.586,00
Multimercados Livres	161.301,77
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	129.160,51
Multimercados Macro	34.974,44
Renda Fixa Simples	26.293,09

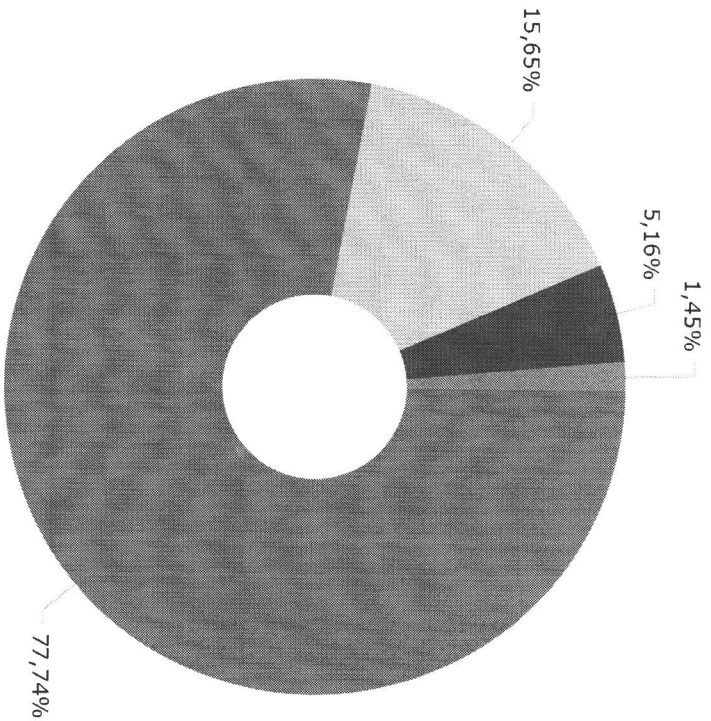
  
  
  



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	22.689.666,90
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.014.135,48
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.507.021,36
CAIXA DTVM	552.198,93
ITAU UNIBANCO S.A.	422.055,21

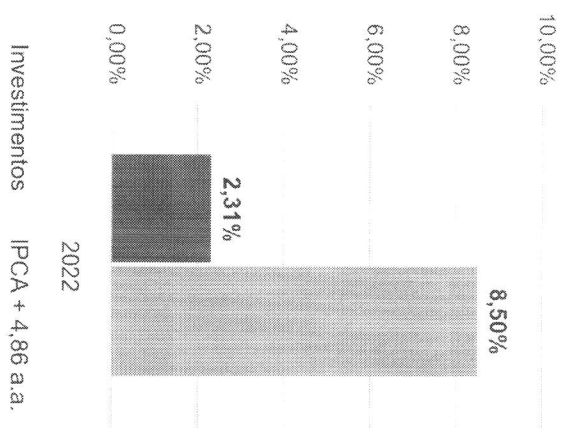
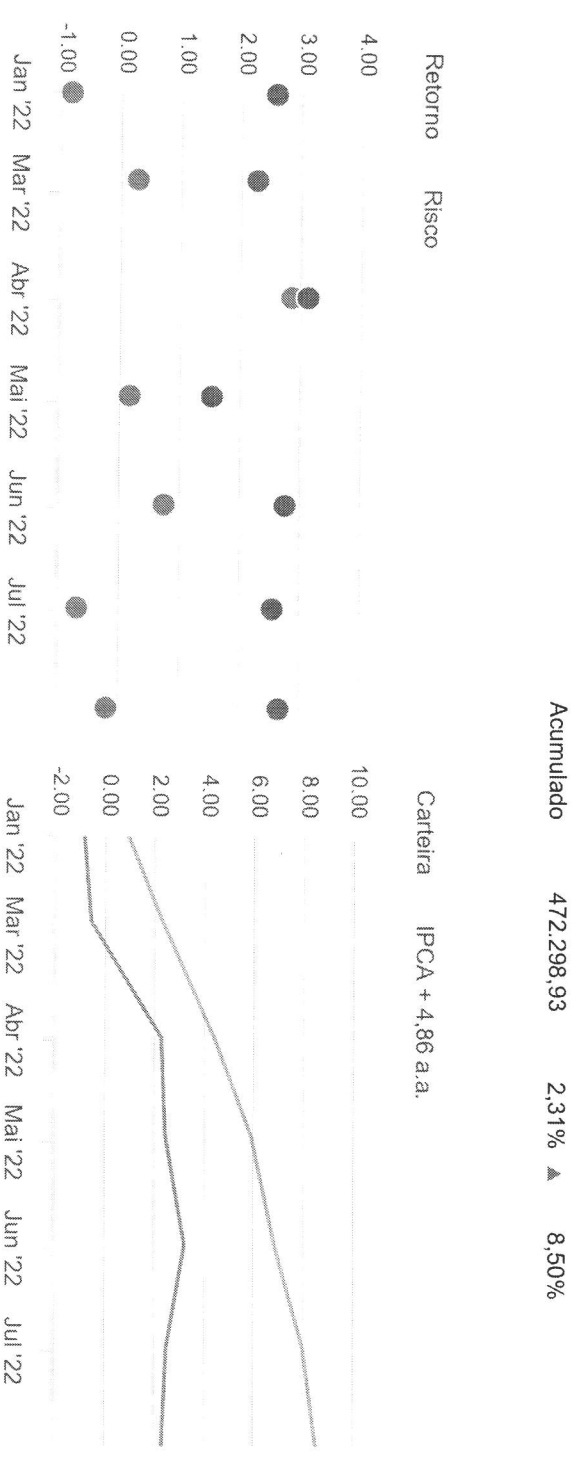
*[Handwritten signatures and initials]*



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	22.689.666,90
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.566.334,41
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.507.021,36
ITAU UNIBANCO S.A.	422.055,21

*[Handwritten signatures and initials]*

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%	0,89%	2,76%
Junho	22.198.477,59	811.612,37	700.000,00	22.155.818,61	-154.271,35	-0,69%	1,07%	2,56%
Julho	22.155.818,61	1.062.793,05	0,00	23.173.632,41	44.979,25	-0,19%	0,49%	2,67%
<b>Acumulado</b>				<b>472.298,93</b>	<b>2,31%</b>	<b>▲</b>	<b>8,50%</b>	



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		93.321,49	0,00	0,00	93.917,64	596,15	0,64% ▲	0,65%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		26.045,51	0,00	0,00	26.293,09	247,58	0,95% ▲	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		5.262.136,44	0,00	0,00	5.250.512,74	-11.623,70	-0,22% ▼	1,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		4.295.600,26	1.062.793,05	0,00	5.359.866,78	1.473,47	0,03% ▲	1,22%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		5.656.465,02	0,00	0,00	5.551.519,24	-104.945,78	-1,86% ▼	3,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		2.345.773,59	0,00	0,00	2.325.000,80	-20.772,79	-0,89% ▼	2,40%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		109.686,09	0,00	0,00	110.199,70	513,61	0,47% ▲	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		62.934,84	0,00	0,00	63.590,71	655,87	1,04% ▲	0,25%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		226.491,89	0,00	0,00	229.054,11	2.562,22	1,13% ▲	1,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP		287.849,65	0,00	0,00	290.832,39	2.982,74	1,04% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		1.758.699,03	0,00	0,00	1.760.067,93	1.368,90	0,08% ▲	0,76%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		551.787,47	0,00	0,00	552.198,93	411,46	0,07% ▲	0,76%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		358.888,94	0,00	0,00	357.737,40	-1.151,54	-0,32% ▼	1,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.305.932,82	0,00	0,00	1.306.202,90	270,08	0,02% ▲	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.677.037,56	0,00	0,00	1.645.079,75	-31.957,81	-1,91% ▼	3,99%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		314.728,65	0,00	0,00	317.945,43	3.216,78	1,02% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA		128.132,78	0,00	0,00	129.160,51	1.027,73	0,80% ▲	0,36%
		24.461.512,03	1.062.793,05	0,00	25.369.180,05	-155.125,03	-0,61%	2,06%

*Diem*

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AGRO FIC AÇÕES	102.310,05	0,00	0,00	105.668,42	3.358,37	3,28% ▲	7,37%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	160.260,78	0,00	0,00	161.301,77	1.040,99	0,65% ▲	0,84%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	264.714,64	0,00	0,00	274.586,00	9.871,36	3,73% ▲	6,30%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	34.753,27	0,00	0,00	34.974,44	221,17	0,64% ▲	0,89%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	349.419,15	0,00	0,00	363.553,75	14.134,60	4,05% ▲	7,97%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	148.821,19	0,00	0,00	156.422,03	7.600,84	5,11% ▲	7,37%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	266.049,34	0,00	0,00	292.894,70	26.845,36	10,09% ▲	8,94%
	<b>1.326.328,42</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.389.401,11</b>	<b>63.072,69</b>	<b>4,76%</b>	<b>6,73%</b>

*[Handwritten signatures and initials]*

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - Var
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NIVEL I	612.835,07	0,00	0,00	688.727,39	75.892,32	12,38% ▲	12,96%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	213.899,05	0,00	0,00	230.747,97	16.848,92	7,88% ▲	11,49%
	826.734,12	0,00	0,00	919.475,36	92.741,24	11,22%	9,71%

*[Handwritten signatures and initials]*