



PARECER Nº 08/2021 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 20/2021 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 03 de novembro de 2021, 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 outubro de 2021.

Elaine Aparecida Correia Lopes
DAFIN

Daniel Cassiano Miranda
ASTECOIN

Mônica Souza dos Santos Costa
SUPREV

Martha Pação
Secretária de Administração
Mat. 9750469

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	Administrador	Ativos	Vol**	Mês	Ano	Contratação Aplic/Resg	Valor(R\$) (29/10/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	Pl do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IR-FM TP FI	3,35%	-2,68%	-3,57%	D0/D+1	213.871,99	1,62%	100%	4.936.979.120,19	0,00%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL TIT PUB RF LP	0,12%	0,52%	1,52%	D0/D0	393.867,98	2,98%	100%	6.971.439.407,82	0,01%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IR-FM 1 TP FIC FI	0,59%	-0,52%	1,00%	D0/D0	59.063,12	0,45%	100%	6.857.913.148,95	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,61%	-2,58%	-4,98%	D0/D+1	2.107.041,56	15,92%	100%	6.948.438.281,62	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,69%	-1,24%	1,03%	D0/D0	1.128.628,50	8,53%	100%	10.998.044.937,35	0,01%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	2,50%	-1,25%	1,45%	D0/D+1	2.142.414,25	16,19%	100%	9.253.803.912,06	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	8,73%	-3,93%	-5,32%	D0/D+2	843.805,99	6,38%	100%	985.822.490,63	0,09%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	8,66%	-3,98%	-5,35%	D0/D0	473.243,83	3,58%	100%	1.296.457.169,22	0,04%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-GERAL EX C TP FI	2,60%	-1,39%	-1,27%	D0/D+1	195.943,20	1,48%	100%	343.828.244,89	0,06%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,71%	-1,27%	0,98%	D0/D+1	2.260.601,16	17,09%	100%	6.081.334.244,20	0,04%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							9.818.481,59	74,21%				
ITAÚ UNIBANCO												
BB DTVM	BB DTVM	ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	0,96%	-0,36%	1,96%	D0/D0	118.720,67	0,90%	20%	2.956.661.982,44	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID	2,91%	-0,90%	-1,74%	D0/D+3	1.025.844,51	7,75%	20%	4.395.867.887,69	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,11%	0,49%	3,14%	D0/D0	124.734,24	0,94%	20%	6.213.259.499,94	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	0,09%	0,40%	2,06%	D0/D0	24.546,80	0,19%	20%	2.523.785.410,34	0,00%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							1.293.846,22	9,78%				
Sub-total Renda Fixa							11.112.327,81	83,99%				
Renda Variável												
BB DTVM	BB DTVM	BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	19,92%	-7,92%	-7,84%	D0/D0	1711.906,53	1,30%	20%	358.909.860,76	0,05%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	20,60%	-5,02%	-8,12%	D+1/D+1	369.251,67	2,79%	20%	1.271.071.598,64	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	19,33%	-10,13%	-15,27%	D+1/D+23	162.277,96	1,23%	20%	862.345.754,20	0,02%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							703.436,16	5,32%				
BB DTVM	BB DTVM	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,98%	0,60%	1,61%	D+1/D+1	32.698,13	0,25%	20%	2.536.949.387,29	0,00%	5%
BB DTVM	BB DTVM	BB ALOCAÇÃO FI MULTIM PREVID	3,66%	-0,07%	-0,57%	D+1/D+4	149.518,94	1,13%	20%	127.210.881,89	0,12%	5%

[Handwritten signatures and initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Catização Aplie/Resg	Valor(R\$) (29/10/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	Pl do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
ITAU UNIBANCO	ITAU UNIBANCO	ITAU PRIVATE MULT S&P500 BRL FC	13,20%	7,63%	26,41%	DD/DO	307.435,38	2,32%	20%	2.337.314.930,65	0,01%	5%
Sub-total Artigo 8º III - FI Multimercado							489.652,45	3,70%				
Sub-total Renda Variável							1.193.088,61	9,02%				
Investimentos no Exterior												
BB DTVM	BB DTVM	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI	18,20%	-5,84%	-9,89%	D+1/D+1	925.617,24	7,00%	10%	902.779.547,02	0,10%	15%
Sub-total Artigo 9 A III - Fundo de Ações BDR Nivel 1							925.617,24	7,00%				
Sub-total Investimentos no Exterior							925.617,24	7,00%				
Total							13.231.033,66	100%				

[Handwritten signatures and initials]

Cliente: RJ IBASMA
Data Início: 31/12/2020

Data Extrato: 29/10/2021
Índice de comparação: IPCA + 5,41%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/2010
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	9.818.481,59	74,21%	50,66%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	1.293.846,22	9,78%	20,43%	40,00%
	Total Renda Fixa	11.112.327,81	83,99%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	703.436,16	5,32%	18,91%	20,00%
Artigo 8º III	FI Multimercado	489.652,45	3,70%	6,14%	10,00%
	Total Renda Variável	1.193.088,61	9,02%		
Investimentos no Exterior					
Artigo 9 A III	Fundo de Ações BDR Nível 1	925.617,24	7,00%	0,43%	10,00%
	Total Investimentos no Exterior	925.617,24	7,00%		


Handwritten signatures and initials:



 gmar

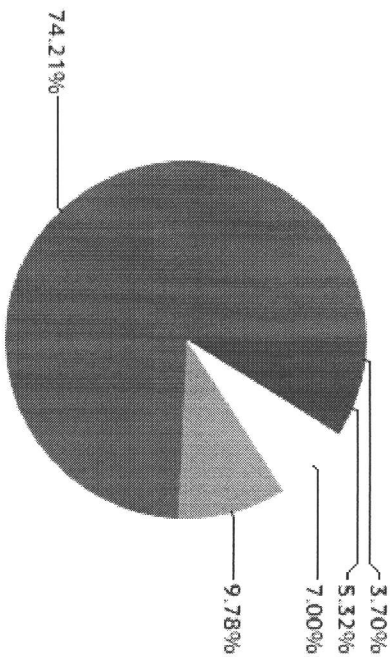
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	-1,76 -367,1	-0,50 -16,5	--	--	Artigo 7º I, Alínea b	-158.241,90
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,31 -997,3	-3,20 -622,2	--	--	Artigo 7º IV, Alínea a	-8.996,46
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,69 -143,7	-0,71 -23,7	--	--	Artigo 8º II, Alínea a	-52.614,56
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	-6,96 -1.448,6	-9,82 -327,3	--	--	Artigo 8º III	21.885,54
Artigo 8º III % do CDI	4,68 973,9	14,02 467,5	--	--	Artigo 9 A III	-57.402,42
Artigo 9 A III Var. Dólar Comercial p.p	-5,84 -9,6	-9,89 -14,0	--	--	Total	-255.369,79

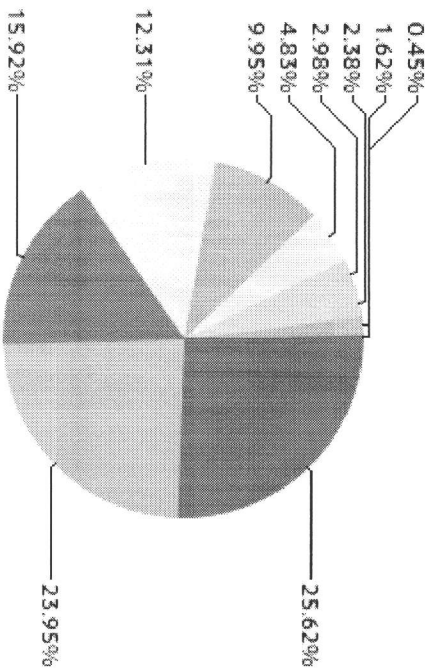


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



- Artigo 8º III (3,70%)
- Artigo 8º II, Alínea a (5,32%)
- Artigo 9º A III (7,00%)
- Artigo 7º IV, Alínea a (9,78%)
- Artigo 7º I, Alínea b (74,21%)



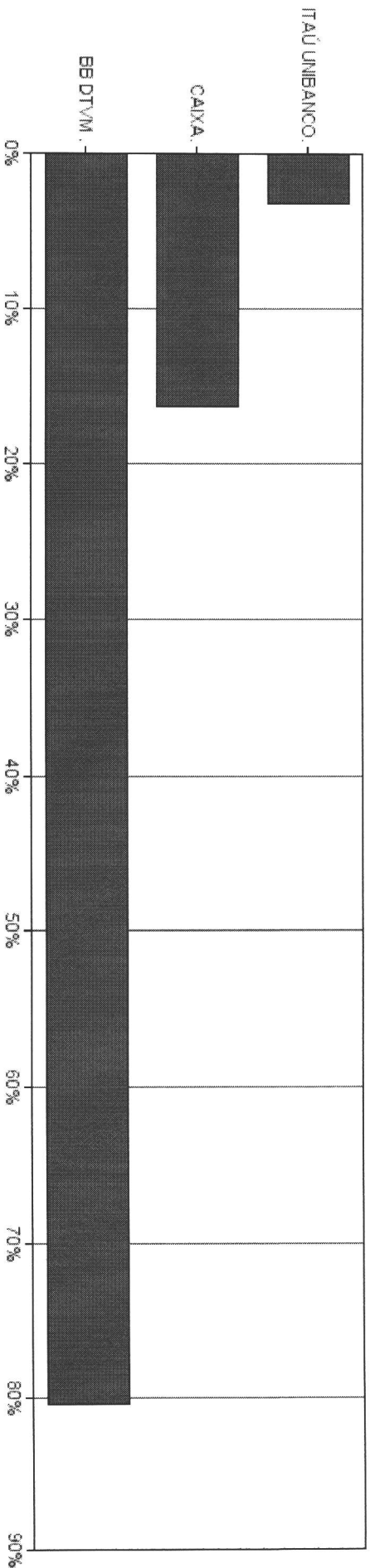
- IMA - B 5 (25,62%)
- IPCA (23,95%)
- IMA - B (15,92%)
- IBOVESPA (12,31%)
- IMA - B 5+ (9,95%)
- CDI (4,83%)
- IPCA + 6% (2,98%)
- IMA - GERAL (2,38%)
- IRF - M (1,62%)
- IRF - M 1 (0,45%)

Indexadores

(Handwritten signatures and initials)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

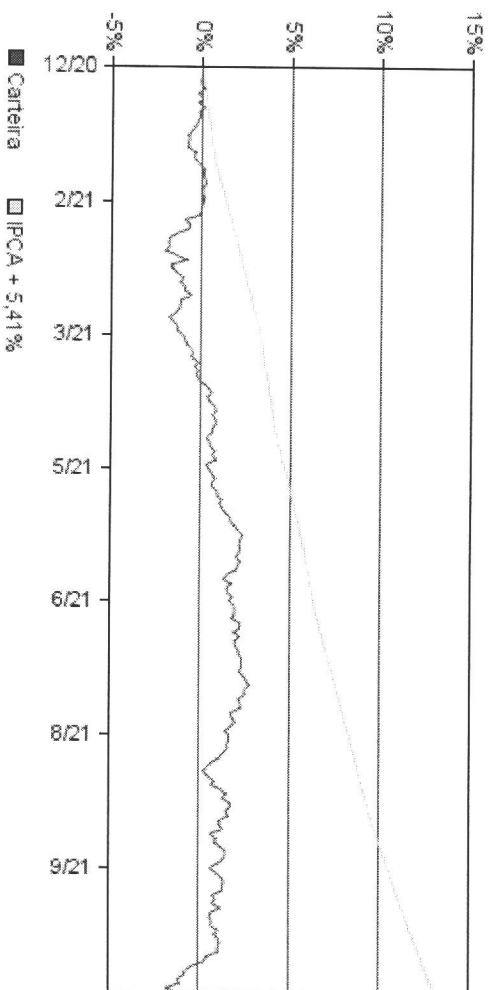


[Handwritten signatures and initials]

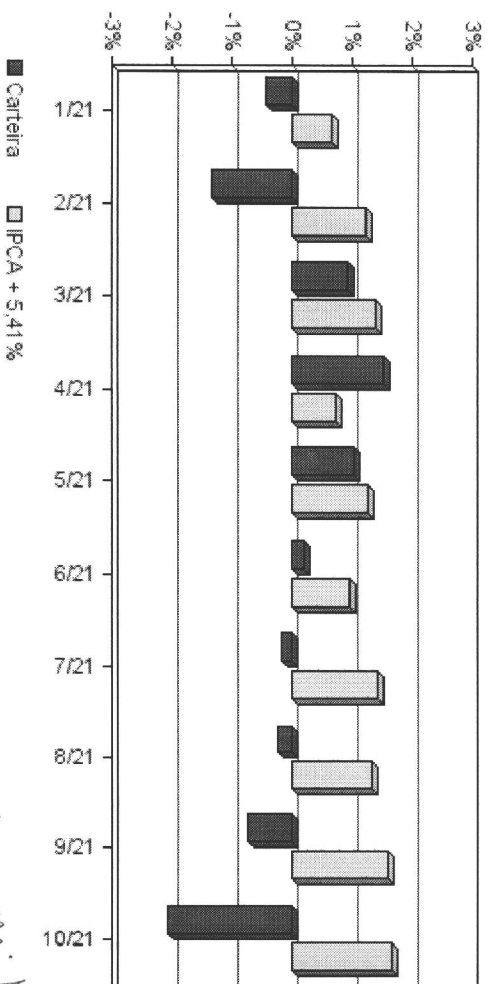
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	--	--	-1,30
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	--	--	13,05
p.p. Índx	-1,12	-2,57	-0,49	0,82	-0,23	-0,77	-1,61	-1,57	-2,32	-3,74	--	--	-14,35

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



[Handwritten signatures and initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

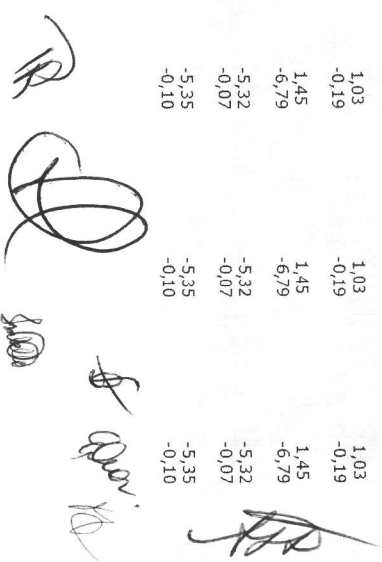
Análise de Risco / Retorno da Carteira

Mês	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	IPCA + 5,41%	p.p. Índx.	
Meses acima do Benchmark	1	10,0%	03 meses	-3,00	4,69	-7,7	4,880
Meses abaixo do Benchmark	9	90,0%	06 meses	-1,96	8,58	-10,5	4,177
			12 meses	--	--	--	--
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	-1,30	13,05	-14,3	4,173

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,55%	abr/21
Menor rentabilidade da Carteira	-2,07%	out/21

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
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	-2,68	-3,57	-3,67	-3,57	-3,57	-3,57	-3,57
Var. do IRF-M TOTAL p.p.	-0,05	-0,24	-0,14	-0,24	-0,24	-0,24	-0,24
FI CAIXA BRASIL TIT PUB RF LP	0,52	1,52	1,36	1,52	1,52	1,52	1,52
Var. do IPCA + 6% p.p.	-1,20	-3,94	-3,47	-3,94	-3,94	-3,94	-3,94
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	-0,52	1,00	0,18	0,70	1,00	1,00	1,00
Var. do IRF-M 1 p.p.	0,02	-0,23	-0,05	-0,12	-0,23	-0,23	-0,23
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	-2,58	-4,98	-3,83	-2,83	-4,98	-4,98	-4,98
Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,20	-0,10	-0,15	-0,20	-0,20	-0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	-1,24	1,03	-0,14	0,39	1,03	1,03	1,03
Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,19	-0,05	-0,10	-0,19	-0,19	-0,19
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	-1,25	1,45	-0,05	0,61	1,45	1,45	1,45
Var. do IPCA p.p.	-2,50	-6,79	-3,37	-5,12	-6,79	-6,79	-6,79
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	-3,93	-5,32	-5,32	-5,32	-5,32	-5,32	-5,32
Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,05	-0,07	-0,07	-0,07	-0,07	-0,07	-0,07
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	-3,98	-5,35	-5,35	-5,35	-5,35	-5,35	-5,35
Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,11	-0,10	-0,10	-0,10	-0,10	-0,10	-0,10



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

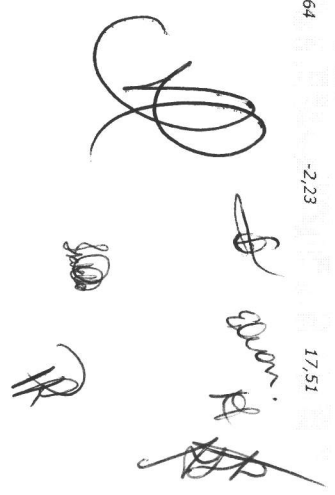
Fundo / Indexador	Rentabilidades em Períodos Fechados (%)						
	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-GERAL EX C TP FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-1,39 -0,08	-1,27 -0,43	-1,78 -0,06	-1,19 -0,33	-1,27 -0,43	-1,27 -0,43	-1,27 -0,43
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	-1,27 -0,04	0,98 -0,24	-0,21 -0,11	0,31 -0,18	0,98 -0,24	0,98 -0,24	0,98 -0,24
ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,36 0,95	1,96 3,64	0,79 2,50	1,51 2,37	1,96 3,64	1,96 3,64	1,96 3,64
BB ALOCAÇÃO ATIVA RET TOT FIC RF PREVID Var. do IPCA p.p.	-0,90 -2,15	-1,74 -9,97	-1,24 -4,56	-0,71 -6,44	-1,74 -9,97	-1,74 -9,97	-1,74 -9,97
BB PREVIDENCIÁRIO RF PEREL FIC FI % do CDI	0,49 101,77	3,14 104,82	1,40 103,92	2,43 105,81	3,14 104,82	3,14 104,82	3,14 104,82
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI % do CDI	0,40 82,94	2,06 68,82	1,05 77,72	1,72 74,99	2,06 68,82	2,06 68,82	2,06 68,82
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES Var. do IBOVESPA p.p.	-7,92 -1,19	-7,84 5,19	-12,98 2,04	-10,74 2,21	-7,84 5,19	-7,84 5,19	-7,84 5,19
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES Var. do IBOVESPA p.p.	-5,02 1,72	-8,12 4,92	-10,68 4,34	-8,86 4,09	-8,12 4,92	-8,12 4,92	-8,12 4,92
CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR Var. do IBOVESPA p.p.	-10,13 -3,39	-15,27 -2,24	-17,46 -2,43	-16,11 -3,16	-15,27 -2,24	-15,27 -2,24	-15,27 -2,24
BB MAGRO FIC MULTIMERCADO LP % do CDI	0,60 124,63	1,61 53,60	0,38 27,90	1,22 53,26	1,61 53,60	1,61 53,60	1,61 53,60
BB ALOCAÇÃO FI MULTIM PREVID % do CDI	-0,07 -14,85	-0,57 -18,96	-0,95 -70,19	-0,06 -2,78	-0,57 -18,96	-0,57 -18,96	-0,57 -18,96
ITAÚ PRIVATE MULT S&P500 BRL FC % do CDI	7,63 1.588,51	26,41 880,47	6,12 453,67	12,21 532,58	26,41 880,47	26,41 880,47	26,41 880,47
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI Var. do IBOVESPA p.p.	-5,84 0,90	-9,89 0,63	-13,87 1,16	-10,90 2,05	-9,89 0,63	-9,89 0,63	-9,89 0,63
IPCA + 5,41%	1,67	13,05	4,69	8,58	16,61	27,68	38,00
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28


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
JMA - B	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76
JMA - B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61
JMA - B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68
JMA - GERAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11
IRF - M	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83
IRF - M 1	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47
IRF - M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93
IPCA + 6%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32
INPC + 6%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
Dólar Comercial	3,74	8,59	10,18	4,43	-2,23	40,93	51,79
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51



Cliente: RJ IBASMA
Data Início: 31/12/2020

Data Extrato: 29/10/2021
Índice de comparação: IPCA + 5,41%

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
IGPM	0,64	16,75	0,66	6,23	21,74	47,21	51,86
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35
IPCA	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92



Handwritten signatures and stamps at the bottom of the page, including a large signature and several smaller ones with circular stamps.