



PARECER N° 10/2023 – CONSELHO FISCAL

Os membros participantes da Reunião Ordinária do Conselho Fiscal – CONFIS do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama – IBASMA, ocorrida em 31 de outubro de 2023, no desempenho de suas competências de que trata o item 1.2 da Lei Municipal n° 154 de 14 de Outubro de 2019, APROVAM o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de setembro de 2023.

Aloysio José da Silva Terra
Membro Titular CONFIS

Isabella Oliveira de Paula Santos
Membro Titular CONFIS

Allan Nunes Marques
Membro Titular CONFIS

Paulo Roberto dos Santos Rocha
Membro Titular CONFIS





PARECER Nº 10/2023 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 12/2023 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 09 de outubro de 2023, 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 setembro de 2023.

Mônica Souza dos Santos Costa
SUPREV

Rafael Ferreira Viana Dumas
DAFIN

Thayna Pacheco Coutinho
DPP

2023

Relatório Mensal e 3º trimestre de 2023

Setembro

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.457 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pro-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível 1, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.



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

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.242.379,62	5,33%	6.063.437,379,24	0,04%	7º 1b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.156.747,73	7,51%	5.453.684,801,95	0,06%	7º 1b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.378.632,41	15,17%	1.516.152,288,42	0,42%	7º 1b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.673.238,01	34,90%	5.367.605,963,99	0,27%	7º 1b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	73.638,57	0,18%	7.028,296,292,55	0,00%	7º 1b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.413.127,24	8,12%	3.601,727,255,66	0,09%	7º 1b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.947.912,72	4,63%	3.520,695,315,59	0,06%	7º 1b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	368.165,44	0,88%	3.791,584,166,14	0,01%	7º 1b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.639.071,24	3,90%	8.162,684,334,70	0,02%	7º 1b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.783.372,17	4,24%	1.488,811,938,74	0,12%	7º 1b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.071.034,90	2,55%	5.222,821,325,49	0,02%	7º 1b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	368.574,75	0,88%	13.380,727,353,70	0,00%	7º 1b
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	146.132,95	0,35%	2.195,169,805,31	0,01%	7º 1b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	55.761,76	0,13%	1.119,712,182,35	0,00%	7º 1b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	30.152,08	0,07%	3.380,807,738,12	0,00%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.274.132,36	3,03%	15.259,689,366,93	0,01%	7º III a
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	285.906,40	0,68%	10.855,711,641,60	0,00%	7º III a
BB AGRO FIC AÇÕES	216.850,46	0,52%	357,699,054,52	0,06%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	435.467,60	1,04%	497,500,211,96	0,09%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	390.427,22	0,93%	1.350,797,320,58	0,03%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	168.662,43	0,40%	628,673,074,03	0,03%	8º I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	110.719,63	0,26%	723,327,375,54	0,02%	8º I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	233.231,83	0,55%	761,736,475,27	0,03%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NIVEL I	818.349,41	1,95%	446,292,351,73	0,18%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	245.782,36	0,58%	1.999,422,357,55	0,01%	9º III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	183.449,76	0,44%	129,062,339,73	0,14%	10º I
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	334.915,45	0,80%	1.122,626,979,16	0,03%	10º I

Investimentos

\$ 42.045.836,50

Disponibilidades Financeiras

\$ 2.000.714,96

Total Carteira

\$ 44.046.551,46

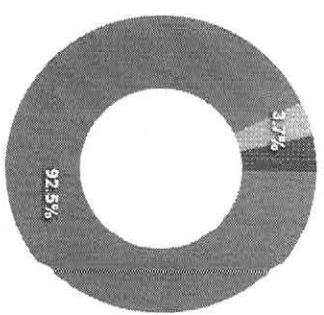
Governança (Pró Gestão)

de NIVEL 2 29/09/2024

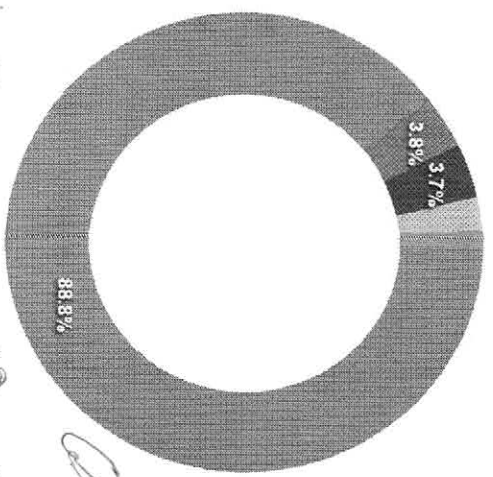
Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Utilizado	Limite
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	88,76%	37.317.789,51	11,24%	4.728.046,99
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	3,78%	1.590.190,84	66,22%	27.841.894,71
8º I - Fundos de Ações	40,00%	3,70%	1.555.359,17	36,30%	15.262.975,43
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,53%	1.064.131,77	7,47%	3.140.451,88
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	1,23%	518.365,21	8,77%	3.686.218,44

Governança (Pró Gestão)
NIVEL 2 29/09/2024

Segmentos



Artigos



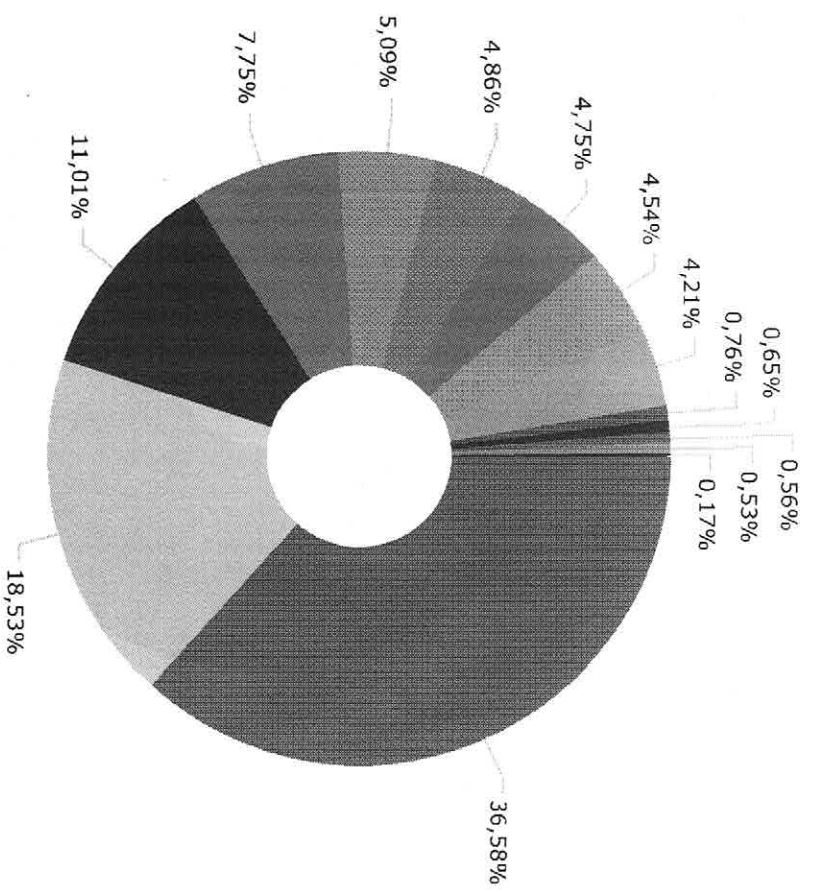
Handwritten signatures and initials:
 [Signature] [Signature] [Signature] [Signature]

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	42.045.836,50	8º I - Fundos de Ações	3,70%	0,00%	15,00%	40,00%	15.262.975,43
7º I b - FI 100% Títulos TN	88,76%	0,00%	61,00%	100,00%	4.728.046,99	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	16.818.334,60
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	42.045.836,50	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.204.583,65
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.102.291,83	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.204.583,65
7º III a - FI Referenciados RF	3,78%	0,00%	10,00%	70,00%	27.841.894,71	9º III - Ações - BDR Nível I	2,53%	0,00%	5,00%	10,00%	3.140.451,88
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	70,00%	29.432.085,55	10º I - Fundos Multimercados	1,23%	0,00%	2,00%	10,00%	3.686.118,44
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	8.409.167,30	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.102.291,83
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	4.204.583,65	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.102.291,83
7º V b - Fundos de RF - Crêdit...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	4.204.583,65	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	4.204.583,65
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	4.204.583,65	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.204.583,65

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR - Mes	Volatilidade - Mes
CDI - BENCHMARK								
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	0,01	0,02
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,97	9,87	3,22	6,49	13,40	26,08	0,01	0,02
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95	9,91	3,16	6,49	13,34	25,92	0,01	0,06
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90	9,12	2,96	5,95	12,33	23,32	0,01	0,02
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,47	8,46	1,78	4,64	11,35	22,61	0,74	1,56
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,46	17,23	1,81	7,82	21,85	-5,29		
	-3,57	16,05	1,32	7,00	20,13	-7,28	4,97	10,47
IBOVESPA - BENCHMARK								
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03		
	-3,35	29,82	1,07	16,55	16,22	-16,75	6,92	14,57
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FI AÇÕES	-0,29	14,58	-4,52	17,03	11,80	8,54	6,89	14,52
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FI AÇÕES	-0,12	11,80	-1,69	17,93	10,85	13,29	8,45	17,80
BB AGRO FI AÇÕES	2,38	3,43	2,89	11,28	3,29	1,39	7,24	15,25
BB SELEÇÃO FATORIAL FI AÇÕES	0,47	4,43	-0,70	13,47	1,94	0,42	7,60	16,01
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FI AÇÕES	-0,01	6,08	-1,83	14,98	1,58	-6,59	7,55	15,91
IBX - BENCHMARK								
CLARITAS VALOR FEEDER FI AÇÕES	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69		
	-1,08	4,64	-0,98	14,05	0,49	5,59	9,03	19,02
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35		
	0,21	8,59	1,90	4,04	11,22	20,92	0,85	1,80
IMA-B - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09		
	-0,95	10,65	-0,53	6,49	10,76	18,68	2,51	5,30
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97	10,56	-0,64	6,42	10,75	18,44	2,52	5,32
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10	2,94	0,43	1,87	5,73	8,35	0,33	0,70

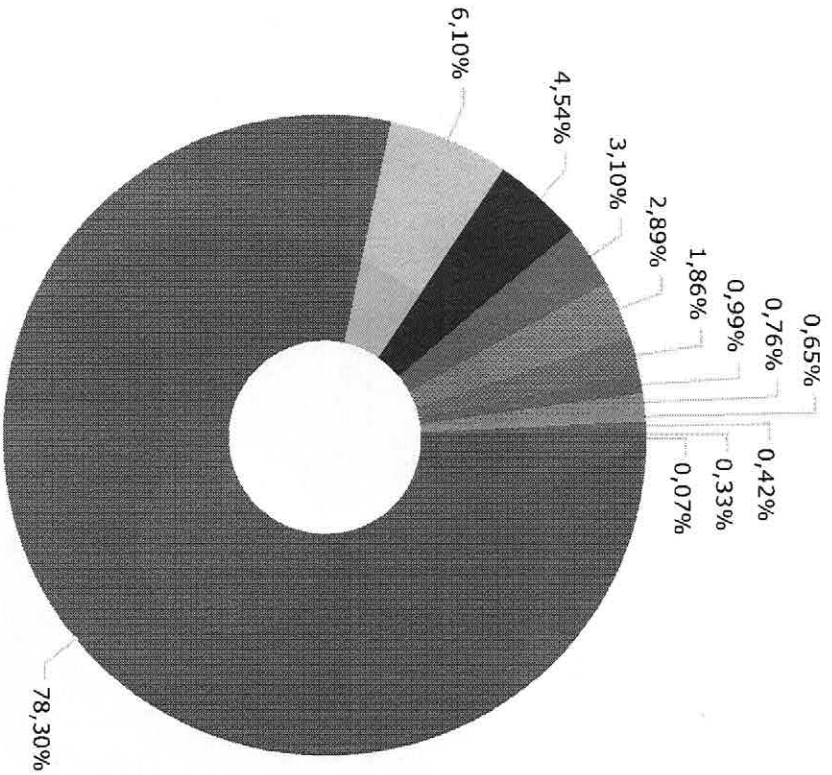
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR - Mes	Volatilidade - Mes
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11	8,79	1,67	4,28	11,46	21,66	0,98	2,07
BB IMA-B 5 FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,11	8,75	1,65	4,25	11,41	21,41	0,99	2,08
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIG RENDA FIXA	0,11	8,70	1,67	4,20	11,40	21,46	0,98	2,07
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,86	11,75	-2,38	7,97	9,75	15,00	3,94	8,30
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,96	11,74	-2,55	7,96	9,74	15,04	4,04	8,50
IPCA - BENCHMARK	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10	8,82	3,09	4,57	11,76		0,33	0,70
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIG RENDA FIXA	-0,30	11,35	0,97	6,94	10,76	22,65	1,61	3,38
IRF-M - BENCHMARK	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14	11,25	1,65	7,18	13,07	21,93	1,12	2,36
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68		
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIG RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90	9,81	3,11	6,35	13,19	24,03	0,06	0,13
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	-4,87	11,68	-3,65	4,35	19,59	-0,45		
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIG MULTIMERCADO	-4,44	17,78	-1,90	8,26	29,28	17,25	5,01	10,55
SELIC - BENCHMARK	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80		
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,96	9,73	3,15	6,34	13,18	25,21	0,01	0,02





IMA-B	16.112.438,35
IMA-B 5+	8.162.004,58
IMA-B 5	4.851.580,73
IRF-M	3.413.127,24
IDKA IPCA 2Anos	2.242.379,62
Ibovespa	2.140.476,75
IPCA	2.094.045,67
Disponibilidades Financeiras	2.000.714,96
CDI	1.856.308,95
S&P 500 (Moeda Original)	334.915,45
Selic	285.906,40
Global BDRX	245.782,36
IBX	233.231,83
IRF-M 1	73.638,57

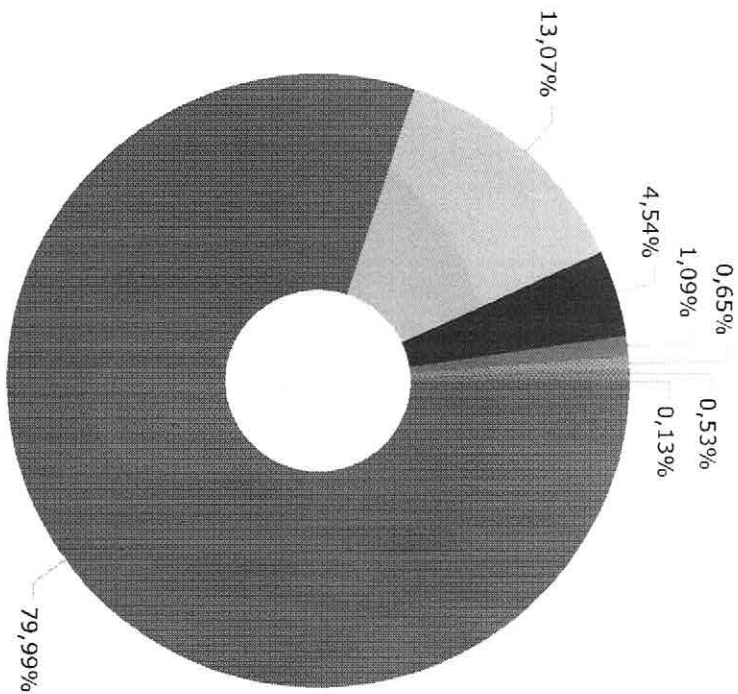
(Handwritten signatures and initials)



■ Renda Fixa Indexados	34.487.003,65
■ Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.684.632,91
■ Disponibilidades Financeiras	2.000.714,96
■ Ações Livres	1.365.613,93
■ Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	1.274.132,36
■ Ações Setoriais	818.349,41
■ Ações Dividendos	435.467,60
■ Multimercados Estratégia Específica	334.915,45
■ Renda Fixa Duração Baixa Soberano	285.906,40
■ Multimercados Livre	183.449,76
■ Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	146.112,95
■ Renda Fixa Simples	30.152,08

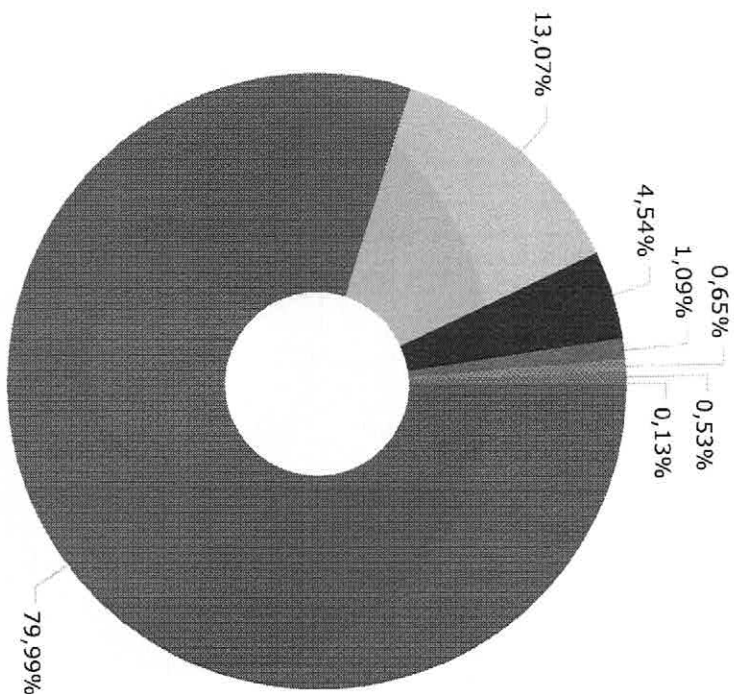






BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	35.234.505,19
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.755.382,92
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.000.714,96
ITAU UNIBANCO S.A.	481.048,40
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEM...	285.906,40
CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU...	233.231,83
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	55.761,76





■ BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	35.234.505,19
■ CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.755.382,92
■ DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.000.714,96
■ TAU UNIBANCO S.A.	481.048,40
■ BANCO BRADESCO S.A.	285.906,40
■ SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRI...	233.231,83
■ BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	55.761,76



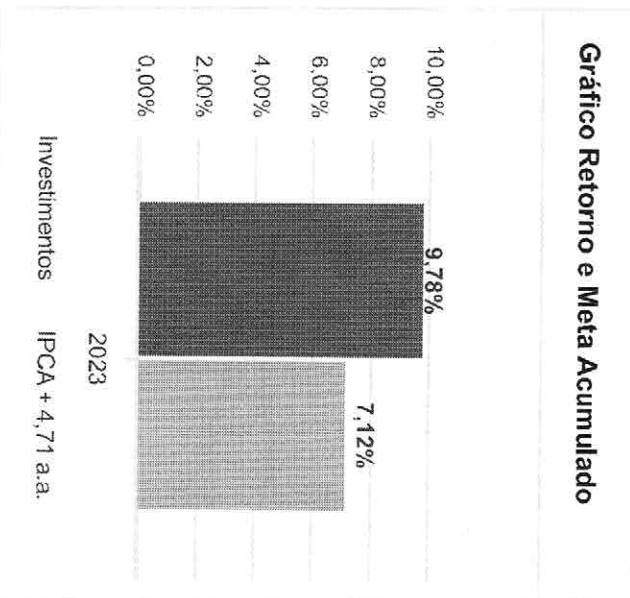



Mes	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - Var
Janeiro	33.433.060,76	0,00	0,00	33.719.193,16	286.132,40	286.132,40	0,86% ▲	0,86%	0,93%	0,93%	92,47%	2,62%
Fevereiro	33.719.193,16	1.569.600,06	1.464.125,96	34.137.057,05	312.389,79	598.522,19	0,92% ▲	1,79%	1,17%	2,12%	84,43%	2,36%
Março	34.137.057,05	406.243,46	0,00	35.209.931,94	666.631,43	1.265.153,62	1,93% ▲	3,75%	1,13%	3,28%	114,33%	1,68%
Abril	35.209.931,94	1.023.428,60	0,00	36.731.995,96	498.635,42	1.763.789,04	1,38% ▲	5,18%	0,94%	4,25%	121,88%	1,58%
Mai	36.731.995,96	8.534.168,63	7.628.965,56	38.407.497,43	770.298,40	2.534.087,44	2,05% ▲	7,33%	0,63%	4,91%	149,29%	1,73%
Junho	38.407.497,43	7.776.281,06	7.000.000,00	40.099.632,37	915.853,88	3.449.941,32	2,34% ▲	9,84%	0,30%	5,23%	188,15%	2,21%
Julho	40.099.632,37	957.423,14	0,00	41.447.972,83	390.917,32	3.840.858,64	0,95% ▲	10,89%	0,50%	5,76%	189,06%	1,73%
Agosto	41.447.972,83	797.607,29	63.541,14	42.067.891,56	-114.147,42	3.726.711,22	-0,27% ▼	10,59%	0,65%	6,45%	164,19%	2,00%
Setembro	42.067.891,56	285.266,54	0,00	42.045.836,50	-307.321,60	3.419.389,62	-0,73% ▼	9,78%	0,63%	7,12%	137,36%	2,49%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.265.153,62	3,75%	3,28%
2º Trim	2.184.787,70	5,87%	1,89%
1º Sem	3.449.941,32	9,84%	5,23%
3º Trim	-30.551,70	-0,05%	1,79%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Handwritten signatures and initials at the bottom of the page.

Gráfico Risco x Retorno

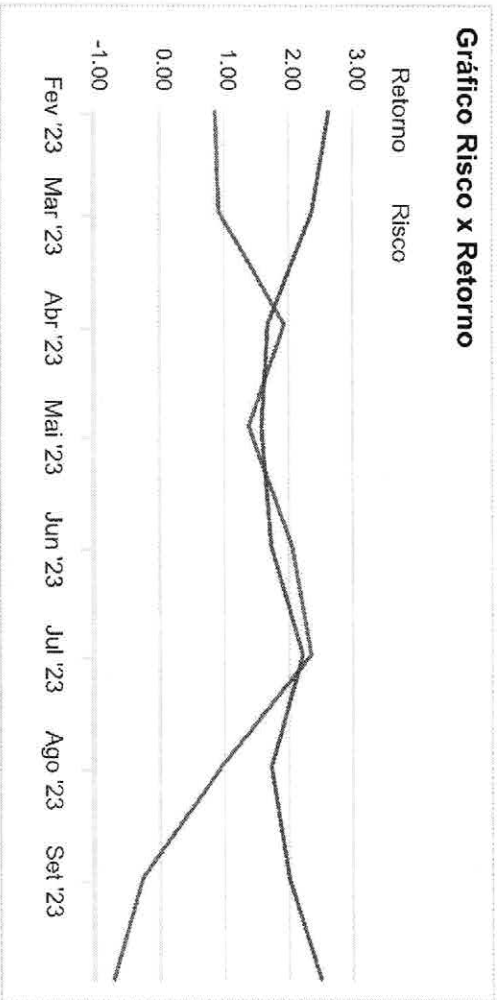
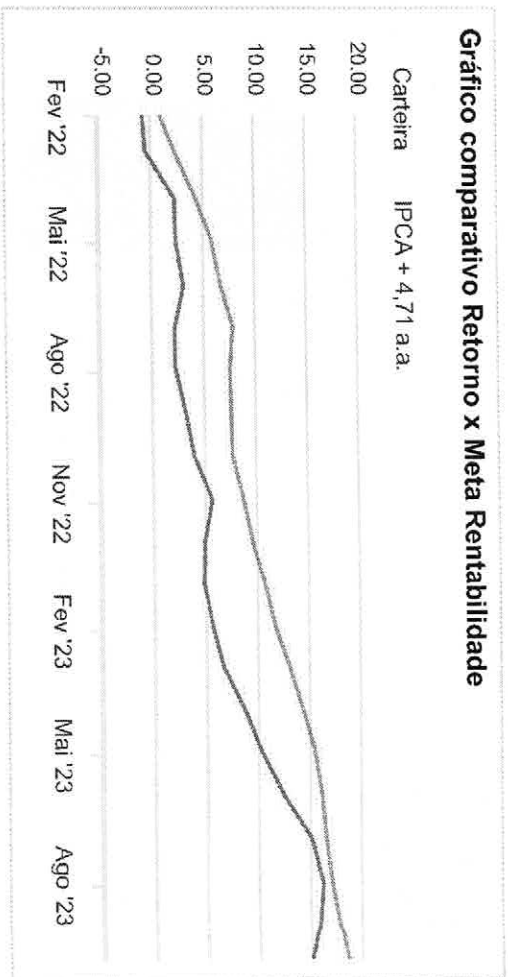
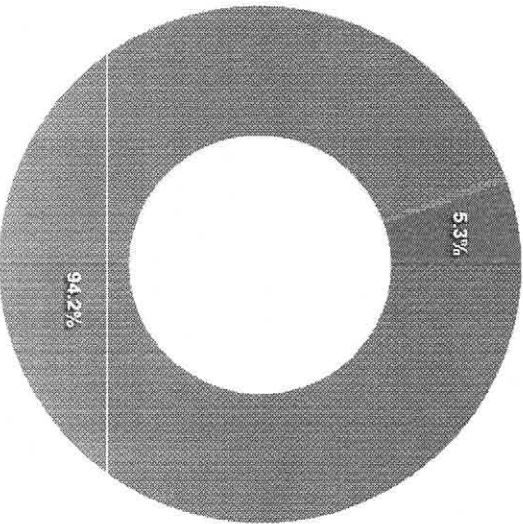


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/09/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	41.497.241,47	98,70
Até D+180	233.231,83	0,55
Até D+360	2.316.078,16	5,51
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



Handwritten signatures and initials.

	RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - Var
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO		29.884,29	0,00	0,00	30.152,08	267,79	0,90% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		2.237.642,51	0,00	0,00	2.242.379,62	4.737,11	0,21% ▲	0,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		3.153.242,85	0,00	0,00	3.156.747,73	3.504,88	0,11% ▲	0,99%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		6.505.859,87	0,00	0,00	6.378.632,41	-127.227,46	-1,96% ▼	4,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		14.816.797,63	0,00	0,00	14.673.238,01	-143.559,62	-0,97% ▼	2,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		72.978,75	0,00	0,00	73.638,57	659,82	0,90% ▲	0,06%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		3.408.367,49	0,00	0,00	3.413.127,24	4.759,75	0,14% ▲	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP		1.261.892,23	0,00	0,00	1.274.132,36	12.240,13	0,97% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		1.926.750,62	0,00	0,00	1.947.912,72	21.162,10	1,10% ▲	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		364.166,49	0,00	0,00	368.165,44	3.998,95	1,10% ▲	0,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.637.238,97	0,00	0,00	1.639.071,24	1.832,27	0,11% ▲	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.817.176,81	0,00	0,00	1.783.372,17	-33.804,64	-1,86% ▼	3,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.081.384,48	0,00	0,00	1.071.034,90	-10.349,58	-0,96% ▼	2,51%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		365.093,33	0,00	0,00	368.574,75	3.481,42	0,95% ▲	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA		146.571,51	0,00	0,00	146.132,95	-438,56	-0,30% ▼	1,61%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA		55.698,37	0,00	0,00	55.761,76	63,39	0,11% ▲	0,98%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI		0,00	285.266,54	0,00	285.906,40	639,86	0,22% ▲	0,01%
		38.880.746,20	285.266,54	0,00	38.907.980,35	-258.032,39	-0,66%	2,16%

[Handwritten signatures and initials]

	RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BBAGRO FIC AÇÕES		211.810,08	0,00	0,00	216.850,46	5.040,38	2,38% ▲	7,24%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES		436.733,73	0,00	0,00	435.467,60	-1.266,13	-0,29% ▼	6,89%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES		388.599,26	0,00	0,00	390.427,22	1.827,96	0,47% ▲	7,60%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES		168.674,07	0,00	0,00	168.662,43	-11,64	-0,01% ▼	7,55%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES		110.853,85	0,00	0,00	110.719,63	-134,22	-0,12% ▼	8,45%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES		235.776,28	0,00	0,00	233.231,83	-2.544,45	-1,08% ▼	9,03%
		1.552.447,27	0,00	0,00	1.555.359,17	2.911,90	0,19%	7,62%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - Var
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	182.595,59	0,00	0,00	183.449,76	854,17	0,47% ▲	0,74%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	350.482,83	0,00	0,00	334.915,45	-15.567,38	-4,44% ▼	5,01%
-	533.078,42	0,00	0,00	518.365,21	-14.713,21	-2,76%	3,50%

[Handwritten signatures and initials]

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - V/R
BB TECNOLOGIA FIÇÕES BDR NIVEL I	846.725,13	0,00	0,00	818.349,41	-28.375,72	-3,36% ▼	6,92%
CAIXA INSTITUCIONAL FIÇÕES BDR NIVEL I	254.894,54	0,00	0,00	245.782,36	-9.112,18	-3,57% ▼	4,97%
	1.101.619,67	0,00	0,00	1.064.131,77	-37.487,90	-3,40%	5,32%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	29.284,82	0,00	0,00	30.152,08	867,26	2,96% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.200,465,46	0,00	0,00	2.242,379,62	41.914,16	1,90% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.105,525,14	0,00	0,00	3.156,747,73	51.222,59	1,65% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.545,606,65	0,00	0,00	6.378,632,41	-166,974,24	-2,55% ▼
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.492,170,67	1.276,728,88	0,00	14.673,238,01	-95,661,54	-0,65% ▼
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	71,417,48	0,00	0,00	73,638,57	2.221,09	3,11% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.357,680,04	0,00	0,00	3.413,127,24	55,447,20	1,65% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.234,342,79	0,00	0,00	1.274,132,36	39,789,57	3,22% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.942,554,37	0,00	53,905,39	1.947,912,72	59,263,74	3,05% ▲
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	285,266,54	0,00	285,906,40	639,86	0,22% ▲
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	366,604,48	0,00	9,635,75	368,165,44	11,196,71	3,05% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.612,179,83	0,00	0,00	1.639,071,24	26,891,41	1,67% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.826,908,04	0,00	0,00	1.783,372,17	-43,535,87	-2,38% ▼
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	604,106,10	478,301,55	0,00	1.071,034,90	-11,372,75	-1,05% ▼
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	357,284,81	0,00	0,00	368,574,75	11,289,94	3,16% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	144,730,96	0,00	0,00	146,132,95	1,401,99	0,97% ▲
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	54,847,05	0,00	0,00	55,761,76	914,71	1,67% ▲
	36.945.708,69	2.040.296,97	63.541,14	38.907.980,35	-14.484,17	-0,04%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB TECNOLOGIA FIÇÕES BDR NIVEL I	809.682,26	0,00	0,00	818.349,41	8.667,15	1,07% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FIÇÕES BDR NIVEL I	242.569,76	0,00	0,00	245.782,36	3.212,60	1,32% ▲
	1.052.252,02	0,00	0,00	1.064.131,77	11.879,75	1,13%

Cenário Econômico

Na esteira de agosto, o mês de setembro também foi de grande desafio para a gestão dos investimentos. Na renda fixa, mais uma vez, a abertura da curva de juros prejudicou a rentabilidade dos fundos atrelados a inflação mais longa (IMA-B e IMA-B5+). Na renda variável, os índices tiveram desempenhos mistos: o índice Ibovespa fechou no positivo e o Small Caps fechou em forte baixa. Já os ativos no exterior, com a aceleração das incertezas globais, os índices, no geral, fecharam também em forte baixa. Com tudo isso o mês será de resultados mistos para as carteiras de investimentos. Aqueles que são com maior exposição ao risco, vão fechar com resultados próximos ao zero, já os com menor exposição ao risco, experimentaram rentabilidades ligeiramente superiores.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2023. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2023 ainda não foram integralmente atingidos.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

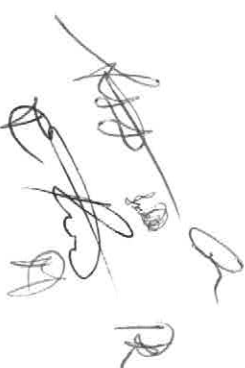
A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.



Retorno da Carteira de Investimentos

Na renda fixa, mais uma vez, a abertura da curva de juros prejudicou a rentabilidade dos fundos atrelados a inflação mais longa (IMA-B e IMA-B5+). Na renda variável, os fundos tiveram desempenhos mistos; os fundos atrelados ao índice Ibovespa fecharam no positivo, já os fundos de benchmark Small Caps fecharam em baixa. Já os ativos no exterior, com a aceleração das incertezas globais, no geral fecharam também em baixa.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2023, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 06 de outubro de 2023.

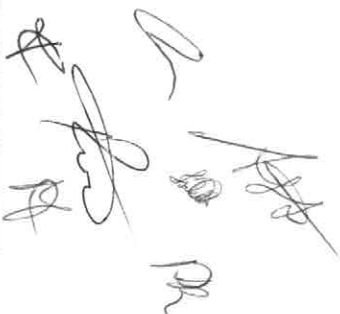


Mais Valia Consultoria Ltda EPP



Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **IBASMA INST BENF ASSIST SERV MUNC ARARUAMA - RJ** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Setembro/2023**, atestando os dados relativos à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.



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

Aprovação do Conselho Fiscal

O Conselho Fiscal do **IBASMA INST BENF ASSIST SERV MUNC ARARUAMA - RJ** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Setembro/2023** bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **IBASMA INST BENF ASSIST SERV MUNC ARARUAMA - RJ** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

