



PARECER Nº 11/2023 – CONSELHO FISCAL

Os membros participantes da Reunião Ordinária 10/2023 do Conselho Fiscal – CONFIS do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama – IBASMA, ocorrida em 23 de novembro de 2023, no desempenho de suas competências de que trata o item 1.2 da Lei Municipal nº 154 de 14 de Outubro de 2019, APROVAM o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de outubro 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 11/2023 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião Ordinária 14/2023 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Benefício e Assistência aos Servidores Municipais de Araruama - IBASMA, ocorrida em 09 de novembro 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 outubro de 2023.

Mônica Souza dos Santos Costa
SUPREV

Rafael Ferreira Viana Daumas
DAFIN

Thayna Pacheco Coutinho
DPP

2023

Relatório Mensal

Outubro

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, Item 3.2.6 Nível 1, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.234.985,62	5,19%	5.824.441,376,72	0,04%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.146.520,37	7,31%	5.252.934,178,04	0,06%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.315.604,17	14,67%	1.473.904,353,82	0,43%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.660.321,09	29,41%	5.052.854,726,15	0,25%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	74.319,13	0,17%	7.179,042,508,92	0,00%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.425.186,50	7,96%	3.620.971,555,98	0,09%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.956.405,69	4,54%	3.536,045,884,72	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	369.771,66	0,86%	3.808,125,905,80	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXALP	1.633.798,36	3,80%	7.787,487,970,57	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXALP	1.766.215,21	4,10%	1.373,230,642,51	0,13%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXALP	1.063.918,25	2,47%	5.036,600,197,80	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	372.096,98	0,86%	12.230,065,528,97	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	145.828,97	0,34%	2.180,749,467,31	0,01%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	55.577,18	0,13%	1.146,272,095,85	0,00%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	30.424,14	0,07%	3.699,670,141,46	0,00%	7º III a
BB PERFL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.721.027,92	8,64%	15.296,039,303,73	0,02%	7º III a
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.042.626,07	2,42%	11.598,043,392,40	0,01%	7º III a
BB AGRO FIC AÇÕES	203.055,70	0,47%	320,600,457,59	0,06%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	408.110,13	0,95%	465,759,490,78	0,09%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	379.094,17	0,88%	1.302,352,358,50	0,03%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	159.745,43	0,37%	586,219,451,06	0,03%	8º I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	104.370,22	0,24%	684,321,543,81	0,02%	8º I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	221.174,85	0,51%	721,013,694,58	0,03%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	803.170,91	1,87%	429,910,854,12	0,19%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	242.343,48	0,56%	1.935,277,303,73	0,01%	9º III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	183.921,76	0,43%	122,807,724,15	0,15%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	329.063,12	0,76%	1.128,762,122,57	0,03%	10º I

Investimentos

\$ 43.048.677,08

Disponibilidades Financeiras

\$ 2.312.258,27

Total Carteira

\$ 45.360.935,35

Governança (Pró Gestão)

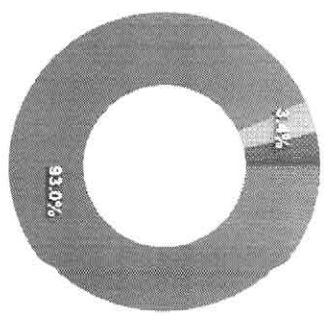
INÍ NÍVEL 2 29/09/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Utilizado	Limite
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	81,82%	35.220.549,18	18,18%	7.828.127,90
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	11,14%	4.794.078,13	58,86%	25.339.995,83
8º I - Fundos de Ações	40,00%	3,43%	1.475.550,50	36,57%	15.743.920,33
9º III - Ações - BDR Nivel I	10,00%	2,43%	1.045.514,39	7,57%	3.259.353,32
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	1,19%	512.984,88	8,81%	3.791.882,83

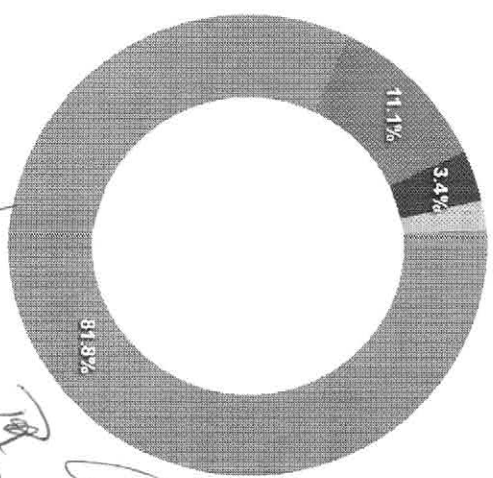
Governança (Pró Gestão)

29/09/2024

Segmentos



Artigos



[Handwritten signatures and initials]

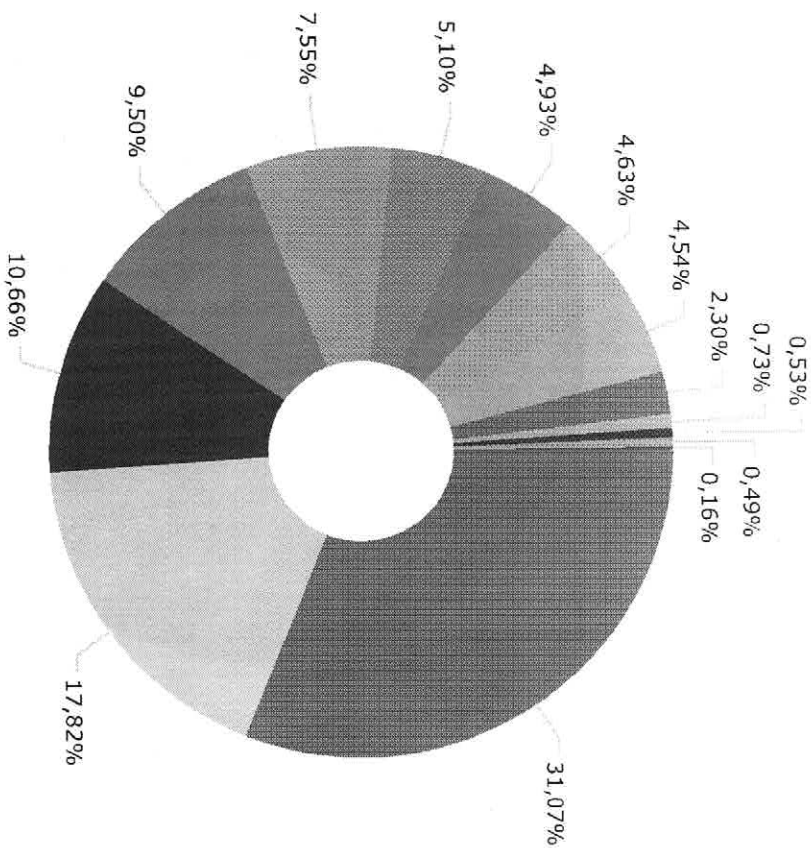
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	43.048.677,08	8º I - Fundos de Ações	3,43%	0,00%	15,00%	40,00%	15.743.920,33
7º I b - FI 100% Títulos TN	81,82%	0,00%	61,00%	100,00%	7.828.127,90	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	17.219.170,83
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	43.048.677,08	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.304.867,71
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.152.433,85	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.304.867,71
7º III a - FI Referenciados RF	11,14%	0,00%	10,00%	70,00%	25.339.995,83	9º III - Ações - BDR Nivel I	2,43%	0,00%	5,00%	10,00%	3.259.153,32
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	70,00%	30.134.073,96	10º I - Fundos Multimercados	1,19%	0,00%	2,00%	10,00%	3.791.882,83
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	8.609.735,42	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.152.133,85
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	4.304.867,71	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.152.133,85
7º V b - Fundos de RF - Crédito...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	4.304.867,71	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	4.304.867,71
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	4.304.867,71	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.304.867,71



	Mes	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mes	Volatilidade - Mes
CDI - BENCHMARK								
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIARIO LP	1.00	11.02	3.14	6.55	13.42	26.45	0.01	0.02
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0.99	10.95	3.15	6.60	13.35	26.71	0.01	0.02
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIARIO	0.96	10.96	3.07	6.61	13.28	26.47	0.01	0.05
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO	0.90	10.10	2.88	6.02	12.28	23.94	0.01	0.02
	0.26	8.74	1.03	4.01	10.26	23.01	1.15	2.41
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	-1.57	15.39	-1.87	6.65	18.36	-16.13		
	-1.40	14.42	-2.16	6.20	16.47	-17.58	7.82	16.48
IBOVESPA - BENCHMARK								
BB TECNOLOGIA FIAÇÕES BDR NIVEL I	-2.94	3.11	-7.22	8.34	-2.49	9.32		
	-1.85	27.41	-3.16	16.51	10.47	-13.23	8.86	18.63
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIAÇÕES	-6.28	7.38	-11.39	5.29	-0.93	10.47	8.81	18.59
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIAÇÕES	-5.73	5.39	-9.05	8.04	-1.21	13.64	9.21	19.46
BB SELEÇÃO FATORIAL FIAÇÕES	-2.90	1.40	-6.64	8.29	-5.16	2.67	6.91	14.72
BB AGRO FIAÇÕES	-6.36	-3.15	-7.40	4.69	-10.64	0.12	8.71	18.40
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIAÇÕES	-5.29	0.47	-9.76	7.47	-10.82	-1.56	8.31	17.56
IBX - BENCHMARK								
CLARITAS VALOR FEEDER FIAÇÕES	-3.03	2.31	-7.11	8.24	-3.47	7.90		
	-5.17	-0.77	-10.10	7.22	-9.52	9.75	9.61	20.31
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIO	-0.41	8.53	0.64	2.92	9.03	22.65		
	-0.33	8.23	0.62	3.00	8.84	22.05	1.31	2.78
IMA-B - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0.66	10.06	-1.97	3.75	8.97	21.40		
	-0.66	9.92	-1.98	3.69	8.75	20.99	3.01	6.32
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIO	-0.67	9.82	-2.03	3.63	8.70	20.76	3.01	6.32
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0.44	3.39	-0.19	1.79	4.21	10.47	0.48	1.00

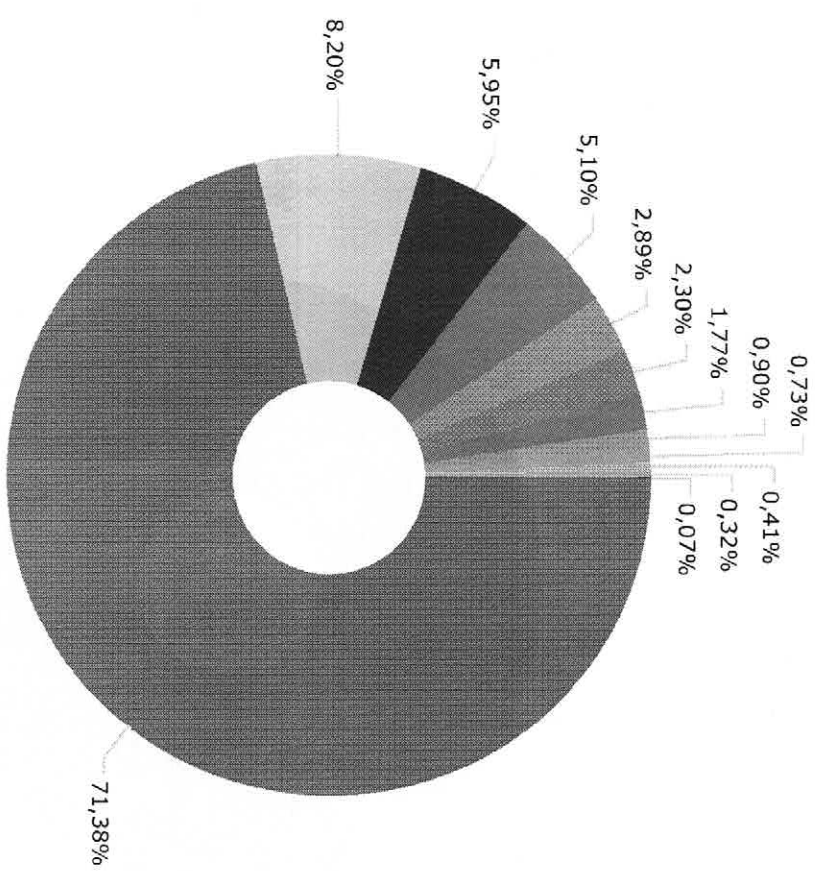
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR - Mes	Volatilidade - Mes
IMA-B 5 - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	1,43	3,01
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,32	8,44	0,39	3,03	9,06	22,79	1,43	3,01
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	-0,33	8,40	0,37	2,99	8,99	22,58	1,43	3,01
IMA-B 5+ - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	4,57	9,63
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,96	10,67	-4,03	3,84	8,00	18,61	4,60	9,68
IPCA - BENCHMARK	0,38	3,89	0,87	1,15	4,97	11,76	0,48	1,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44	9,29	2,46	4,49	10,17	22,83	2,29	4,81
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,21	11,12	-0,14	5,42	9,56	22,83	2,29	4,81
IRF-M - BENCHMARK								
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	1,77	3,73
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,35	11,64	1,22	6,41	12,46	25,72	1,77	3,73
IRF-M 1 - BENCHMARK								
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	0,12	0,25
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	0,92	10,82	2,97	6,45	13,13	25,83	0,12	0,25
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK								
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-2,20	9,23	-8,61	0,58	8,31	-8,94	7,19	15,14
SELLC - BENCHMARK	-1,75	15,73	-7,00	4,28	16,83	7,03	7,19	15,14
SELLC - BENCHMARK								
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	0,01	0,03
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,96	10,78	3,08	6,43	13,12	25,77	0,01	0,03



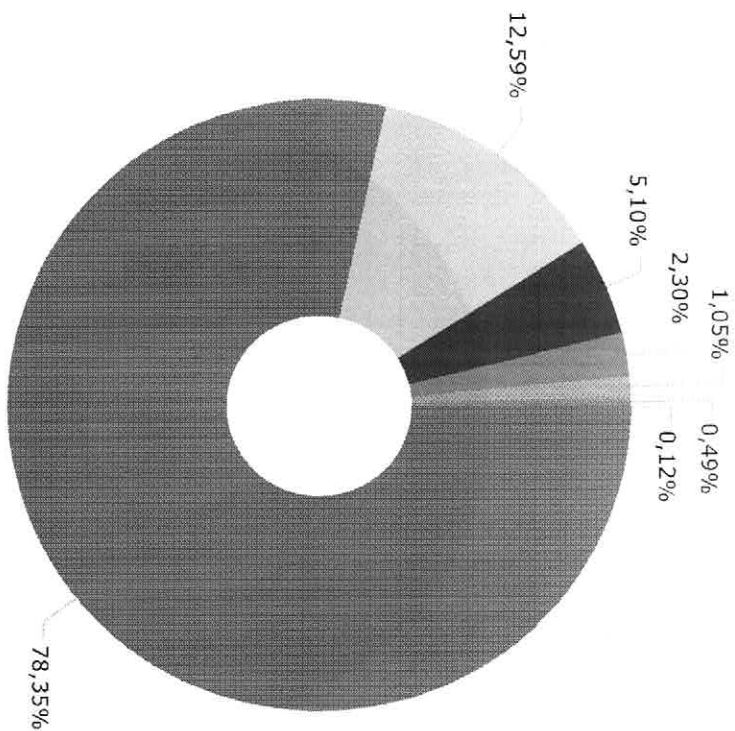


IMA-B	14.094.011,00
IMA-B 5+	8.081.819,38
IMA-B 5	4.835.895,91
CDI	4.307.470,80
IRF-M	3.425.186,50
Disponibilidades Financeiras	2.312.258,27
IDKA IPCA 2Anos	2.234.985,62
IPCA	2.102.234,66
Ibovespa	2.057.546,56
Selic	1.042.626,07
S&P 500 (Moeda Original)	329.063,12
Global BDRX	242.343,48
IBX	221.174,85
IRF-M 1	74.319,13

[Handwritten signatures and initials]

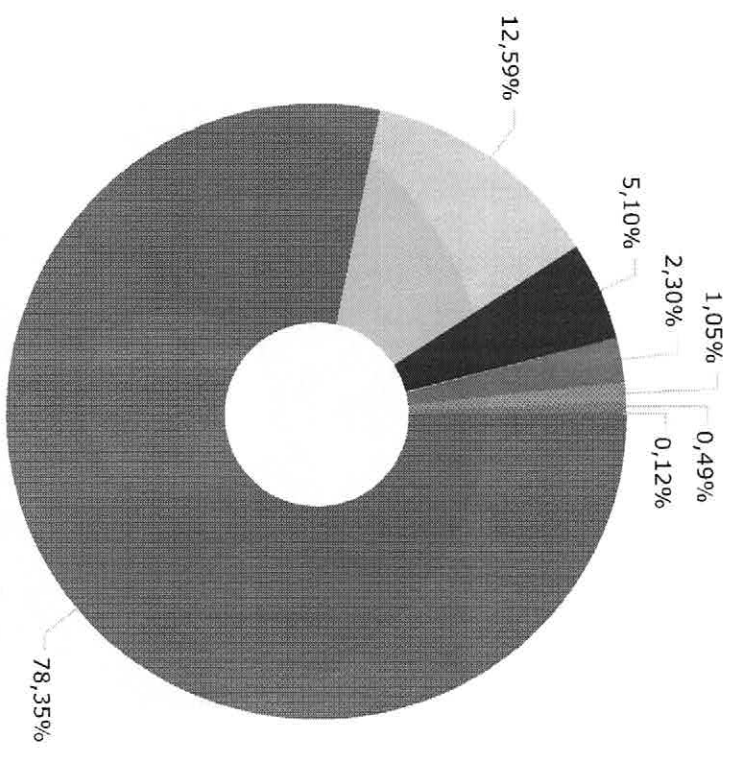


Renda Fixa Indexados	32.376.415,88
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	3.721.017,92
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.698.214,33
Disponibilidades Financeiras	2.312.288,27
Ações Livre	1.309.783,85
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	1.042.616,07
Ações Setoriais	803.110,91
Ações Dividendos	408.110,13
Multimercados Estratégia Específica	329.063,12
Multimercados Livre	183.911,76
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	145.828,97
Renda Fixa Simples	30.424,14



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	35.542.147,30
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.712.259,59
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.312.258,27
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	1.042.626,07
ITAU UNIBANCO S.A.	474.892,09
CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU...	221.174,85
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	55.577,18

(Handwritten signatures and initials)



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	35.542.147,30
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.712.239,59
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.312.238,27
BANCO BRADESCO S.A.	1.042.626,07
ITAU UNIBANCO S.A.	474.892,09
SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRI...	221.174,85
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	55.577,18

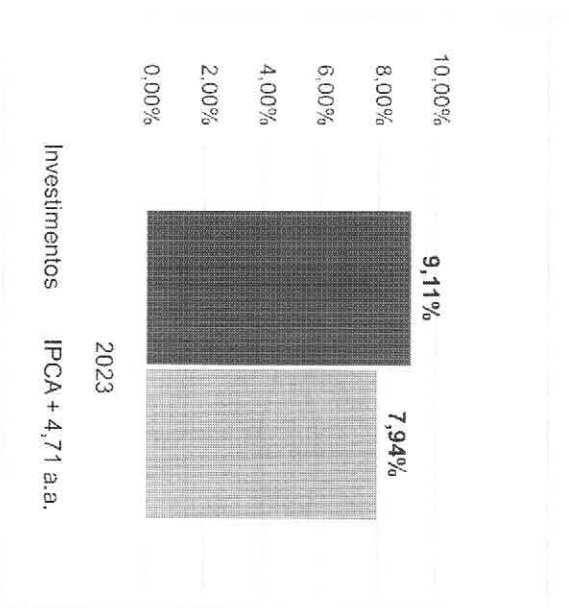
[Handwritten signatures and initials]

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno S	Retorno Acumulado S	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%	189,05%	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	285.286,54	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%
Outubro	42.045.836,50	3.182.494,82	1.914.032,48	43.048.677,08	-265.621,76	3.153.767,86	-0,61% ▼	9,11%	0,77%	7,94%	114,74%	2,78%

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.

Gráfico Risco x Retorno

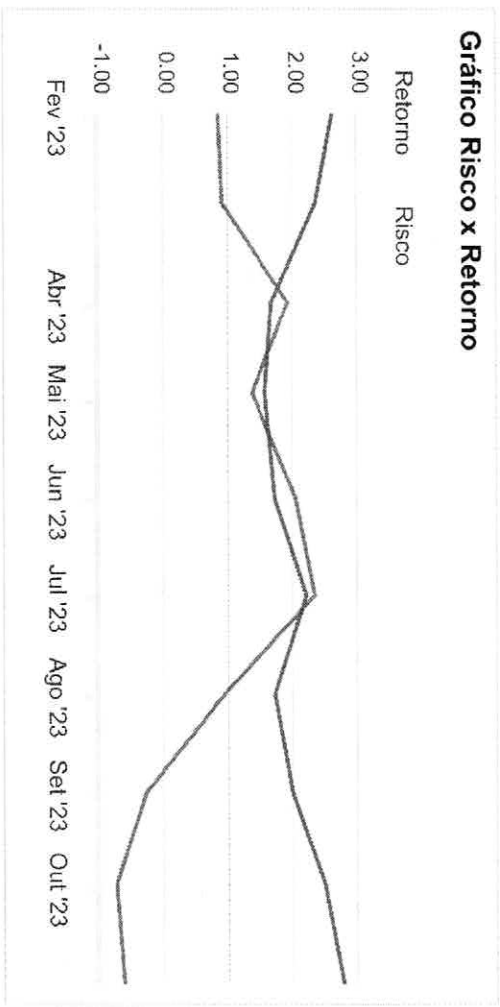
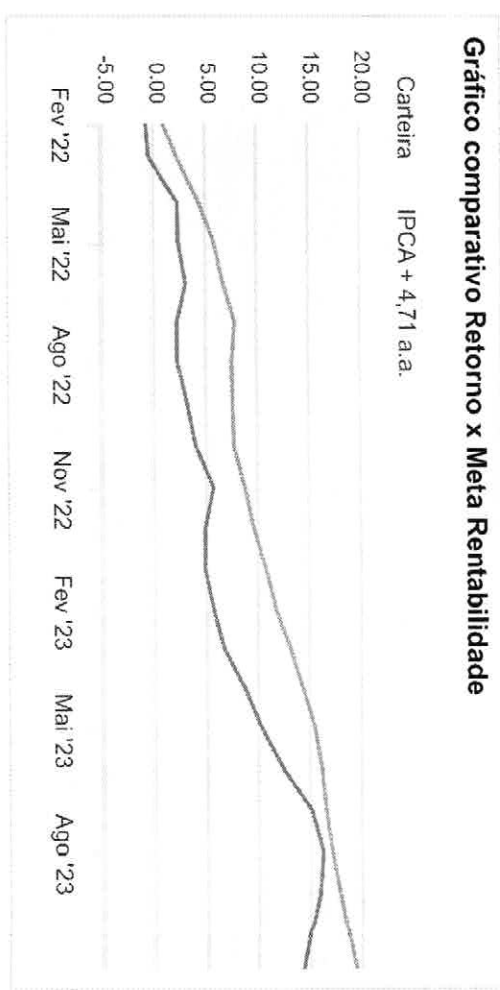
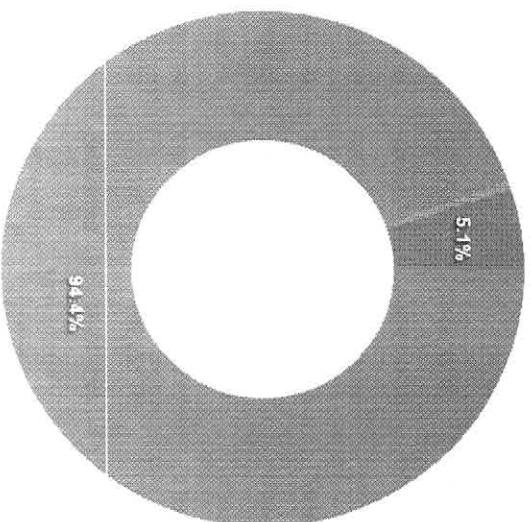


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	42.813.583,15	99,45
Até D+180	221.174,85	0,51
Até D+360	2.326.177,35	5,40
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 at the bottom of the page.

RENDA FIXA		Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VarR
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO		30.152,08	0,00	0,00	30.424,14	272,06	0,90% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		2.242.379,62	0,00	0,00	2.234.985,62	-7.394,00	-0,33% ▼	1,32%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		3.156.747,73	0,00	0,00	3.146.520,37	-10.227,36	-0,32% ▼	1,43%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		6.378.632,41	0,00	0,00	6.315.604,17	-63.028,24	-0,99% ▼	4,60%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		14.673.238,01	0,00	1.914.032,48	12.660.321,09	-98.884,41	-0,67% ▼	3,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		73.638,57	0,00	0,00	74.319,13	680,56	0,92% ▲	0,12%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		3.413.127,24	0,00	0,00	3.425.186,50	12.059,26	0,35% ▲	1,77%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP		1.274.132,36	2.431.864,13	0,00	3.721.027,92	15.031,41	0,41% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		1.947.912,72	0,00	0,00	1.956.405,69	8.492,97	0,44% ▲	0,48%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI		285.906,40	750.630,69	0,00	1.042.626,07	6.088,91	0,59% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		368.165,44	0,00	0,00	369.771,66	1.606,22	0,44% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.639.071,24	0,00	0,00	1.633.798,36	-5.272,88	-0,32% ▼	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.783.372,17	0,00	0,00	1.766.215,21	-17.156,96	-0,96% ▼	4,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		1.071.034,90	0,00	0,00	1.063.918,25	-7.116,65	-0,66% ▼	3,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		368.574,75	0,00	0,00	372.096,98	3.522,23	0,96% ▲	0,02%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA		146.132,95	0,00	0,00	145.828,97	-303,98	-0,21% ▼	2,29%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA		55.761,76	0,00	0,00	55.577,18	-184,58	-0,33% ▼	1,43%
		38.907.980,35	3.182.494,82	1.914.032,48	40.014.627,31	-161.815,38	-0,40%	2,39%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - Var
BBAGRO FIC AÇÕES	216.850,46	0,00	0,00	203.055,70	-13.794,76	-6,36% ▼	8,74%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	435.467,60	0,00	0,00	408.110,13	-27.357,47	-6,28% ▼	8,83%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	390.427,22	0,00	0,00	379.094,17	-11.333,05	-2,90% ▼	6,99%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	168.662,43	0,00	0,00	159.745,43	-8.917,00	-5,29% ▼	8,34%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	110.719,63	0,00	0,00	104.370,22	-6.349,41	-5,73% ▼	9,24%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	233.231,83	0,00	0,00	221.174,85	-12.056,98	-5,17% ▼	9,64%
-	1.555.359,17	0,00	0,00	1.475.550,50	-79.808,67	-5,13%	8,44%



ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	183.449,76	0,00	0,00	183.921,76	472,00	0,26% ▲	1,15%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	334.915,45	0,00	0,00	329.063,12	-5.852,33	-1,75% ▼	7,19%
-	518.365,21	0,00	0,00	512.984,88	-5.380,33	-1,04%	5,02%






INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VAR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NIVEL I	818.349,41	0,00	0,00	803.170,91	-15.178,50	-1,85% ▼	8,85%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	245.782,36	0,00	0,00	242.343,48	-3.438,88	-1,40% ▼	7,82%
	1.064.131,77	0,00	0,00	1.045.514,39	-18.617,38	-1,75%	6,80%






Cenário Econômico

Assim como nos dois últimos meses, o mês de outubro foi mais um de resultados ruins para as carteiras de investimentos. No segmento de renda fixa, resultados mistos. Mais uma vez os fundos atrelados a inflação tiveram desempenho fraco com a continuação da abertura da curva de juros, por outro lado continuaram fazendo um bom trabalho de defesa os fundos atrelados ao CDI que fecharam no positivo. Já no segmento de renda variável, a realidade não foi boa para todos os índices de referência no mercado que fecharam em forte baixa no mês. Em resumo, a grande maioria das carteiras de investimentos experimentaram mais um mês de resultados ruins, mas aquelas que possuem uma boa diversificação ainda conseguem um resultado superior a meta atuarial no ano, com a gordura acumulada no primeiro semestre de 2023.

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

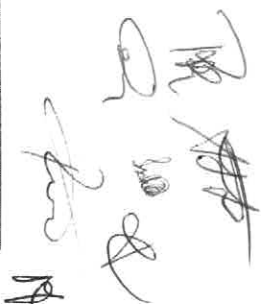
A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

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

Nos segmentos de renda fixa e investimentos estruturados, destacamos mais uma vez os fundos atrelados a inflação que tiveram desempenho fraco com a continuação da abertura da curva de juros, por outro lado continuaram fazendo um bom trabalho de defesa os fundos atrelados ao CDI que fecharam no positivo. Já nos segmentos de renda variável e investimentos no exterior, a realidade não foi boa para a maioria dos índices de referência no mercado que fecharam em baixa no mês.

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, 09 de novembro de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP



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 **Outubro/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.

R
[Handwritten signatures]

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 **Outubro/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.

