



Reunião Ordinária do Conselho Administrativo

Aos 19 (dezenove) dias do mês de abril de dois mil e vinte e dois, às 8:30 horas, na sede do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Piracaia IPSPMP-PIRAPREV, sito a Rua Dona Elza Peçanha de Godoy, 170 Vila Elza, Piracaia SP. Reuniram-se a Senhora Claudia Leoncio da Silva, Superintendente do IPSPMP Piraprev e os membros do Conselho Administrativo, nomeados através dos Decretos nº 4.815 de 11 de dezembro de 2020, nº 4.856 de 10 de fevereiro de 2021, nº 5.035 de 21 de setembro de 2021 e nº 5.050 de 26 de outubro de 2021. Presentes os membros Ronaldo Vasques, Fábio Piola, Renata Suyama da Silva, Ana Paula Silva Pinto Ascêncio Bruno e Tatiana Guimarães Moreira de Almeida. Presentes também: Sandra Cristina dos Santos, Coordenadora Administrativa e de Seguridade, Robson Adão Martins Ribeiro, Auxiliar Financeiro e Anna Caroline Pacelli, Auxiliar de Seguridade. Ausentes por motivo de férias a Senhora Livia Silva Pereira Ferreira e por motivo de saúde com apresentação de atestado médico a Senhora Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva. Com quórum suficiente para deliberação a reunião foi iniciada às 8:50 horas. Sra. Claudia abre a reunião cumprimentando e agradecendo a todos pela presença, passando ao primeiro tema abordado: **1) Apresentação do cenário econômico, posição de ativos e enquadramento da Carteira de investimentos do Piraprev no site da LDB:** Primeiramente a Sra. Claudia discorreu sobre fatos relevantes que impactam o mercado financeiro, nacional e internacional, conforme segue:

Covid

Dados de contágios e mortes por Covid19 no Brasil se mantem em queda significativa. O mundo está em estado de atenção pelo número de contágios na China.

Cenário Político Econômico

No âmbito fiscal, os números continuam positivos no país, permanecendo as incertezas em relação a parte político econômico.

Selic e Inflação

BACEN sinalizou o encerramento do ciclo de alta da Selic, porém com a divulgação da inflação oficial apresentada na semana passada de 1,62% em março, a maior para o mês desde 1994, Campos Neto se mostrou aberto a analisar o cenário, dando a entender que “enterrou” a ideia de elevar a Selic apenas até 12,75%, na reunião de maio.

EUA

Nos EUA, a tese é de queda no desemprego e previsão do PIB americano para este ano em 3,2%, crescimento maior do que o visto nos 06 anos que antecederam a pandemia (2014 a 2019). O ponto de atenção são os índices de inflação por lá, que ainda permanecem bem acima do previsto. O FED elevou os juros em 0,25%, com a promessa explícita de novas altas nas seis próximas reuniões no ano e projetou mais inflação (estimativa saiu 2,6% para 4,3%) e menos crescimento (de 4,0% para 2,8%), mostrando como teremos um ano difícil de transição pela frente,



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Piracaia – PIRAPREV

Guerra

A guerra entre Rússia e Ucrânia fez “cair por terra” algumas afirmações consideradas “verdades irretocáveis”

Verdade 1 – “Acumular uma grande quantidade de reservas é garantia de segurança macroeconômica para qualquer país.” A Rússia possui US\$ 650 bilhões de reservas internacionais. Desse total, US\$ 400 bilhões encontram-se investidos em títulos de países ocidentais, US\$ 90 bi em ativos chineses, US\$ 150 bi em ouro e o restante em outros ativos. Da noite para o dia, nada menos que 61% das reservas russas foram bloqueadas pelos países da OTAN, mostrando que essa chamada “garantia” é altamente relativa. Somente as reservas em yuan e ouro (mesmo para esse, a rigor, precisaria arrumar comprador) podem ser utilizadas nesse momento. De que valeu a Rússia ter realizado o esforço de juntar reservas por tanto tempo?

Verdade 2 – “Dólar e euro são reservas de valor inexpugnáveis” O bloqueio das reservas na Rússia pode criar um efeito bumerangue em moedas consideradas “intocáveis” anteriormente. Estar posicionado em dólar e euro hoje em dia passou a ser algo não tão tranquilo como no passado. Moedas como yuan ou até mesmo as commodities passam a ser opções viáveis para assumir esse posto.

Verdade 3 – “Dinheiro saiu de várias partes do mundo em direção a ações de crescimento em detrimento dos países de commodities” As bolsas (em dólar) do Brasil, Chile e África do Sul (proxy de commodities) vêm performando em 2022 bem acima do S&P e da Nasdaq.

Figura 1: Tabela das cinco bolsas em 2022

Bolsas no Trimestre	Moeda doméstica	Em dólar	Varição Cambial (DÓLAR/MOEDA)
Ibovespa	14,5%	34,6%	17,6%
IPSA (Chile)	14,8%	24,3%	8,3%
BMV (México)	8,1%	11,4%	3,1%
JSE (África do Sul)	-0,2%	9,0%	9,3%
FTSE (Inglaterra)	1,8%	-1,4%	-3,1%
S&P 500	-5,0%	-5,0%	-
NASDAQ	-9,1%	-9,1%	-
CAC-40 (França)	-6,9%	-9,4%	-2,7%
DAX (Alemanha)	-9,3%	-11,7%	-2,7%

Fonte: Investing

Petróleo e gás

A alta no preço dos combustíveis vai além dos gastos para encher o tanque. Desde o último anúncio de reajuste feito pela Petrobras, de 18,8% na gasolina e 24,9% no diesel, vários aumentos foram anunciados. Brasil movimenta mais de 60% de suas cargas por rodovias, em caminhões movidos a diesel. Adriano Depentor, Presidente do Sindicato das Empresas de Transportes de Carga de São Paulo (Setcesp), afirma que a entidade aconselhou seus associados a reajustarem o frete entre 14% e 15%. “A orientação é repassar os aumentos para manter as contas saudáveis” diz o executivo, destacando que as companhias têm contratos de longo prazo com clientes. Em 12 meses, diz, o valor do frete por quilômetro subiu entre 20% e 28% por causa da inflação e da mão de obra.

- Passagens aéreas nacionais até 62%
- Passagens aéreas internacionais até 32%
- Tarifas de viagens por aplicativos subiram até 6%
- Entregas por delivery, até 50%



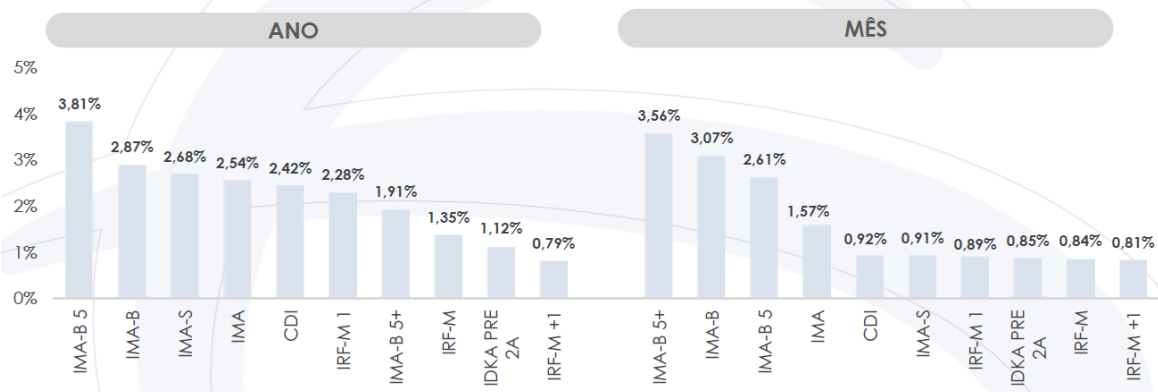
Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Piracaia – PIRAPREV

- Empresas de transporte público reivindicam aumentos de cerca de 20%.
- Transporte Escolar 20%
- Bares e restaurantes: 38% com prejuízos e 60% declaram estar no vermelho porque não conseguiram repassar aumentos de custos para o cardápio.

Fonte: jornal *O Estado de S. Paulo*.

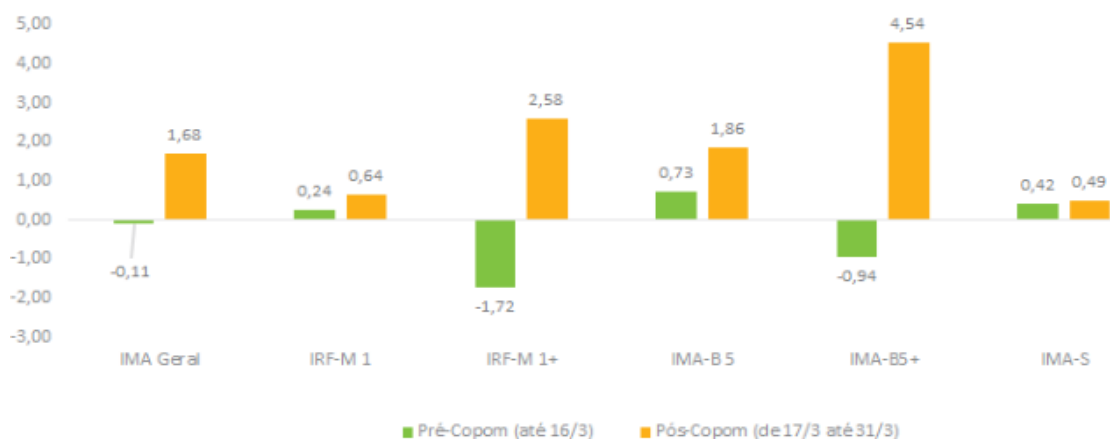
Renda Fixa

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Bradesco Asset

Variação do IMA e de seus subíndices em março/22 (%)



Fonte: ANBIMA



**Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV**

Renda Variável

Ainda persiste o conflito entre Rússia e Ucrânia, o que manteve o fluxo de investidores para economias emergentes, o que corroborou com um mês muito bom para o IBOVESPA. No curto, a nossa previsão é de volatilidade, tendo em vista o cenário de PIB baixo, incertezas políticas e alta da SELIC por aqui.

Renda variável internacional

Na RV Internacional, apesar da forte realização ocorrida até o momento, a projeção de crescimento Global maior do que esperamos para o Brasil mantém a nossa visão positiva para os investimentos offshore, pelo potencial retorno e equilíbrio (hedge) que esses investimentos trazem para a carteira dos RPPS.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	MARÇO	2022	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	3,58%	-4,95%	14,03%	75,29%	59,84%
MSCI WORLD USD	2,45%	-5,53%	8,58%	64,79%	44,85%
IDIV	10,00%	15,48%	11,66%	55,59%	43,49%
IBOVESPA	6,06%	14,48%	2,89%	64,34%	25,77%
SMALL CAPS	8,80%	6,68%	-9,83%	48,41%	30,66%
IBRX100	5,96%	14,89%	2,79%	66,70%	29,68%

Índices

	CDI	IRF-M	IMA Geral	IMA-B	IMA-B 5	Dólar	Ibovespa	IBX	SMLL
Março	0.92%	0.84%	1.57%	3.07%	2.61%	-7.81%	6.06%	5.96%	8.81%
2022	2.42%	1.35%	2.54%	2.87%	3.81%	-15.10%	14.48%	14.89%	6.69%
12 meses	6.41%	2.19%	4.91%	4.50%	8.72%	-16.84%	2.89%	2.79%	-9.80%

Fonte: BNP Paribas

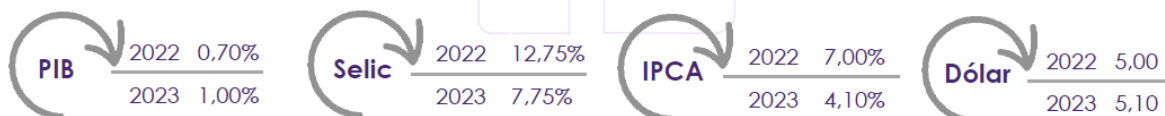
Projeções

Projeções atualizadas de PIB, IPCA e SELIC da Safra Asset:

Ano 2022: PIB de 0,7%, SELIC de 13,25% e IPCA de 8%

Ano 2023: PIB de 1,9% , SELIC de 9,25% e IPCA de 4,5%

PROJEÇÕES BRADESCO ASSET MANAGEMENT



As projeções expressas neste relatório são apenas indicativas e não são garantidas de forma alguma.



Em seguida o Sr. Robson fez a apresentação da carteira de Investimentos do PIRAPREV no site da LDB, onde podemos verificar que o mês de março foi encerrado com rentabilidade positiva de 2,07%, acima da meta atuarial de 0,03%, com um Patrimônio Líquido total de R\$ **120.523.509,36** (cento e vinte milhões, quinhentos e vinte e três mil, quinhentos e nove reais e trinta e seis centavos). Apresentou a rentabilidade por Artigo e Análise de liquidez, sendo 42,61% da carteira com liquidez de até 30 dias. Na alocação por Artigo verificou-se o enquadramento de todos os segmentos pela Resolução 4.963, A análise de risco x retorno demonstra VaR de 0,49% na Renda Fixa, 8,56% na Renda Variável, 7,33% em Investimentos Estruturados, 9,46% em Investimentos no Exterior e 0,18% em Fundos Imobiliários. Em relação aos demais critérios, os investimentos são aderentes à Política de Investimentos do PIRAPREV/2022 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução CMN 4.963/2021. Abaixo o relatório completo do mês de março. **Item APROVADO.**





Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Piracaia – PIRAPREV

Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.03.2022.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 66,90%

Artigo 7º I, Alinea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,315000%)	2,79	1,72	3,96	20.910.571,46	17,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,510000%)	0,44	1,74	4,01	23.932.797,12	19,86
Sub-total Artigo 7º I, Alinea a		0,44	1,73	3,99	44.843.368,58	37,21

Artigo 7º I, Alinea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6,11	2,96	2,39	3.077.527,78	2,55	466.865.839,19	0,66
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,54	3,03	2,77	1.999.012,27	1,66	557.700.648,72	0,36
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	6,46	2,78	2,10	4.626.683,43	3,84	280.176.227,49	1,65
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,63	2,34	3,12	3.942.914,61	3,27	766.723.484,51	0,51
BB	BB	BB PREV IPCA III	1,90	2,40	3,93	2.693.896,05	2,24	594.892.242,95	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,43	2,66	3,71	1.572.272,00	1,30	1.742.591.187,52	0,09
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,16	1,16	2,64	3.162.181,45	2,62	2.425.114.860,62	0,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,60	1,15	2,48	3.436.443,76	2,85	1.494.835.298,11	0,23
Sub-total Artigo 7º I, Alinea b			4,08	2,27	2,84	24.510.931,35	20,34		

Artigo 7º III, Alinea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,02	0,81	2,14	3.927.221,28	3,26	856.892.157,53	0,46
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,12	3,50	3,14	2.628.996,41	2,18	452.865.096,70	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,58	3,06	2,77	61.098,33	0,05	2.362.599.114,39	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,79	1,48	2,84	434.612,11	0,36	1.683.932.732,54	0,03

1 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,22	1,90	2,44	7.051.928,13	5,85		
Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3,33	0,51	0,51	4.219.586,03	3,50	0,00	
Sub-total Artigo 7º IV			3,33	0,51	0,51	4.219.586,03	3,50		
Renda Fixa			1,70	1,90	3,42	80.625.814,09	66,90		

2 de 28



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 15,24%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	19,09	6,14	14,45	214.643,59	0,18	49.169.980,31	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,39	8,57	7,01	275.742,26	0,23	890.450.777,50	0,03
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	4,30	9,13	7.406.166,83	6,14	581.600.329,35	1,27
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,68	5,54	5,66	7.094.725,05	5,89	2.555.347.096,74	0,28
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	21,31	6,02	11,09	1.459.106,27	1,21	672.872.597,72	0,22
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	20,29	4,18	11,01	957.403,30	0,79	1.013.403.393,50	0,09
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	18,35	6,57	8,21	960.899,93	0,80	147.931.366,25	0,65
Sub-total Artigo 8º I			18,13	5,11	7,99	18.368.687,23	15,24		
Renda Variável			15,33	5,11	7,99	18.368.687,23	15,24		

3 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,16%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	20,90	1,24	-12,71	1.645.109,45	1,36	399.812.973,35	0,41
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,26	0,11	-14,26	1.174.373,72	0,97	121.056.696,85	0,97
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	23,39	-16,91	-32,05	957.258,20	0,79	144.927.205,46	0,66
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,54	-8,17	-31,93	862.537,44	0,72	813.691.529,92	0,11
VINCI	BEM	VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14,12	-6,02	-16,79	726.673,34	0,60	131.470.921,79	0,55
Sub-total Artigo 9º II			15,39	-5,24	-21,13	5.365.952,15	4,45		

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,89	-4,11	-19,62	1.757.148,92	1,46	2.671.897.209,12	0,07
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	18,50	-4,53	-21,86	1.511.653,55	1,25	2.224.682.241,76	0,07
Sub-total Artigo 9º III			18,27	-4,30	-20,67	3.268.802,47	2,71		

Investimentos no Exterior			15,72	-4,89	-20,95	8.634.754,62	7,16		
---------------------------	--	--	-------	-------	--------	--------------	------	--	--

4 de 28



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,62%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	14,82	4,58	-3,00	10.379.143,70	8,61	1.503.624.719,70	0,69
Sub-total Artigo 10º I			14,82	4,58	-3,00	10.379.143,70	8,61		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VINCI	BEM	VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	76,84	-10,12	-10,26	2.419.245,56	2,01	98.102.740,42	2,47
Sub-total Artigo 10º II			76,84	-10,12	-10,26	2.419.245,56	2,01		

Investimentos Estruturados			24,52	3,77	-2,62	12.798.389,26	10,62		
----------------------------	--	--	-------	------	-------	---------------	-------	--	--

5 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA		Data Extrato: 31/03/2022							
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS									
FUNDOS IMOBILIÁRIOS								0,08%	
Artigo 11* (Fundo de Investimento Imobiliário)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	KINEA	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	75,38	-1,10	11,53	95.864,16	0,08	23.431.481,23	0,41
Sub-total Artigo 11*			75,38	-1,10	11,53	95.864,16	0,08		
Fundos Imobiliários			137,67	-1,10	11,53	95.864,16	0,08		
Total			4,48	2,07	1,25	120.523.509,36	100,00		

6 de 28



Carteira: PIRACAIA		Data Extrato: 31/03/2022						
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS								
Enquadramento da Carteira								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alinea a	Títulos do Tesouro Nacional	44.843.368,58	37,21	0,00	37,77	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alinea b	Fundos 100% Títulos Públicos	24.510.931,35	20,34	0,00	10,69	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alinea a	Fundos Renda Fixa	7.051.928,13	5,85	0,00	18,99	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	4.219.586,03	3,50	0,00	0,00	20,00	0,00	20,00
Total Renda Fixa		80.625.814,09	66,90					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.368.687,23	15,24	0,00	14,59	35,00	0,00	35,00
Total Renda Variável		18.368.687,23	15,24					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	5.365.952,15	4,45	0,00	5,91	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	3.268.802,47	2,71	0,00	3,51	10,00	0,00	10,00
Total Investimentos no Exterior		8.634.754,62	7,16					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.379.143,70	8,61	0,00	7,30	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	2.419.245,56	2,01	0,00	1,12	5,00	0,00	5,00
Total Investimentos Estruturados		12.798.389,26	10,62					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	95.864,16	0,08	0,00	0,13	5,00	0,00	5,00
Total Fundos Imobiliários		95.864,16	0,08					5,00

7 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alinea a % do CDI	1,73 187,14	3,99 164,49	3,99 164,49	8,61 199,70	16,71 260,54	761.803,63	1.730.618,57
Artigo 7º I, Alinea b % do CDI	2,27 245,40	2,84 117,28	2,84 117,28	3,68 85,37	4,50 70,12	548.891,26	689.555,61
Artigo 7º III, Alinea a % do CDI	1,90 206,00	2,44 100,82	2,44 100,62	3,45 79,99	3,92 61,11	159.027,04	204.763,39
Artigo 7º IV % do CDI	0,51 196,01	0,51 196,01				21.618,16	21.618,16
Artigo 9º I Var. IBOVESPA p.p.	5,11 -0,95	7,99 -6,49	7,99 -6,49			892.655,65	1.358.315,66
Artigo 9º II % do CDI	-5,24 -567,17	-21,13 -871,40	-21,13 -871,40	-17,38 -403,11	-17,99 -280,55	-296.575,27	-1.437.363,04
Artigo 9º III % do CDI	-4,30 -466,08	-20,67 -852,43	-20,67 -852,43	-11,11 -257,68	-7,02 -109,49	-147.016,64	-851.578,88
Artigo 10º I % do CDI	4,58 495,90	-3,00 -123,59	-3,00 -123,59			450.955,05	-274.191,80
Artigo 10º II % do CDI	-10,12 -1.095,79	-10,26 -423,36	-10,26 -423,36			57.609,34	54.650,92
Artigo 11º % do CDI	-1,10 -119,10	11,53 475,74	11,53 475,74			-1.066,05	13.094,97
PIRACAIA (Total)						2.447.902,17	1.509.483,56

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alinea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,315000%)	20.557.110,42	0,00	0,00	0,00	20.910.571,46	353.461,04	797.012,77
NTN-B 150826 (5,510000%)	23.524.454,53	0,00	0,00	0,00	23.932.797,12	408.342,59	933.605,80
					44.843.368,58	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alinea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

8 de 28



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA III	2.630.682,67	0,00	0,00	0,00	2.693.896,05	63.213,38	102.716,70
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	1.940.211,95	0,00	0,00	0,00	1.999.012,27	58.800,32	53.947,57
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.531.554,00	0,00	0,00	0,00	1.572.272,00	40.718,00	56.539,76
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	5.417.051,75	0,00	-2.036.942,92	0,00	3.436.443,76	56.334,93	133.325,58
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	3.187.777,38	0,00	-62.000,00	0,00	3.162.181,45	36.404,07	72.261,77
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2.989.052,67	0,00	0,00	0,00	3.077.527,78	88.475,11	71.842,76
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	4.501.323,28	0,00	0,00	0,00	4.626.683,43	125.360,15	95.364,44
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3.155.259,78	708.069,53	0,00	0,00	3.942.914,61	79.585,30	103.557,03
					24.510.931,35	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alinea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	59.281,60	0,00	0,00	0,00	61.098,33	1.816,73	1.647,77
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	941.014,66	0,00	-513.400,00	0,00	434.612,11	6.997,45	21.958,76
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4.014.233,86	0,00	-1.500.000,00	0,00	2.628.996,41	114.762,55	100.951,30
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	4.838.483,08	553.287,89	-1.500.000,00	0,00	3.927.221,28	35.450,31	80.205,56
					7.051.928,13	0,00	0,00

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA	0,00	4.197.967,87	0,00	0,00	4.219.586,03	21.618,16	21.618,16
					4.219.586,03	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	253.985,73	0,00	0,00	0,00	275.742,26	21.756,53	18.069,77
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.722.161,39	0,00	0,00	0,00	7.094.725,05	372.563,66	380.210,73
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	202.231,92	0,00	0,00	0,00	214.643,59	12.411,67	27.092,32
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.376.207,14	0,00	0,00	0,00	1.459.106,27	82.899,13	145.605,69

9 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	901.622,24	0,00	0,00	0,00	960.899,93	59.277,69	72.900,57
VINCI MOSAICO FIA	918.972,19	0,00	0,00	0,00	957.403,30	38.431,11	94.963,73
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	7.100.850,97	0,00	0,00	0,00	7.406.166,83	305.315,86	619.472,85
					18.368.687,23	0,00	0,00
Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	1.624.988,33	0,00	0,00	0,00	1.645.109,45	20.121,12	-239.540,02
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.173.090,29	0,00	0,00	0,00	1.174.373,72	1.283,43	-195.239,37
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.152.005,17	0,00	0,00	0,00	957.258,20	-194.746,97	-451.447,81
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	939.255,35	0,00	0,00	0,00	862.537,44	-76.717,91	-404.536,05
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	773.188,28	0,00	0,00	0,00	726.673,34	-46.514,94	-146.599,79
					5.365.952,15	0,00	0,00
Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.832.497,43	0,00	0,00	0,00	1.757.148,92	-75.348,51	-428.800,10
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1.583.321,68	0,00	0,00	0,00	1.511.653,55	-71.668,13	-422.778,78
					3.268.802,47	0,00	0,00
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	9.828.188,65	100.000,00	0,00	0,00	10.379.143,70	450.955,05	-274.191,80
					10.379.143,70	0,00	0,00
Artigo 10º II (Fundo de Participação)							

10 de 28



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)	
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	1.824.693,30	536.942,92	0,00	0,00	2.419.245,56	57.609,34	54.650,92	
					2.419.245,56	0,00	0,00	
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)								
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	96.930,21	0,00	0,00	0,00	0,00	95.864,16	-1.066,05	13.094,97
						95.864,16	0,00	0,00

11 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	51.350.652,38	42,61	51.350.652,38	42,61
de 31 a 365 dias	17.644.074,79	14,64	68.994.727,17	57,25
acima de 365 dias	51.528.782,19	42,75	120.523.509,36	100,00

12 de 28

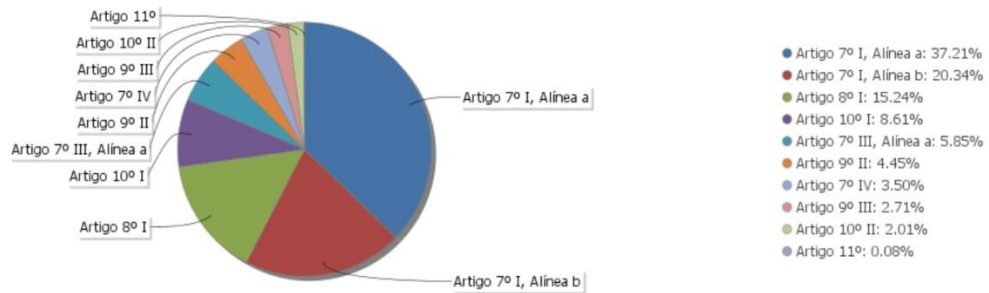


Carteira: PIRACAIA

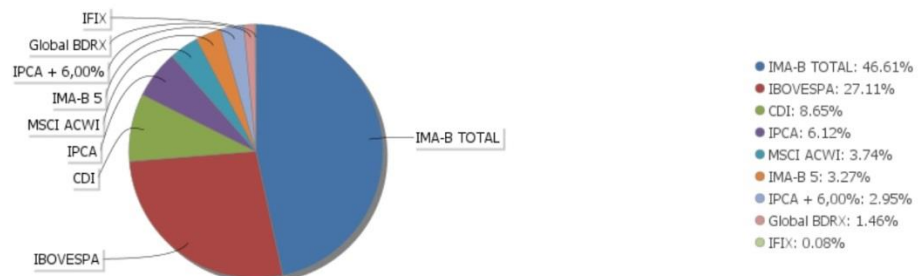
Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



13 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV

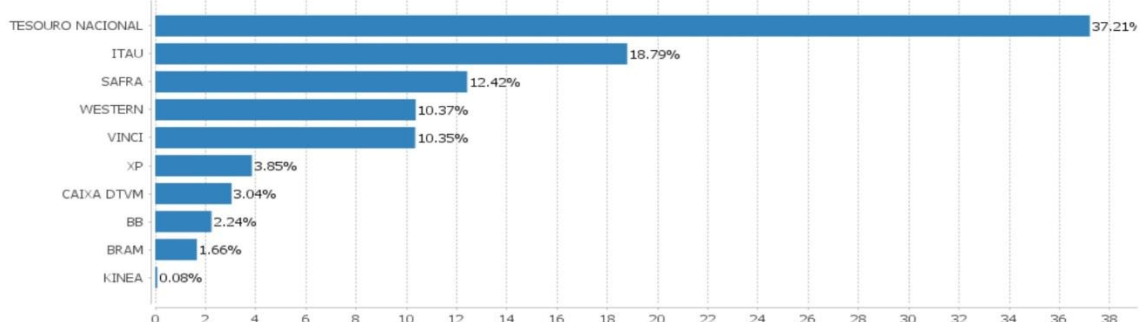


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



14 de 28



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,70	-0,10	2,07										1,25
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04										4,42
p.p. indexador	-1,64	-1,47	0,03										-3,16
2021	-0,04	-0,18	1,36	1,36	1,48	0,55	0,03	-0,07	-0,79	-0,37	0,92	1,87	6,25
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-0,71	-1,42	-0,05	0,63	0,20	-0,42	-1,40	-1,40	-2,40	-2,05	-0,45	0,65	-9,75
2020	0,99	-1,89	-6,31	3,61	1,93	2,26	2,71	1,12	-1,49	-0,17	3,35	3,20	9,21
IPCA + 5,50%	0,68	0,63	0,54	0,11	0,04	0,71	0,85	0,69	1,09	1,31	1,32	1,82	10,24
p.p. indexador	0,31	-2,53	-6,85	3,50	1,89	1,55	1,85	0,44	-2,58	-1,48	2,03	1,37	-1,03
2019	3,15	0,30	0,52	1,27	1,20	2,42	1,40	0,52	1,52	1,46	0,53	2,59	18,22
IPCA + 5,50%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	0,58	0,41	0,59	0,94	1,60	10,07
p.p. indexador	2,36	-0,56	-0,63	0,25	0,60	2,01	0,72	-0,06	1,12	0,87	-0,41	0,99	8,15

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	51,28	03 meses	1,25	4,42	-3,16	5,58
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	48,72	06 meses	3,70	8,93	-5,23	4,97
			12 meses	6,37	17,18	-10,81	4,48
			24 meses	26,58	31,09	-4,51	5,32
Maior rentabilidade da Carteira	3,61	2020-04	36 meses	33,55	42,93	-9,38	7,15
Menor rentabilidade da Carteira	-6,31	2020-03	Desde 31/12/2018	38,90	46,97	-8,08	6,99

15 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



16 de 28

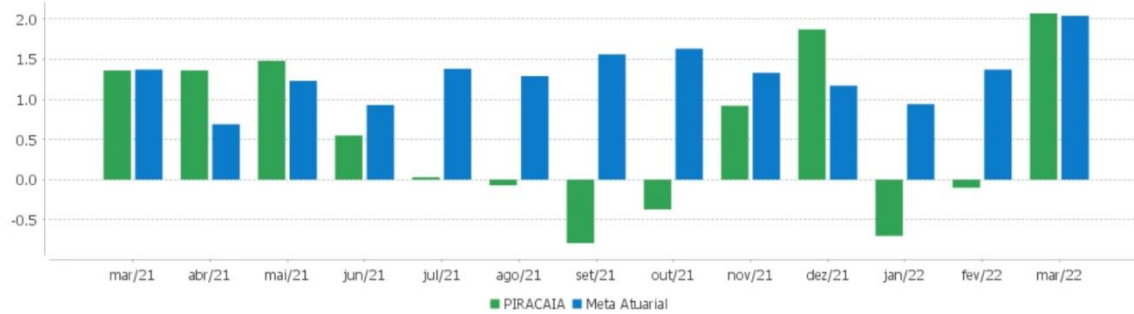


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



17 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
NTN-B 150826 (5,510000%)	1,74	4,01	4,01	8,65	16,75	30,19	42,61
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,34	1,14	1,14	4,69	12,25	14,83	16,71
NTN-B 150535 (5,315000%)	1,72	3,96	3,96	8,55	13,39	19,51	23,76
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,35	1,09	1,09	4,59	8,89	4,16	-2,14
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,34	3,12	3,12	4,63	5,77	14,14	27,47
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,27	-0,70	-0,70	-1,30	-2,94	-3,82	-1,50
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	2,78	2,10	2,10	2,50	1,38	11,14	23,87
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,29	-0,77	-0,77	-1,47	-3,12	-4,22	-2,03
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,66	3,71	3,71	5,82	8,43	17,58	31,55
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,41	0,84	0,84	1,86	3,93	2,22	5,65
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,96	2,39	2,39	2,10	1,52	10,59	21,32
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,11	-0,48	-0,48	-1,86	-2,98	-4,77	-4,58
BB PREV IPCA III	2,40	3,93	3,93	5,90	9,02	18,08	28,30
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,28	-0,76	-0,76	-3,47	-8,36	-14,54	-16,99
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,15	2,48	2,48	4,35	8,09	12,01	26,80
% do CDI	124,75	102,19	102,19	100,80	138,65	136,71	182,24
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB	3,03	2,77	2,77	3,77	4,13	14,54	24,58
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,10	-0,10	-0,19	-0,37	-0,81	-1,32
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,16	2,64	2,64	4,85	6,92	9,12	19,76
Var. IPCA p.p.	-0,46	-0,56	-0,56	-1,40	-4,38	-8,97	-2,22
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	3,50	3,14	3,14	3,53	5,19	15,35	28,99
% do CDI	378,77	129,63	129,63	81,87	80,98	174,83	197,09
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3,06	2,77	2,77	3,78	4,26	14,68	24,65
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01	-0,10	-0,10	-0,18	-0,25	-0,68	-1,25
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,81	2,14	2,14	3,02	5,70	9,42	16,36
% do CDI	88,05	88,40	88,40	90,91	88,87	107,29	111,20
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,48	2,84	2,84	5,09	8,86	11,63	
% do CDI	159,88	117,09	117,09	118,05	138,13	132,49	
LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA	0,51	0,51					
Var. IPCA p.p.	0,08	0,08					
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8,57	7,01	7,01	-5,41	-10,49	43,86	24,02
Var. IBOVESPA p.p.	2,51	-7,47	-7,47	-13,54	-13,37	-20,48	-1,75
VINCI MOSAICO FIA	4,18	11,01	11,01	5,41	-0,94	52,43	37,63

18 de 28



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
Var. IBOVESPA p.p.	-1,88	-3,47	-3,47	-2,71	-3,82	-11,90	11,86
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	6,02	11,09	11,09	-4,34	-4,31	35,59	-4,02
Var. IBOVESPA p.p.	-0,04	-3,39	-3,39	-12,47	-7,19	-28,75	-29,78
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	4,30	9,13	9,13	2,27	-0,95	49,89	31,54
Var. IBOVESPA p.p.	-1,76	-5,35	-5,35	-5,86	-3,83	-14,45	5,78
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	6,14	14,45	14,45	7,28	2,06	65,16	29,09
Var. IBOVESPA p.p.	0,08	-0,03	-0,03	-0,84	-0,83	0,83	3,32
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5,54	5,66	5,66	-2,78	-4,38	51,19	24,77
Var. IBOVESPA p.p.	-0,52	-8,82	-8,82	-10,90	-7,26	-13,15	-0,99
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	6,57	8,21	8,21	2,58	2,31	44,21	32,35
Var. IBOVESPA p.p.	0,51	-6,27	-6,27	-5,55	-0,58	-20,13	6,58
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-6,02	-16,79	-16,79	-12,27	-13,07	16,87	33,56
Var. MSCI ACWI p.p.	0,08	3,18	3,18	0,38	-0,96	-29,73	-36,57
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-16,91	-32,05	-32,05	-29,86	-34,66		
Var. MSCI ACWI p.p.	-10,81	-12,08	-12,08	-17,22	-22,54		
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	1,24	-12,71	-12,71	-10,01	0,30	64,20	
Var. MSCI ACWI p.p.	7,33	7,26	7,26	2,63	12,42	17,60	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-8,17	-31,93	-31,93	-30,82	-31,50	23,14	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-10,31	-36,62	-36,62	-40,19	-49,47	-9,49	
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTEC ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,11	-14,26	-14,26	-4,25	1,24	72,76	
Var. MSCI ACWI p.p.	6,20	5,71	5,71	8,40	13,36	26,16	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,11	-19,62	-19,62	-10,12	-7,40	52,03	93,17
Var. Global BDRX p.p.	-0,13	-0,29	-0,29	-0,72	-2,26	-4,80	-5,60
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-4,53	-21,86	-21,86	-12,08	-6,29	49,12	81,53
Var. IBOVESPA p.p.	-10,59	-36,33	-36,33	-20,21	-9,17	-15,22	55,76
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	-10,12	-10,26	-10,26	27,81	21,58	79,10	89,86
Var. IBOVESPA p.p.	-16,18	-24,74	-24,74	19,68	18,70	14,76	64,09
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	4,58	-3,00	-3,00	9,42	20,24	81,76	67,89
Var. IBOVESPA p.p.	-1,48	-17,48	-17,48	1,29	17,36	17,43	42,13
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	-1,10	11,53	11,53	6,80	18,30	2,50	-8,49
Var. IFIX p.p.	-2,52	12,42	12,42	4,43	20,64	-8,96	-20,46
PIRACAIA	2,07	1,25	1,25	3,70	6,37	26,58	33,55
Var. IPCA + 4,88% p.p.	0,03	-3,16	-3,16	-5,09	-10,36	-3,27	-7,18
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77

19 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA		EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS							Data Extrato: 31/03/2022
Fundo		No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	
Variação da Estratégia									
INPC + 6,00%		2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	
IPCA + 6,00%		2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	

20 de 28



Carteira: PIRACAIA		EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS							Data Extrato: 31/03/2022
--------------------	--	-------------------------------	--	--	--	--	--	--	--------------------------

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BB PREV IPCA III	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		0,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+1 du	D+1 du	D+6 du		
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	Não se aplica	Não se aplica				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	Não se aplica	Não se aplica				

21 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/03/2022

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	D+1 du	D+0	D+5 du	D+7 du	-	1,00
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+0	D+0	D+32	D+35	-	1,00
VINCI MOSAICO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,97
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	D+1 du	D+0	D+60	D+62	-	0,97
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du	-	0,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du	-	0,40
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	-	0,40

22 de 28



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76
Índice Consumo - ICON	5,74			-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

23 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

24 de 28



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
339	02/03/2022	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,00	513.400,00	45.211,94972790	11,3554050000
342	02/03/2022	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,00	62.000,00	3.240,96614664	19,1300980000
340	07/03/2022	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,00	536.942,92	40.175,87981810	13,3648080000
331	08/03/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	207.500,00	0,00	14.42251868	14.387,2235234000
332	09/03/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	345.787,89	0,00	23,99100355	14.413,2315824000
343	10/03/2022	VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A	536.942,92	0,00	536,94292000	1.000,0000000000
328	21/03/2022	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	160.128,77	0,00	64.239,23302589	2,4926943000
334	21/03/2022	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	208.497,92	0,00	83.643,59801360	2,4926943000
333	22/03/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,00	1.500.000,00	103,76362193	14.455,9333229000
336	22/03/2022	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	100.000,00	0,00	324,50551031	308,1611770000
338	22/03/2022	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,00	1.500.000,00	129.548,43474831	11,5786810000
341	22/03/2022	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,00	1.500.000,00	111.386,23511184	13,4666550000
345	23/03/2022	LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.197.967,87	0,00	5,00000000	839.593,5748230000
329	24/03/2022	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	302.032,13	0,00	119.766,02983031	2,5218514000
330	31/03/2022	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	30.630,40	0,00	12.117,86593202	2,5277058000
335	31/03/2022	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	6.780,31	0,00	2.682,39682007	2,5277058000
Total			6.096.268,21	5.612.342,92		

25 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



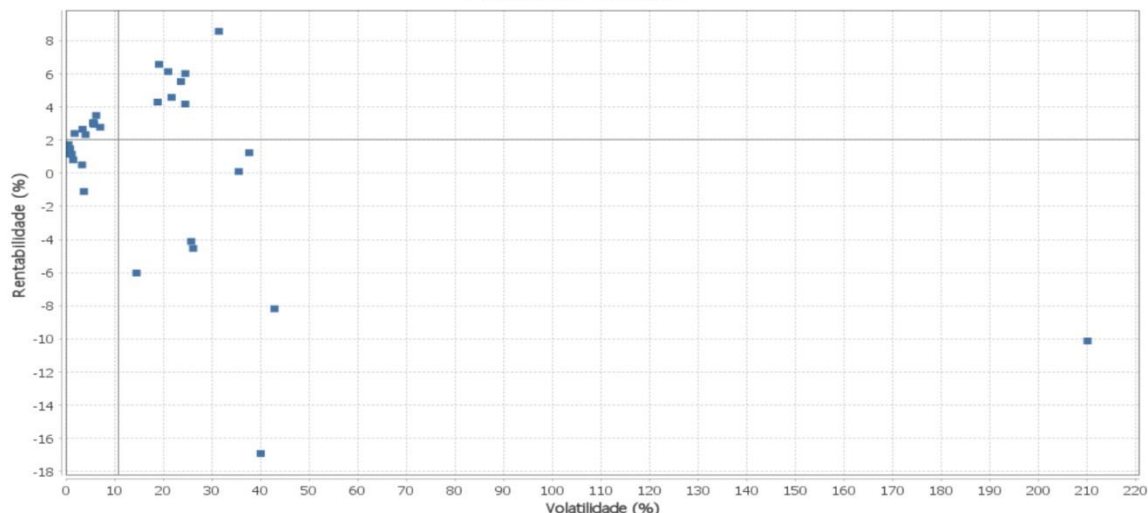
Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



1 de 4



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 2.855.346,80 Value-At-Risk: 2,37%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIRACAIA		2,37	2,37			120.523.509,36	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,49%

Artigo 7º I, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,12	-0,00	1,97				20.910.571,46	17,35
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,12	-0,00	1,97				23.932.797,12	19,86
Sub-total	0,48	0,12	-0,00		1,69	1,73	44.843.368,58	37,21

Artigo 7º I, Alinea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,27	0,03	0,39				3.077.527,78	2,55
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	1,96	0,01	0,01				1.999.012,27	1,66
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	2,56	0,05	0,77				4.626.683,43	3,84
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1,62	0,02	0,73				3.942.914,61	3,27
BB PREV IPCA III	0,80	0,00	0,77				2.693.896,05	2,24
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,40	0,01	1,07				1.572.272,00	1,30
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,37	0,00	0,36				3.162.181,45	2,62
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,78	-0,00	0,78				3.436.443,76	2,85
Sub-total	3,33	1,29	0,12		0,40	2,27	24.510.931,35	20,34

Artigo 7º III, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,57	0,01	0,57				3.927.221,28	3,26
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,30	0,02	2,30				2.628.996,41	2,18

26 de 28



Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Piracaia – PIRAPREV



Carteira: PIRACAIA		EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS							Data Extrato: 31/03/2022
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,00	0,00	0,06			61.098,33	0,05	
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,43	-0,00	0,42			434.612,11	0,36	
Sub-total	3,07	1,08	0,03		0,32	1,90	7.051.928,13	5,85	
Artigo 7º IV									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA		1,41	-0,03	1,45			4.219.586,03	3,50	
Sub-total	3,33	1,41	-0,03		-0,12	0,51	4.219.586,03	3,50	
Renda Variável Value-At-Risk: 8,56%									
Artigo 8º I									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI		9,16	0,01	0,98			214.643,59	0,18	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		13,66	0,02	8,25			275.742,26	0,23	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		8,21	0,42	2,56			7.406.166,83	6,14	
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,84	0,42	5,12			7.094.725,05	5,89	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		10,18	0,10	3,85			1.459.106,27	1,21	
VINCI MOSAICO FIA		10,02	0,06	4,46			957.403,30	0,79	
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		8,37	0,05	3,61			960.899,93	0,80	
Sub-total	21,04	8,56	1,10		0,20	5,11	18.368.687,23	15,24	
Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 7,33%									
Artigo 10º I									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		9,04	0,67	8,90			10.379.143,70	8,61	
Sub-total	21,73	9,04	0,67		0,17	4,58	10.379.143,70	8,61	
Artigo 10º II									

27 de 28



Carteira: PIRACAIA		EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS							Data Extrato: 31/03/2022
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP ME II - CLASSE A		1,13	-0,00	8,73			2.419.245,56	2,01	
Sub-total	210,04	1,13	-0,00		-0,05	-10,12	2.419.245,56	2,01	
Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 9,46%									
Artigo 9º II									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		13,98	0,15	9,88			1.645.109,45	1,36	
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,18	0,10	9,27			1.174.373,72	0,97	
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,08	0,00	12,24			957.258,20	0,79	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		16,50	0,06	16,50			862.537,44	0,72	
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		6,86	0,01	7,77			726.673,34	0,60	
Sub-total	28,38	9,69	0,32		-0,22	-5,24	5.365.952,15	4,45	
Artigo 9º III									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,42	0,08	0,97			1.757.148,92	1,46	
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		10,77	0,08	12,50			1.511.653,55	1,25	
Sub-total	25,69	10,37	0,17		-0,20	-4,30	3.268.802,47	2,71	
Fundos Imobiliários Value-At-Risk: 0,18%									
Artigo 11º									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII		0,18	-0,00	3,32			95.864,16	0,08	
Sub-total	3,74	0,18	-0,00		-0,54	-1,10	95.864,16	0,08	

28 de 28



2) Aquisição de Letras Financeiras do Itaú: Sra. Claudia informou a todos a aquisição de Letras Financeiras Subordinadas de emissão do Banco Itaú, com vencimento para 22/11/2022, a uma taxa de IPCA+5,80%, acima da meta atuarial do Piraprev que é de IPCA+4,88%. O valor total foi de R\$ 4.197.967,87 (quatro milhões, cento e noventa e sete mil, novecentos e sessenta e sete reais e oitenta e sete centavos), referente a 5 (cinco) unidades. Este tipo de investimento em renda fixa é enquadrado como crédito privado, constante na Política de Investimentos do Piraprev. Há capacidade financeira e atuarial para levar os títulos ao vencimento. A diversificação da carteira também foi um motivador para a aquisição. Tendo em vista o processo apreciado pelos conselheiros e os motivos apresentados, além da rentabilidade bastante superior à meta atuarial, os membros aprovaram a aquisição por unanimidade. **Item APROVADO.** Não houve aposentadorias concedidas no mês de março de 2021. **Apresentação dos Processos Licitatórios** pela Coordenadora Administrativa, sendo eles: nº 02/2022 Aquisição de toners para impressoras, nº 03/2022 Aquisição de filtros para purificadores de água e nº 05/2022 Aquisição de material de informática. Após análise dos membros e não havendo questionamentos, os membros aprovaram os processos licitatórios. **Item APROVADO.** **3) Certificação Profissional:** Sra. Claudia perguntou aos membros presentes quanto ao andamento dos estudos para a Certificação Profissional, informando-lhes também que o Dólar Bills, escritório de Agentes Autônomos de Investimento focado em RPPS, disponibilizou a todos os membros dos Conselhos, Comitê e Equipe do Piraprev acesso ao curso gratuito para todas as certificações, sendo mais uma opção de conteúdo e aprendizagem além do já oferecido pela XP Investimentos. O link para cadastro será disponibilizado no grupo de estudos no WhatsApp. Nada mais havendo a tratar a reunião foi encerrada.

Tatiana Guimarães Moreira de Almeida
Presidente

Claudia Leoncio da Silva
Superintendente Interina

Renata Suyama da Silva,

Sandra Cristina dos Santos
Coordenadora Administrativa e de Seguridade

Ana Paula Silva Pinto Ascêncio Bruno

Robson Adão Martins Ribeiro
Auxiliar Financeiro

Fábio Piola

Anna Caroline Pacelli
Auxiliar de Seguridade

Ronaldo Vasques