



Reunião Ordinária do Conselho Administrativo

Aos 19 (dezenove) dias do mês de outubro 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 Ana Paula Silva Pinto Ascêncio Bruno, Renata Suyama da Silva, Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva, Tatiana Guimarães Moreira de Almeida, Fábio Araújo Piola, Ronaldo Vasques e Lívia Silva Pereira Ferreira. Presente também Robson Adão Martins Ribeiro, Auxiliar Financeiro. Com quórum suficiente a reunião foi iniciada às 8:45 horas. Sra. Claudia abre a reunião cumprimentando e agradecendo a todos pela presença, passando a **apresentação dos Processos licitatórios e de Aposentadorias** concedidas. **Item APROVADO.**

Licitações	Empresa	Processo	Homologação	Objeto	Tipo
	LDNTECH Automação Comercial e Tecnologia LTDA.	09/2022	19/09/2022	Aquisição de um leitor biométrico	Dispensa
	WORK-MED Cursos e Treinamentos LTDA	08/2022	13/09/2022	serviços técnicos de Perícia Médica	Dispensa
Aposentadorias	Nome	Processo	Concessão	Tipo	Cargo
	Ana Lucia Watanabe	26/2022	01/10/2022	Aposentadoria por idade e tempo de contribuição	Engenheira Ambiental
	Waldemar Garcia	25/2022	01/10/2022	Aposentadoria por idade	Servente Geral

A seguir foram apresentados os processos de credenciamento da BTG e Vinci Partners, a qual ingressaremos no Fundo Vinci Capital Partners IV, conforme os respectivos processos nº 50 e 51. **Item APROVADO.** Logo após a Sra. Claudia fez a apresentação da síntese do cenário de setembro, conforme abaixo:

Cenário Macroeconômico – Setembro/2022

- **Os sinais de desinflação global estão mais claros.** Ajuste monetário nos países e riscos geopolíticos pode levar o mundo a uma recessão;
- **A economia brasileira segue crescendo, embora a um ritmo mais moderado** e com diferenças importantes entre setores.



- **O crescimento da China continua modesto.** Indicadores de atividade surpreenderam negativamente no período recente, sugerindo baixo dinamismo da economia local em meio aos problemas do mercado imobiliário e efeitos adversos da política de tolerância zero à Covid-19.

Projeções XP: Crescimento do PIB (%)		
	2022	2023
Estados Unidos	1,5	1,4
Zona do Euro	2,9	-0,4
China	3,2	5,6

- A desinflação global, os cortes de impostos e os **juros altos no Brasil devem manter o IPCA em trajetória de queda gradual.** O Copom interrompeu o ciclo de aperto monetário, mas manteve o tom duro.

Brasil passa da 7ª para a 3ª posição em ranking de juros reais entre 167 países

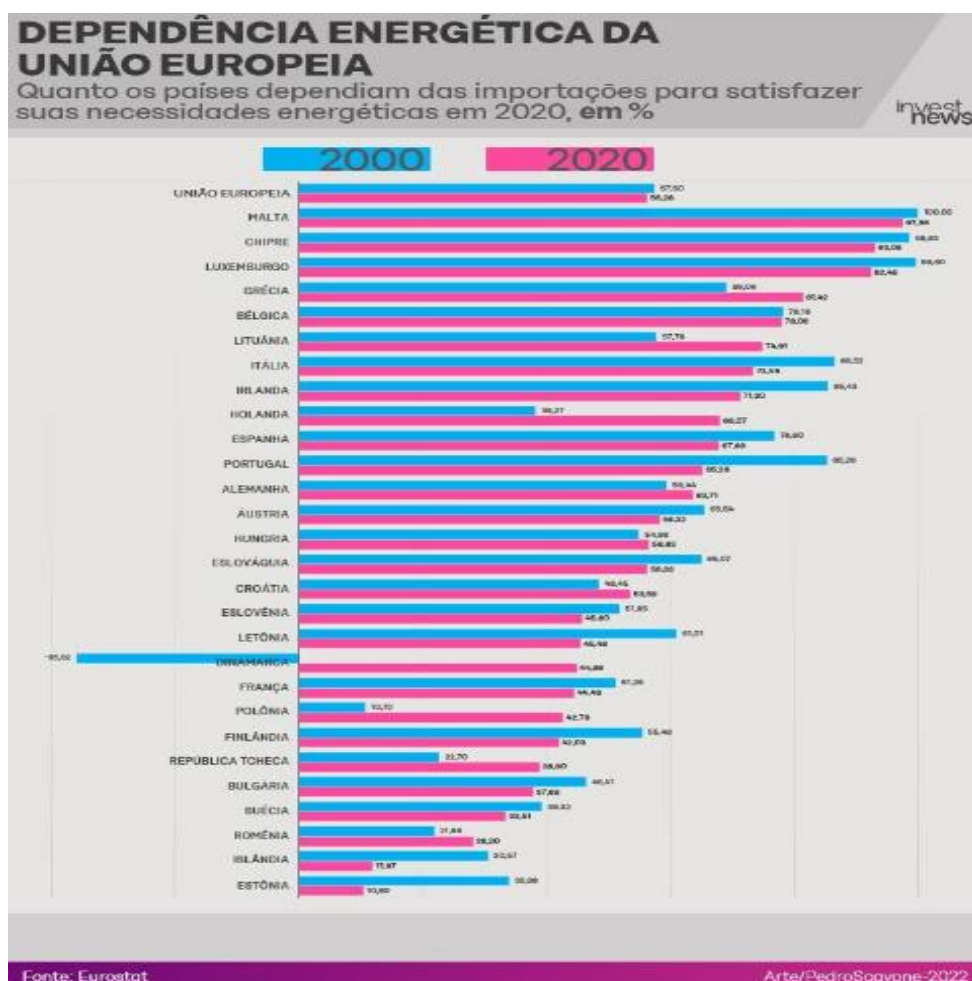


FONTE: Trading Economics

- As contas públicas seguem positivas, mas voltarão a ficar pressionadas em 2023. **Regras críveis e rígidas para as despesas serão cruciais para ancorar as expectativas nos próximos anos;**
- **O real tem mostrado bom desempenho,** considerando a forte apreciação global do dólar.



- Os resultados vistos para a Câmara e Senado surpreenderam. **O governo atual conseguiu eleger vários senadores** e está liderando em vários estados nos cargos de governador. O que deixa o governo Bolsonaro liderar com menos dificuldades em caso de vitória no segundo turno. Já se Lula ganhar, o ex-presidente terá uma oposição ferrenha.
- O **Ibovespa subiu 0,5% no mês** e retomou o patamar de 110.000 pontos. Novamente o desempenho local foi muito superior ao externo, onde o **S&P caiu 9,3% e atingiu o menor nível desde 2020**.
- **Europa enfrenta sua pior crise de energia**, fechando um acordo para banir parte das exportações de petróleo da Rússia como parte das sanções do ocidente. **A transição para energias limpas será, conforme especialistas, bastante prejudicada**. Na Cúpula do Clima, realizada em 2021, a União Europeia anunciou que reduziria 55% até o ano de 2030 suas emissões de gases do efeito estufa.





Brasil tem ganhado espaço nas carteiras globais: Alguns motivos estão por trás da boa performance dos ativos brasileiros esse ano são:

1) **Grande exposição aos setores que investidores querem no momento**, que são mais protegidos em relação à alta da inflação e juros. Esses setores são commodities e bancos, que representam 66% da Bolsa brasileira.

2) **Valor atrativo:** os ativos brasileiros seguem muito baratos, negociando com um forte desconto em relação às médias históricas. A Bolsa brasileira está atualmente negociando a 6,2x Lucro esperado para os próximos 12 meses, um desconto de 47% em relação à média histórica de 11,7x nos últimos 10 anos.

3) **altas taxas de juros:** o fato do Brasil ter saído na frente em relação ao aumento das taxas de juros – a Selic hoje se encontra em 13,75% e os juros reais futuros (IPCA+) estão em 5,80% – faz com que o Brasil passe a atrair fluxo de investidores para o mercado de renda fixa e também para a Bolsa, pois a chance de uma forte depreciação da moeda diminui com juros elevados. Afinal, as altas taxas de juros ajudam a fortalecer o Real em relação ao Dólar. No ano, o Real já apreciou 7,3%, tendo a 2ª melhor performance entre todas as moedas emergentes.

Indicadores de Mercado

Nome	Unidade	Nível	% sem.	% mês	% ano	% 12m	% 24m
Renda Fixa (d-1)							
CDI	% ao ano	13,65%	0,25%	1,07%	8,89%	10,90%	14,21%
IRFM	Índice	-	0,17%	1,40%	6,96%	8,01%	6,91%
IMA Ex-C	Índice	-	0,24%	1,30%	7,66%	9,15%	11,39%
IMA B5	Índice	-	0,02%	0,42%	7,07%	9,25%	15,75%
IMA B5+	Índice	-	0,49%	2,39%	5,10%	5,19%	8,56%
Inflação							
IPCA	%	-	-	-0,36%	4,39%	8,73%	19,25%
IGP-M	%	-	-	-0,70%	7,63%	8,59%	42,37%
Commodities							
CRB	Índice	268,29	-0,07%	-7,62%	15,46%	17,20%	80,66%
Moedas (taxas de câmbio por dólar)							
Real	Dólar	5,41	3,46%	4,39%	-3,12%	-0,60%	-4,15%
Real	Euro	5,31	4,04%	1,80%	-16,30%	-15,79%	-19,32%
Euro	Dólar	1,02	-1,17%	2,56%	16,02%	18,11%	19,57%
Peso Mexicano	Dólar	20,14	-0,35%	0,00%	-1,91%	-2,43%	-8,94%
Peso Chileno	Dólar	968,69	-0,19%	8,11%	13,70%	19,58%	23,51%
Iene	Dólar	144,74	1,00%	4,16%	25,77%	30,06%	37,22%
Renminbi	Dólar	7,12	-0,17%	3,27%	11,96%	10,41%	4,79%
Dólar Canadense	Dólar	1,38	1,74%	5,32%	9,43%	9,06%	3,83%
Libra Esterlina	Dólar	0,90	-2,78%	4,06%	21,12%	20,64%	15,70%
Dólar Australiano	Dólar	1,56	1,99%	6,89%	13,47%	12,91%	11,90%
Dólar N. Zelândia	Dólar	1,79	2,59%	9,28%	22,13%	23,21%	18,17%



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

Ações - Brasil (em Reais)							
Ibovespa	Índice	110.037	-1,50%	0,47%	4,97%	-0,85%	16,31%
IBX	Índice	46.731	-1,56%	-0,05%	4,43%	-1,33%	16,26%
IDIV	Índice	6.935	-2,53%	-1,80%	9,21%	7,21%	28,20%
SMLL	Índice	2.175	-3,37%	-1,84%	-8,06%	-18,43%	-5,58%
ISE	Índice	3.427	-3,91%	-2,54%	-6,63%	-11,77%	-4,67%
Ações - Mundo (Índice - em moeda local)							
S&P500	EUA	3.586	-2,91%	-9,34%	-24,77%	-16,76%	6,62%
FTSE	Inglaterra	6.894	-1,78%	-5,36%	-6,65%	-2,72%	17,52%
DAX	Alemanha	12.114	-1,38%	-5,61%	-23,74%	-20,62%	-5,07%
Nikkei	Japão	25.937	-4,48%	-7,67%	-9,91%	-11,94%	11,87%

Data	Contratos Futuros DI	jan-23	jan-25	jan-27	jan-29
Último	% ao ano	13,70%	11,59%	11,54%	11,70%
d-1	% ao ano	13,70%	11,72%	11,68%	11,85%

Fonte: Bloomberg – Elaboração: Itaú Asset Management Data-base: 30 de Setembro de 2022

Referências:

Investing.com
XP Investimentos
Occam Brasil
Itaú Asset

A seguir Sr. Robson apresentou a **Abertura da Carteira de Investimentos**, no site da LDB, onde verificamos que o mês de setembro foi encerrado com rentabilidade negativa de -0,86%, abaixo da meta atuarial de 0,11% com um Patrimônio Líquido total de R\$ **122.967.970,01** (cento e vinte e dois milhões, novecentos e sessenta e sete mil, novecentos e setenta reais e um centavo). Apresentou a rentabilidade por Artigo e Análise de liquidez, sendo 41,04% 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 0,63% na Renda Fixa, 8,76% na Renda Variável, 9,39% em Investimentos Estruturados, 9,77% em Investimentos no Exterior e 0,32% 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 setembro. **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 30.09.2022.

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.



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 70,25%

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

Emissor	Título Público	Volatild. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,315000%)	0,66	0,08	8,78	21.288.814,70	17,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,510000%)	0,66	0,10	8,94	24.358.202,42	19,81
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,66	0,09	8,87	45.647.017,12	37,12

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,85	1,34	5,33	4.237.985,16	3,45	357.276.654,08	1,19
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,46	1,45	5,84	2.058.675,15	1,67	539.353.622,97	0,38
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	6,25	1,62	4,91	4.754.247,78	3,87	269.658.285,11	1,76
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,49	0,61	5,95	5.150.679,48	4,19	471.784.431,34	1,09
BB	BB	BB PREV IPCA III	2,02	0,48	7,72	809.683,69	0,66	178.762.226,88	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TITULOS PÚBLICOS RF	3,20	0,49	6,18	1.561.767,80	1,27	2.902.138.561,58	0,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,84	1,53	8,40	6.271.556,82	5,10	2.451.788.610,47	0,26
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,80	0,86	7,90	1.392.835,51	1,13	1.022.393.584,94	0,14
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		3,66	1,20	6,52	26.237.431,39	21,34			

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ REHDA FIXA IMA-B ATIVO	6,09	1,47	5,45	2.125.098,25	1,73	444.503.225,14	0,48
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,57	1,52	6,08	63.064,06	0,05	1.761.108.354,50	0,00
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,95	1,28	9,01	5.422.035,25	4,41	732.589.611,33	0,74
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,78	1,08	8,93	2.454.830,03	2,00	2.088.496.299,29	0,12

1 de 30



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a		3,94	1,29	7,50	10.065.027,59	8,19			

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA 5,80% a.a	4,49	0,00	5,62	4.434.080,75	3,61		
Sub-total Artigo 7º IV		4,49	0,00	5,62	4.434.080,75	3,61			
Renda Fixa		1,40	0,56	7,99	86.383.556,85	70,25			

2 de 30



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,25%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	20,40	-0,21	3,95	194.957,86	0,16	38.643.002,49	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,88	-1,94	-8,24	236.431,38	0,19	643.251.684,47	0,04
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,46	-0,53	5,46	7.156.928,47	5,82	522.100.247,65	1,37
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,75	-1,00	2,10	6.855.554,53	5,58	1.961.836.267,82	0,35
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	21,60	-1,48	0,36	1.318.283,69	1,07	442.970.018,11	0,30
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	21,76	0,69	1,63	876.512,40	0,71	889.735.658,32	0,10
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	18,71	-2,53	0,14	889.209,40	0,72	138.429.947,23	0,64
Sub-total Artigo 8º I			17,60	-0,84	3,04	17.527.877,73	14,25		
Renda Variável			17,20	-0,84	3,04	17.527.877,73	14,25		

3 de 30



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,91%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d. 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	29,72	-12,25	-37,36	1.180.529,20	0,96	216.834.041,61	0,54
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,02	-10,23	-37,01	862.686,86	0,70	64.491.474,45	1,34
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25,04	-3,08	-29,52	992.902,28	0,81	115.237.986,19	0,86
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	36,27	-9,46	-46,23	681.269,23	0,55	551.200.355,41	0,12
VINCI	BEM	VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14,66	0,01	-13,97	751.269,66	0,61	127.942.210,95	0,59
Sub-total Artigo 9º II			19,34	-7,57	-34,32	4.468.657,23	3,63		

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,78	-7,72	-30,97	1.509.016,90	1,23	2.057.509.929,37	0,07
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	23,35	-6,87	-33,02	1.295.680,44	1,05	1.090.419.986,23	0,12
Sub-total Artigo 9º III			22,62	-7,33	-31,93	2.804.697,34	2,28		
Investimentos no Exterior			19,37	-7,47	-33,42	7.273.354,57	5,91		

4 de 30



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 9,51%

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	21,77	-8,56	-19,58	8.604.439,81	7,00	706.287.111,00	1,22
Sub-total Artigo 10º I			21,77	-8,56	-19,58	8.604.439,81	7,00		

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 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATEGIA II	110,76	-2,86	-16,17	3.089.762,25	2,51	247.651.370,66	1,25
Sub-total Artigo 10º II			110,76	-2,86	-16,17	3.089.762,25	2,51		
Investimentos Estruturados			29,06	-6,68	-15,83	11.694.202,06	9,51		

5 de 30



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,07%

Artigo 11º (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	68,50	0,45	3,52	88.978,80	0,07	221.028.817,44	0,04
Sub-total Artigo 11º			68,50	0,45	3,52	88.978,80	0,07		
Fundos Imobiliários			78,79	0,45	3,52	88.978,80	0,07		
Total			5,29	-0,86	0,95	122.967.970,01	100,00		

6 de 30



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

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	45.647.017,12	37,12	0,00	37,77	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alinea b	Fundos 100% Títulos Públicos	26.237.431,39	21,34	0,00	10,69	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alinea a	Fundos Renda Fixa	10.065.027,59	8,19	0,00	18,99	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	4.434.080,75	3,61	0,00	0,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	86.383.556,85	70,25					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.527.877,73	14,25	0,00	14,59	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	17.527.877,73	14,25					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	4.468.657,23	3,63	0,00	5,91	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	2.804.697,34	2,28	0,00	3,51	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	7.273.354,57	5,91					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	8.604.439,81	7,00	0,00	7,30	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.089.762,25	2,51	0,00	1,12	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	11.694.202,06	9,51					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	88.978,80	0,07	0,00	0,13	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	88.978,80	0,07					5,00
Total		122.967.970,01	100,00					

7 de 30



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

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	0,09 8,55	8,87 99,72	0,47 14,29	4,69 74,30	13,70 125,76	41.820,88	3.821.381,35
Artigo 7º I, Alinea b % do CDI	1,20 111,54	6,52 73,29	1,67 50,60	3,57 56,57	7,38 67,76	313.097,21	1.586.396,64
Artigo 7º III, Alinea a % do CDI	1,29 119,89	7,50 84,32	2,69 81,16	4,94 78,20	8,56 78,52	120.709,06	597.007,24
Artigo 7º IV % do CDI	0,00 0,00	5,62 85,32	0,67 20,20	5,08 80,52		0,00	236.112,88
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,84 -1,31	3,04 -1,93	11,67 0,01	-4,58 3,72		-149.281,19	517.506,16
Artigo 9º II % do CDI	-7,57 -705,77	-34,32 -385,99	-4,66 -140,79	-16,72 -264,88	-31,19 -286,29	-365.760,94	-2.334.657,96
Artigo 9º III % do CDI	-7,33 -683,51	-31,93 -359,16	-4,44 -133,99	-14,20 -224,90	-23,73 -217,78	-221.750,89	-1.315.684,01
Artigo 10º I % do CDI	-8,56 -798,39	-19,58 -220,27	-2,60 -78,41	-17,10 -270,85		-805.351,28	-2.048.895,69
Artigo 10º II % do CDI	-2,86 -266,93	-16,17 -181,83	-3,05 -92,04	-6,58 -104,17		-369,84	113.236,95
Artigo 11º % do CDI	0,45 42,38	3,52 39,63	0,41 12,47	-7,18 -113,77		402,40	6.209,61
PIRACAIA (Total)						-1.066.484,59	1.178.613,17

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%)	21.271.061,49	0,00	0,00	0,00	21.288.814,70	17.753,21	1.755.621,68
NTN-B 150826 (5,510000%)	24.334.134,75	0,00	0,00	0,00	24.358.202,42	24.067,67	2.065.759,67
					45.647.017,12	0,00	0,00

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

8 de 30



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA III	805.787,96	0,00	0,00	0,00	809.683,69	3.895,73	206.935,59
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	2.029.189,37	0,00	0,00	0,00	2.058.675,15	29.485,78	113.610,45
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TITULOS PÚBLICOS RF	1.554.184,53	0,00	0,00	0,00	1.561.767,80	7.583,27	93.998,93
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1.380.953,01	0,00	0,00	0,00	1.392.835,51	11.882,50	234.617,33
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	6.795.925,25	0,00	-622.000,00	0,00	6.271.556,82	97.631,57	301.758,46
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.182.134,86	0,00	0,00	0,00	4.237.985,16	55.850,30	183.297,65
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	4.678.490,91	0,00	0,00	0,00	4.754.247,78	75.756,87	222.928,79
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	5.119.668,29	0,00	0,00	0,00	5.150.679,48	31.011,19	229.249,44
					26.237.431,39	0,00	0,00
Artigo 7º III, Alínea 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	62.118,92	0,00	0,00	0,00	63.064,06	945,14	3.613,50
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	2.116.024,11	315.469,21	0,00	0,00	2.454.830,03	23.336,71	87.698,37
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.094.229,61	0,00	0,00	0,00	2.125.098,25	30.868,64	147.053,14
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	4.818.829,48	537.647,20	0,00	0,00	5.422.035,25	65.558,57	358.642,23
					10.065.027,59	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 5,80% a a	4.434.080,75	0,00	0,00	0,00	4.434.080,75	0,00	236.112,88
					4.434.080,75	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	241.099,40	0,00	0,00	0,00	236.431,38	-4.668,02	-21.241,11
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	6.924.855,07	0,00	0,00	0,00	6.855.554,53	-69.300,54	141.040,21
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	195.373,28	0,00	0,00	0,00	194.957,86	-415,42	7.406,59



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.338.130,63	0,00	0,00	0,00	1.318.283,69	-19.846,94	4.783,11
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	912.325,65	0,00	0,00	0,00	889.209,40	-23.116,25	1.210,04
VINCI MOSAICO FIA	870.510,70	0,00	0,00	0,00	876.512,40	6.001,70	14.072,83
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	7.194.864,19	0,00	0,00	0,00	7.156.928,47	-37.935,72	370.234,49
					17.527.877,73	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	1.345.387,07	0,00	0,00	0,00	1.180.529,20	-164.857,87	-704.120,27
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	960.947,92	0,00	0,00	0,00	862.686,86	-98.261,06	-506.926,23
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.024.404,63	0,00	0,00	0,00	992.902,28	-31.502,35	-415.803,73
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	752.454,52	0,00	0,00	0,00	681.269,23	-71.185,29	-585.804,26
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	751.224,03	0,00	0,00	0,00	751.269,66	45,63	-122.003,47
					4.468.657,23	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	1.635.255,70	0,00	0,00	0,00	1.509.016,90	-126.238,80	-676.932,12
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1.391.192,53	0,00	0,00	0,00	1.295.680,44	-95.512,09	-638.751,89
					2.804.697,34	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	9.409.791,09	0,00	0,00	0,00	8.604.439,81	-805.351,28	-2.048.895,69
					8.604.439,81	0,00	0,00

10 de 30



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
VINCI CAPITAL PARTNERS III FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA II	2.861.033,80	229.098,29	0,00	0,00	3.089.762,25	-369,84	113.236,95
					3.089.762,25	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	88.576,40	0,00	0,00	0,00	0,00	88.978,80	402,40	6.209,61
						88.978,80	0,00	0,00

11 de 30



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	50.467.109,65	41,04	50.467.109,65	41,04
de 31 a 365 dias	21.392.629,50	17,40	71.859.739,15	58,44
acima de 365 dias	51.108.230,86	41,56	122.967.970,01	100,00

12 de 30



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

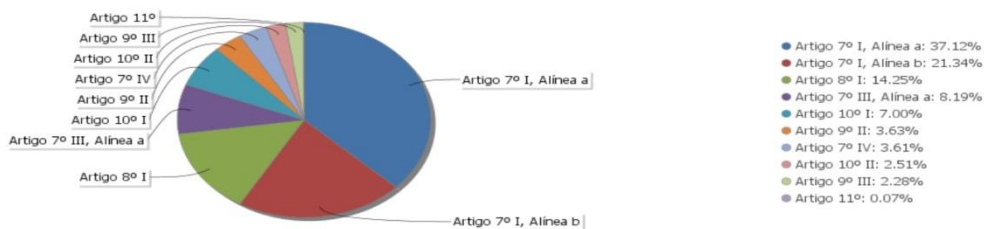


Carteira: PIRACAIA

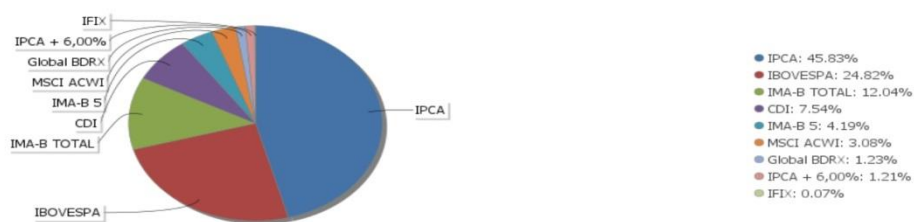
Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



13 de 30

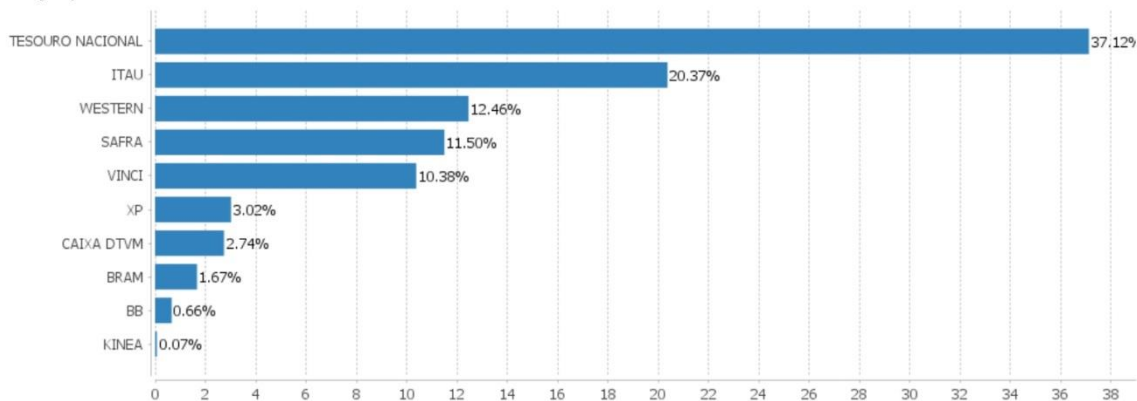


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



14 de 30



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

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	-1,43	1,00	-1,65	2,08	0,61	-0,86				0,95
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11				7,88
p.p. indexador	-1,64	-1,47	0,03	-2,85	0,11	-2,72	2,36	0,54	-0,97				-6,93
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	23	51,11	03 meses	1,82	-0,10	1,92	5,51
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	48,89	06 meses	-0,30	3,31	-3,61	5,59
			12 meses	3,39	12,54	-9,15	5,29
			24 meses	14,21	30,80	-16,58	5,00
Maior rentabilidade da Carteira	3,61	2020-04	36 meses	22,59	42,32	-19,73	7,33
Menor rentabilidade da Carteira	-6,31	2020-03	Desde 31/12/2018	38,48	51,84	-13,36	6,82

15 de 30



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



16 de 30



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

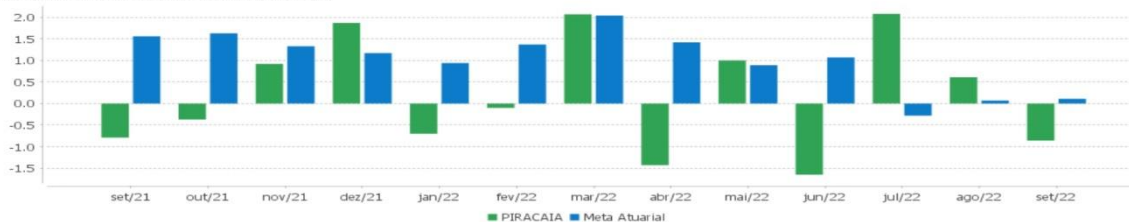


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



17 de 30



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA 5,80% a.a Var. IPCA p.p.	0,00 0,29	5,62 4,32	0,67 1,99	5,08 4,22			
NTN-B 150826 (5,510000%) Var. IPCA p.p.	0,10 0,39	8,94 4,85	0,50 1,82	4,74 3,87	13,79 6,63	32,17 14,02	43,19 21,34
NTN-B 150535 (5,315000%) Var. IPCA p.p.	0,08 0,37	8,78 4,69	0,45 1,77	4,64 3,78	13,58 6,42	24,68 6,53	27,69 5,84
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,61 0,18	5,95 -1,13	0,62 0,19	2,74 -0,40	7,50 -1,75	10,64 -5,10	20,05 -4,07
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,62 0,14	4,91 -1,21	2,02 0,32	2,76 -0,40	5,32 -1,92	7,17 -5,13	10,55 -4,11
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,49 -0,99	6,18 0,06	0,00 -1,70	2,38 -0,78	8,34 1,09	13,62 1,32	22,33 7,67
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,34 -0,14	5,33 -0,79	1,70 -0,00	2,88 -0,28	5,04 -2,21	7,36 -4,94	10,46 -4,21
BB PREV IPCA III Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,48 0,29	7,72 -1,02	0,79 0,62	3,64 -0,23	9,75 -3,85	17,26 -15,46	24,52 -20,58
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,53 1,82	8,40 4,31	2,97 4,30	5,62 4,76	10,74 3,57	13,75 -4,40	17,95 -3,91
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,45 -0,03	5,84 -0,28	1,62 -0,08	2,98 -0,17	6,87 -0,38	11,51 -0,79	13,49 -1,18
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,86 80,27	7,90 88,86	2,25 68,09	5,29 83,81	9,87 90,55	16,01 112,65	26,01 142,35
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,47 -0,01	5,45 -0,67	1,22 -0,48	2,24 -0,92	5,84 -1,40	11,30 -1,00	14,84 0,17
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,52 0,04	6,08 -0,04	1,80 0,10	3,22 0,06	7,12 -0,12	11,91 -0,38	13,85 -0,82
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI % do CDI	1,28 119,23	9,01 101,33	3,74 112,92	6,72 106,47	10,90 100,07	13,69 96,30	18,81 102,95
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	1,08 100,62	8,93 100,43	2,85 86,05	5,92 93,80	11,31 103,82	16,36 115,10	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,94 -2,41	-8,24 -13,22	13,94 2,27	-14,26 -5,95	-18,90 -18,05	-7,59 -23,90	-11,45 -16,50
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-1,48	0,36	12,40	-9,65	-13,57	-1,92	-24,93

18 de 30



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
Var. IBOVESPA p.p.	-1,95	-4,61	0,74	-1,35	-12,72	-18,23	-29,98
VINCI MOSAICO FIA	0,69	1,63	11,53	-8,45	-3,49	7,36	8,68
Var. IBOVESPA p.p.	0,22	-3,34	-0,14	-0,15	-2,64	-8,95	3,63
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	-0,53	5,46	11,67	-3,37	-1,17	10,46	13,81
Var. IBOVESPA p.p.	-1,00	0,48	0,00	4,94	-0,32	-5,86	8,76
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	-0,21	3,95	11,19	-9,17	-2,56	14,89	5,85
Var. IBOVESPA p.p.	-0,68	-1,03	-0,48	-0,87	-1,71	-1,42	0,80
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-1,00	2,10	11,81	-3,37	-6,05	12,04	0,24
Var. IBOVESPA p.p.	-1,47	-2,87	0,14	4,93	-5,21	-4,27	-4,81
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	-2,53	0,14	9,35	-7,46	-5,07	11,78	5,98
Var. IBOVESPA p.p.	-3,00	-4,84	-2,31	0,84	-4,22	-4,53	0,93
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,72	-30,97	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	47,15
Var. Global BDRX p.p.	0,66	-0,19	0,03	0,08	-0,54	-2,81	-3,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-6,87	-33,02	-4,54	-14,29	-24,65	-9,11	35,30
Var. IBOVESPA p.p.	-7,33	-37,99	-16,20	-5,99	-23,80	-25,42	30,24
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,01	-13,97	1,54	3,38	-9,30	-4,21	30,68
Var. MSCI ACWI p.p.	5,78	15,00	5,82	14,64	13,18	1,94	-7,31
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-3,08	-29,52	-11,15	3,72	-27,25		
Var. MSCI ACWI p.p.	2,70	-0,54	-6,86	14,98	-4,77		
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-12,25	-37,36	-6,77	-28,24	-35,43	-19,15	
Var. MSCI ACWI p.p.	-6,48	-8,39	-2,48	-16,99	-12,95	-13,01	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-9,46	-46,23	1,59	-21,02	-45,36	-40,77	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-9,66	-54,97	1,42	-24,88	-58,96	-73,50	
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-10,23	-37,01	-3,39	-26,54	-29,66	-12,20	
Var. MSCI ACWI p.p.	-4,45	-8,04	0,90	-15,29	-7,19	-6,06	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-8,56	-19,58	-2,60	-17,10	-9,29	18,31	30,09
Var. IBOVESPA p.p.	-9,03	-24,56	-14,26	-8,80	-8,44	2,00	25,04
VINCI CAPITAL PARTNERS III FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA II	-2,86	-16,17	-3,05	-6,58	19,41	75,28	73,84
Var. IBOVESPA p.p.	-3,33	-21,14	-14,71	1,73	20,26	58,97	68,79
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	0,45	3,52	0,41	-7,18	-0,88	-9,63	-0,38
Var. IFIX p.p.	-0,04	-3,11	-6,57	-14,77	-11,01	-16,64	-11,80
PIRACAIA	-0,86	0,95	1,82	-0,30	3,39	14,21	22,59
Var. IPCA + 4,88% p.p.	-0,97	-6,93	1,92	-3,61	-9,01	-15,73	-17,96
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
BRADESCO 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	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	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	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100%	0,50

21 de 30



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	0,40
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPOSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	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	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80

22 de 30



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
INVESTIMENTO NO EXTERIOR						
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 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA II	Não se aplica	Não se aplica				
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

23 de 30



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

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	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18		15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

24 de 30



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

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	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

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	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

25 de 30



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
396	01/09/2022	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	567.000,00	28.048,94090019	20,2146670000
397	01/09/2022	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	55.000,00	2.720,79673635	20,2146670000
392	08/09/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	374.626,76	0,00	24,35625650	15,381,1305096000
394	08/09/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	7.472,16	0,00	0,48580044	15,381,1305096000
393	22/09/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	155.548,28	0,00	10,04676545	15,482,4237431000
398	22/09/2022	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINAMICO RF LP FIC FI	293.553,60	0,00	24,124,71424419	12,1681690000
400	27/09/2022	VINCI CAPITAL PARTNERS III FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA II	229.098,29	0,00	229,09829000	1,000,0000000000
395	30/09/2022	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINAMICO RF LP FIC FI	15.135,30	0,00	1,241,67953785	12,1893770000
399	30/09/2022	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINAMICO RF LP FIC FI	6.780,31	0,00	556,24746039	12,1893770000
Total			1.082.214,70	622.000,00		

26 de 30



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



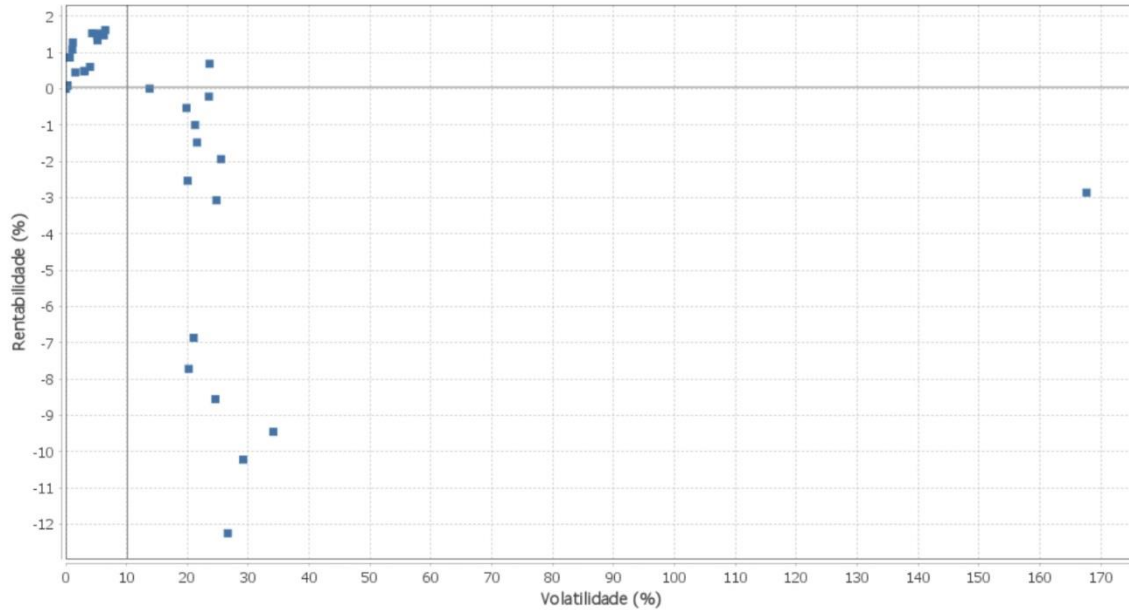
Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



1 de 4



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 3.022.799,41

Value-At-Risk: 2,46%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIRACAIA		2,46	2,46			122.967.970,01	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,63%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,315000%)		0,19	-0,00	0,17			21.288.814,70	17,31
NTN-B 150826 (5,510000%)		0,19	-0,00	0,17			24.358.202,42	19,81
Sub-total	0,30	0,19	-0,00		-3,27	0,09	45.647.017,12	37,12

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,58	0,04	0,30			4.237.985,16	3,45
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,44	0,02	0,02			2.058.675,15	1,67
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF		2,69	0,04	0,38			4.754.247,78	3,87
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,55	0,03	0,48			5.150.679,48	4,19
BB PREV IPCA III		1,10	0,00	1,11			809.683,69	0,66
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,60	0,01	1,52			1.561.767,80	1,27
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		1,42	0,03	1,43			6.271.556,82	5,10
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,65	-0,00	0,65			1.392.835,51	1,13
Sub-total	4,40	1,73	0,16		0,03	1,20	26.237.431,39	21,34

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,69	0,02	0,36			2.125.098,25	1,73
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,51	0,00	0,11			63.064,06	0,05

27 de 30



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



Carteira: PIRACAIA		EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS							Data Extrato: 30/09/2022
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,38	0,01	0,38			5.422.035,25	4,41	
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,37	0,00	0,37			2.454.830,03	2,00	
Sub-total	2,25	0,80	0,03		0,09	1,29	10.065.027,59	8,19	
Artigo 7º IV									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
LETRA FINANCEIRA - ITUB - ITAU UNIBANCO HOLDING SA 5,80% a.a		0,14	0,00	0,21			4.434.080,75	3,61	
Sub-total	0,00	0,14	0,00		0,00	0,00	4.434.080,75	3,61	
Renda Variável							Value-At-Risk: 8,76%		
Artigo 8º I									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI		10,66	0,01	0,71			194.957,86	0,16	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,23	0,02	7,17			236.431,38	0,19	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		8,63	0,43	3,20			7.156.928,47	5,82	
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,65	0,42	4,41			6.855.554,53	5,58	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		10,29	0,09	4,07			1.318.283,69	1,07	
VINCI MOSAICO FIA		10,12	0,06	3,81			876.512,40	0,71	
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		9,45	0,06	3,81			889.209,40	0,72	
Sub-total	20,59	8,76	1,10		-0,09	-0,84	17.527.877,73	14,25	
Investimentos Estruturados							Value-At-Risk: 9,77%		
Artigo 10º I									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		13,28	0,83	10,82			8.604.439,81	7,00	
Sub-total	24,59	13,28	0,83		-0,39	-8,56	8.604.439,81	7,00	
Artigo 10º II									

28 de 30



Carteira: PIRACAIA		EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS							Data Extrato: 30/09/2022
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
VINCI CAPITAL PARTNERS III FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA II		1,28	-0,00	10,48			3.089.762,25	2,51	
Sub-total	167,66	1,28	-0,00		-0,02	-2,86	3.089.762,25	2,51	
Investimentos no Exterior							Value-At-Risk: 9,39%		
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		14,68	0,11	10,21			1.180.529,20	0,96	
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		16,36	0,09	12,23			862.686,86	0,70	
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,66	-0,03	13,58			992.902,28	0,81	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		20,12	0,03	20,13			681.269,23	0,55	
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		6,02	-0,00	8,06			751.269,66	0,61	
Sub-total	16,08	9,45	0,20		-0,54	-7,57	4.468.657,23	3,63	
Artigo 9º III									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,01	0,08	2,09			1.509.016,90	1,23	
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		10,54	0,06	13,59			1.295.680,44	1,05	
Sub-total	20,18	10,62	0,14		-0,42	-7,33	2.804.697,34	2,28	
Fundos Imobiliários							Value-At-Risk: 0,32%		
Artigo 11º									
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII		0,32	0,00	2,34			88.978,80	0,07	

29 de 30



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

O próximo assunto tratado foi a **Certificação Profissional** pelos Conselheiros. Sra. Claudia informou que a ABCPREV será contratada para ministrar o curso presencialmente aos Conselheiros e demais interessados, em data que será agendada em breve, e no mais tardar na primeira quinzena de janeiro de 2023, ressaltando que todos devem se certificar até 30/03/2023. Para enriquecer e facilitar os estudos, a contratação da ABCPREV inclui acesso à Plataforma de vídeo aulas e simulados para todos os conselheiros a partir de 20/10/2022. Em **informes gerais** a Sra. Claudia informou aos Conselheiros que ainda não recebeu o relatório final do fiscal do Tribunal de Contas do Estado de São Paulo referente ao exercício 2021, conforme auditoria presencial ocorrida dias 15 e 16/08/2022. Informa também que quanto às cestas básicas o Piraprev informou de maneira exaustiva aos aposentados acerca do cronograma de entrega, local e horário, ressaltando que perderá o direito quem não retirar as cestas nas datas estipuladas. Para tanto utilizou vários meios de comunicação e em último caso a equipe do Piraprev esteve presencialmente, com o veículo do Instituto avisando aos que não tinham telefone fixo nem celular para contato. Não havendo mais nada a deliberar, a reunião foi encerrada.

Ana Paula Silva Pinto Ascêncio Bruno

Tatiana Guimarães Moreira de Almeida
Presidente do Conselho

Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva

Claudia Leoncio da Silva
Superintendente

Fábio Araújo Piola

Lívia Silva Pereira Ferreira

Robson Adão Martins Ribeiro
Auxiliar Financeiro

Renata Suyama da Silva

Ronaldo Vasques