



Reunião Ordinária do Conselho Administrativo

Aos 14 (quatorze) dias do mês de fevereiro de dois mil e vinte e três, 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 Renata Suyama da Silva, Ronaldo Vasques, Lívia Silva Pereira e Tatiana Guimarães Moreira de Almeida. Presente também Robson Adão Martins Ribeiro, Auxiliar Financeiro. Com quórum suficiente a reunião foi iniciada às 8:42 horas. Sra. Claudia abre a reunião cumprimentando e agradecendo a todos pela presença, e **informando sobre a Certificação da equipe do Piraprev**. A Sra. Superintendente que já está certificada como Dirigente nível Intermediário e como membro do Comitê de Investimentos e Gestora de recursos nível Básico. O Sr. Robson como Membro do Comitê de Investimentos nível Intermediário e Sandra Cristina, Coordenadora Administrativa e de Seguridade, certificada como dirigente nível Intermediário. Ressaltou que os conselheiros podem utilizar a sala de reuniões do Piraprev para realizarem as provas, pois o ambiente é tranquilo, silencioso, com ar condicionado e independente das outras salas do Instituto. A seguir informou que após revisão da prévia da avaliação atuarial o **banco de dados foi encaminhado ao atuário**, restando aguardar a **versão final** para aprovação do conselho administrativo, que deverá ocorrer através de reunião extraordinária para que em seguida possa ser apresentado ao Sr. Prefeito e em seguida aos vereadores, tendo em vista a necessidade de aprovação do novo plano de custeio através de lei. Em seguida foram apresentados os **Processos de aposentadorias e pensões**, conforme abaixo, **Item APROVADO**.

	Nome	Processo	Concessão	Tipo	Cargo
Aposentadorias	Wilma de Oliveira	09/2019	01/02/2023	Idade e Tempo de contribuição	Servente geral
	Maria Aparecida Machado	01/2023	01/02/2023	Idade e Tempo de contribuição	Servente escolar
Pensão	Hilda dos Santos	02/2023 A	01/02/2023	Pensão por morte	



Em seguida foram apresentados os **Processos licitatórios**, conforme abaixo, **Item APROVADO**.

Empresa	Objeto
1. Vidraçaria King Glass Ltda. ME	Vedação em cobertura de vidro incolor – Copa/Cozinha
2. Antonio Cesar dos Santos ME	Instalação de película de proteção solar – Copa/Cozinha

O próximo item foi a **apresentação do Cenário macroeconômico**: O mês de Janeiro continuou apresentando volatilidade no mercado doméstico. As medidas iniciais adotadas pelo novo governo trouxeram incertezas, principalmente no âmbito fiscal, fazendo com que as curvas de juros se mantivessem em patamares elevados, em especial as mais longas. EUA apresentou melhora nos índices de inflação nos EUA, trazendo um ganho para as bolsas americanas, porém continuamos com um quadro de aperto monetário e desaceleração nos EUA e Europa. Na RF Brasil, o aceno quanto à manutenção dos estímulos e mudanças na política de controle de gastos do país mantiveram as incertezas aos mercados, trazendo forte volatilidade nas curvas de juros ao longo do mês. A inflação se mostrou mais pressionada o que nos fez elevar a nossa expectativa para cima em 2023. Mesmo assim, ainda mantemos a perspectiva de manutenção da Selic pelo COPOM em 13,75% pelo menos até o primeiro semestre deste ano. Apesar das incertezas acima, e olhando para frente, entendemos que a suspensão das altas pelo COPOM e o patamar alto de juros do país trazem oportunidades para alocação de forma gradual nas estratégias IMA e Pré-Fixadas. Na RV doméstica, o IBOVESPA fechou em alta de 3,37% iniciando 2023 no campo positivo, principalmente pela entrada de investimentos estrangeiros no país. Vale ressaltar que vemos o IBOVESPA com oportunidades, olhando o médio/longo prazo. No curto prazo, continuamos com um forte concorrente para a estratégia, que é a oferta de juros de 2 dígitos na RF e tesouro direto. Na RV Internacional, temos ainda um ciclo de alta de juros e inflação pressionada nas principais economias globais, o que mantém as incertezas quanto ao tempo de duração do aperto monetário. A dúvida que se mostra é o tamanho da desaceleração Global que teremos. A surpresa positiva é a China que deve crescer acima da média mundial este ano. Especificamente nos EUA as bolsas reagiram bem ao fato dos índices de inflação e confiança do consumidor terem vindo melhores que o esperado. Perspectivas de alocação global: De inflação para recessão, as preocupações de 2023 deverão ser voltadas para a atividade econômica em detrimento do pico da variação de preços, que provavelmente ficou no ano passado. Contudo, os riscos de recessão tanto na Zona do Euro quanto nos EUA seguem elevados. Neste contexto, estamos mais otimistas com o Brasil e a China. Dado esse cenário, desenvolvemos as visões abaixo baseadas em um horizonte de médio prazo, ao redor dos próximos 3 a 12 meses. As notas (“Score”) variam de 0 a 1 ponto, e a ideia é mostrar nossas convicções e preferências em relação à uma alocação neutra a mercados globais medido pelo MSCI ACWI : Esse relatório tem como objetivo nortear os investidores sobre qual a região e temática que temos maior convicção em meio às incertezas do cenário atual. Reforçamos a necessidade estrutural de exposição a investimentos internacionais. Benefícios da diversificação, acesso a temáticas e oportunidades podem ser obtidos além das fronteiras do Brasil.



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

Região	Score (0-1)	Visão	Comentários
EUA	0,50	Neutra	Seguimos com uma visão cautelosa para bolsa americana com base em: i) necessitamos ter uma maior clareza da desaceleração econômica/recessão, ii) a bolsa segue negociando em patamares não atrativos, iii) e esperamos revisões baixistas de lucros.
Europa exc. Reino Unido	0,52	Neutra	Embora a região tenha registrado uma economia mais resiliente que o esperado ainda é cedo para ficarmos otimistas. Ainda enxergamos os seguintes riscos: 1) recessão na Zona do Euro, 2) crise energética e 3) um Banco Central Europeu favorecendo o controle da inflação vs. crescimento econômico. Todavia, destacamos que o ponto de entrada na bolsa europeia já é bem razoável, principalmente no relativo, atualizamos nossa avaliação para neutra na região.
China	0,69	Atrativa	O cenário macroeconômico chinês deve se tornar mais positivo com: i) reabertura econômica (puxada por uma melhora no consumo), ii) fim do escrutínio regulatório, iii) recuperação dos lucros das empresas iv) fase do ciclo econômico diferente de outras regiões globais
Japão	0,55	Neutra	O país ainda conta com um pouco de demanda reprimida da pandemia e deverá se beneficiar de um aumento da demanda interna. Contudo deverá também sofrer com: i) riscos cambiais, ii) queda das exportações com a desaceleração global e iii) o valuation da bolsa segue não atrativo vs. padrões históricos.
Brasil	0,69	Atrativa	O Brasil se beneficia de: 1) reabertura da China, 2) <i>valuations</i> atrativos, 3) altas taxas de juros, 4) uma maior preferência dos investidores por mercados emergentes vs. EUA. Apesar da visão positiva, ressaltamos a importância dos riscos políticos e fiscais para os investimentos na bolsa local.
Mercados Emergentes	0,59	Neutro	<i>Valuation e dividend yield</i> atrativos, podendo se beneficiar de um aumento no preço das commodities catalisado pela reabertura da China. Por outro lado, o sentimento de aversão ao risco com uma recessão global, e riscos políticos e fiscais tendem a pesar negativamente na região.



Fonte: XP Research. Dados até 25/01/2023.

1

Referências:

- XP
- Bradesco Asset
- Safra Asset

Logo em seguida foi realizada a **Abertura da Carteira de Investimentos**, no site da LDB, onde verificamos que o mês de Janeiro foi encerrado com rentabilidade positiva de 1,85%, acima da meta atuarial de 0,94% com um Patrimônio Líquido total de R\$ **129.882.649,50** (cento e vinte e nove milhões, oitocentos e oitenta e dois mil, seiscentos e quarenta e nove reais e cinquenta centavos). Apresentou a rentabilidade por Artigo e Análise de liquidez, sendo 43,20% da carteira com liquidez de até 30 dias. Na alocação por Artigo verificou-se o enquadramento de todos os segmentos pela Resolução 4.963 e a análise de risco x retorno, que demonstrou VaR de 0,72% na Renda Fixa, 12,02% na Renda Variável, 8,11% em Investimentos Estruturados, 9,86% em Investimentos no Exterior e 1,94% em Fundos Imobiliários. Em relação aos demais critérios, os investimentos estão aderentes à Política de Investimentos do PIRAPREV/2023 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução CMN 4.963/2021. Abaixo o relatório completo do mês de Janeiro. **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 31.01.2023.

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: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 70,02%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,315000%)	0,63	0,05	1,14	1,14	21.449.848,07	16,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,510000%)	0,63	0,05	1,16	1,16	25.240.970,92	19,43
Sub-total Artigo 7º I, Alinea a		0,63	0,05	1,15	1,15	46.690.818,99	35,95

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,43	0,08	0,18	0,18	4.259.491,75	3,28	313.310.073,70	1,36
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,49	0,09	-0,03	-0,03	2.061.311,82	1,59	446.346.277,62	0,46
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	6,64	0,08	-0,15	-0,15	4.690.182,14	3,61	218.299.543,39	2,15
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,74	0,02	1,28	1,28	5.279.281,87	4,06	442.064.852,21	1,19
BB	BB	BB PREV IPCA III	2,19	0,01	1,38	1,38	843.028,63	0,65	186.124.134,70	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,85	0,01	1,39	1,39	1.626.311,29	1,25	3.389.466.663,61	0,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,35	0,15	0,50	0,50	4.558.387,39	3,51	2.164.364.253,13	0,21
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,72	0,15	0,59	0,59	1.432.971,40	1,10	804.659.776,30	0,18
Sub-total Artigo 7º I, Alinea b			3,98	0,08	0,54	0,54	24.750.966,29	19,06		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,01	0,09	-0,06	-0,06	2.113.413,93	1,63	319.399.280,50	0,66
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,65	0,09	-0,09	-0,09	62.972,04	0,05	1.409.888.691,45	0,00
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,22	0,04	0,80	0,80	7.688.824,34	5,92	602.825.328,24	1,28

1 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,76	0,07	1,03	1,03	5.306.226,16	4,09	2.382.068.483,24	0,22
Sub-total Artigo 7º III, Alinea a			2,24	0,06	0,76	0,76	15.171.436,47	11,68		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a	2,39	0,48	0,48	0,48	4.325.787,92	3,33		
Sub-total Artigo 7º IV			2,39	0,48	0,48	0,48	4.325.787,92	3,33		
Renda Fixa			1,53	0,08	0,91	0,91	90.939.009,67	70,02		

2 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL 13,54%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	21,61	0,98	3,59	3,59	200.596,43	0,15	36.998.902,00	0,54
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,55	1,70	3,30	3,30	225.383,91	0,17	583.745.036,37	0,04
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	19,52	1,18	2,43	2,43	6.964.222,44	5,36	548.330.643,97	1,27
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,52	0,50	2,42	2,42	7.231.903,54	5,57	1.863.800.941,22	0,39
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,32	1,01	4,24	4,24	1.241.013,17	0,96	398.864.437,45	0,31
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	23,49	1,93	3,24	3,24	849.781,29	0,65	842.158.615,80	0,10
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	20,84	1,02	2,46	2,46	869.158,28	0,67	134.734.966,99	0,65
Sub-total Artigo 8º I			20,11	0,92	2,62	2,62	17.582.059,06	13,54		
Renda Variável			20,11	0,92	2,62	2,62	17.582.059,06	13,54		

3 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 6,19%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VINCI	BTG PACTUAL	VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15,71	-0,07	-1,08	-1,08	760.507,75	0,59	117.518.339,04	0,65
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	32,62	1,01	11,98	11,98	1.354.872,88	1,04	230.832.362,56	0,59
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTEC ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	32,00	1,42	13,00	13,00	1.079.826,98	0,83	72.406.747,56	1,49
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,62	-2,10	2,45	2,45	1.061.053,27	0,82	98.001.511,63	1,08
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	40,19	-0,96	11,00	11,00	769.856,46	0,59	588.945.660,50	0,13
Sub-total Artigo 9º II			21,36	-0,04	7,77	7,77	5.026.117,34	3,87		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,58	0,23	4,32	4,32	1.629.547,24	1,25	1.979.769.025,50	0,08
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	26,69	0,62	2,55	2,55	1.380.892,08	1,06	888.058.003,28	0,16
Sub-total Artigo 9º III			26,27	0,40	3,50	3,50	3.010.439,32	2,32		
Investimentos no Exterior			22,03	0,13	6,13	6,13	8.036.556,66	6,19		

4 de 29



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



Carteira: PIRACAIA										Data Extrato: 31/01/2023	
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS											
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS										10,21%	
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)											
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo	
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	23,83	1,37	6,40	6,40	10.027.435,84	7,72	658.544.387,35	1,52	
Sub-total Artigo 10º I			23,83	1,37	6,40	6,40	10.027.435,84	7,72			
Artigo 10º II (Fundo de Participação)											
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo	
VINCI	BEM	VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATEGIA II	112,82	-0,04	-0,04	-0,04	3.239.521,23	2,49	265.466.243,08	1,22	
Sub-total Artigo 10º II			112,82	-0,04	-0,04	-0,04	3.239.521,23	2,49			
Investimentos Estruturados			28,45	1,02	4,75	4,75	13.266.957,07	10,21			

5 de 29



Carteira: PIRACAIA										Data Extrato: 31/01/2023	
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS											
FUNDOS IMOBILIÁRIOS										0,04%	
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)											
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo	
KINEA	KINEA	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	60,97	-0,72	-0,72	-0,72	58.067,04	0,04	14.139.052,97	0,41	
Sub-total Artigo 11º			60,97	-0,72	-0,72	-0,72	58.067,04	0,04			
Fundos Imobiliários			60,97	-0,72	-0,72	-0,72	58.067,04	0,04			
Total			5,47	0,29	1,85	1,85	129.882.649,50	100,00			

6 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

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, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	46.690.818,99	35,95	0,00	36,34	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	24.750.966,29	19,06	0,00	20,55	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	15.171.436,47	11,68	0,00	8,91	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	4.325.787,92	3,33	0,00	3,53	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	90.939.009,67	70,02					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.582.059,06	13,54	0,00	14,97	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	17.582.059,06	13,54					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	5.026.117,34	3,87	0,00	3,56	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	3.010.439,32	2,32	0,00	2,27	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.036.556,66	6,19					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.027.435,84	7,72	0,00	7,40	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.239.521,23	2,49	0,00	2,41	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	13.266.957,07	10,21					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	58.067,04	0,04	0,00	0,07	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	58.067,04	0,04					5,00
Total		129.882.649,50	100,00					

7 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

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, Alínea a	1,15	1,15	3,06	3,62	11,54	530.877,38	530.877,38
% do CDI	102,38	102,38	92,69	53,99	90,08		
Artigo 7º I, Alínea b	0,54	0,54	-0,45	2,73	7,61	151.267,97	151.267,97
% do CDI	48,13	48,13	-13,55	40,69	59,44		
Artigo 7º III, Alínea a	0,76	0,76	1,61	5,14	10,60	105.605,07	105.605,07
% do CDI	67,76	67,76	48,60	76,57	82,73		
Artigo 7º IV	0,48	0,48	0,48	0,85		20.576,43	20.576,43
% do CDI	42,55	42,55	14,47	12,70			
Artigo 8º I	2,62	2,62	-6,98	6,15	-0,24	448.383,51	448.383,51
Var. IBOVESPA p.p.	-0,75	-0,75	-4,74	-3,80	-1,39		
Artigo 9º II	7,77	7,77	11,94	0,81	-15,54	362.477,11	362.477,11
% do CDI	691,92	691,92	361,51	12,09	-121,31		
Artigo 9º III	3,50	3,50	5,25	-4,65	-18,21	101.811,05	101.811,05
% do CDI	311,61	311,61	158,80	-69,34	-142,13		
Artigo 10º I	6,40	6,40	7,30	3,17	-1,16	603.111,59	603.111,59
% do CDI	569,70	569,70	221,02	47,31	-9,05		
Artigo 10º II	-0,04	-0,04	5,92	1,25	-12,37	-1.311,31	-1.311,31
% do CDI	-3,60	-3,60	179,18	18,68	-96,57		
Artigo 11º	-0,72	-0,72	-34,83	-34,16	4,68	-422,71	-422,71
% do CDI	-64,34	-64,34	-1.054,56	-509,26	36,54		
PIRACAIA (Total)						2.322.376,09	2.322.376,09

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea 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%)	21.207.816,20	0,00	0,00	0,00	21.449.848,07	242.031,87	242.031,87
NTN-B 150826 (5,510000%)	24.952.125,41	0,00	0,00	0,00	25.240.970,92	288.845,51	288.845,51
					46.690.818,99	0,00	0,00

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

8 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA III	831.530,22	0,00	0,00	0,00	843.028,63	11.498,41	11.498,41
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	2.061.831,50	0,00	0,00	0,00	2.061.311,82	-519,68	-519,68
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TITULOS PÚBLICOS RF	1.604.059,50	0,00	0,00	0,00	1.626.311,29	22.251,79	22.251,79
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1.424.568,97	0,00	0,00	0,00	1.432.971,40	8.402,43	8.402,43
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	10.193.180,99	0,00	-5.677.000,00	0,00	4.558.387,39	-42.206,40	42.206,40
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.251.808,01	0,00	0,00	0,00	4.259.491,75	7.683,74	7.683,74
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	4.697.299,14	0,00	0,00	0,00	4.690.182,14	-7.117,00	-7.117,00
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	5.212.419,99	0,00	0,00	0,00	5.279.281,87	66.861,88	66.861,88
					24.750.966,29	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	63.029,21	0,00	0,00	0,00	62.972,04	-57,17	-57,17
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	4.849.483,96	404.426,94	0,00	0,00	5.306.226,16	52.315,26	52.315,26
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.114.780,09	0,00	0,00	0,00	2.113.413,93	-1.366,16	-1.366,16
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	6.245.851,23	1.388.259,97	0,00	0,00	7.688.824,34	54.713,14	54.713,14
					15.171.436,47	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 - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a	0,00	4.305.211,49	0,00	0,00	4.325.787,92	20.576,43	20.576,43
					4.325.787,92	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	218.175,54	0,00	0,00	0,00	225.383,91	7.208,37	7.208,37
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	7.061.197,36	0,00	0,00	0,00	7.231.903,54	170.706,18	170.706,18
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	193.639,68	0,00	0,00	0,00	200.596,43	6.956,75	6.956,75
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.190.554,79	0,00	0,00	0,00	1.241.013,17	50.458,38	50.458,38

9 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	848.319,87	0,00	0,00	0,00	869.158,28	20.838,41	20.838,41
VINCI MOSAICO FIA	823.092,29	0,00	0,00	0,00	849.781,29	26.689,00	26.689,00
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	6.798.696,02	0,00	0,00	0,00	6.964.222,44	165.526,42	165.526,42
					17.582.059,06	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	1.209.955,74	0,00	0,00	0,00	1.354.872,88	144.917,14	144.917,14
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	955.635,61	0,00	0,00	0,00	1.079.826,98	124.191,37	124.191,37
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.035.711,04	0,00	0,00	0,00	1.061.053,27	25.342,23	25.342,23
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	693.557,33	0,00	0,00	0,00	769.856,46	76.299,13	76.299,13
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	768.780,51	0,00	0,00	0,00	760.507,75	-8.272,76	-8.272,76
					5.026.117,34	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de 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	1.562.104,87	0,00	0,00	0,00	1.629.547,24	67.442,37	67.442,37
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1.346.523,40	0,00	0,00	0,00	1.380.892,08	34.368,68	34.368,68
					3.010.439,32	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	9.424.324,25	0,00	0,00	0,00	10.027.435,84	603.111,59	603.111,59
					10.027.435,84	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

10 de 29



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTISTRATÉGIA II	3.240.832,54	0,00	0,00	0,00	3.239.521,23	-1.311,31	-1.311,31
					3.239.521,23	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	58.489,75	0,00	0,00	0,00	0,00	58.067,04	-422,71	-422,71
						58.067,04	0,00	0,00

11 de 29



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	56.109.753,25	43,20	56.109.753,25	43,20
de 31 a 365 dias	17.047.428,19	13,13	73.157.181,44	56,33
acima de 365 dias	56.725.468,06	43,67	129.882.649,50	100,00

12 de 29



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

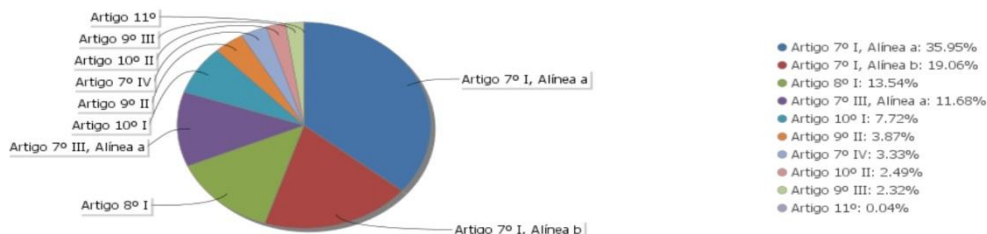


Carteira: PIRACAIA

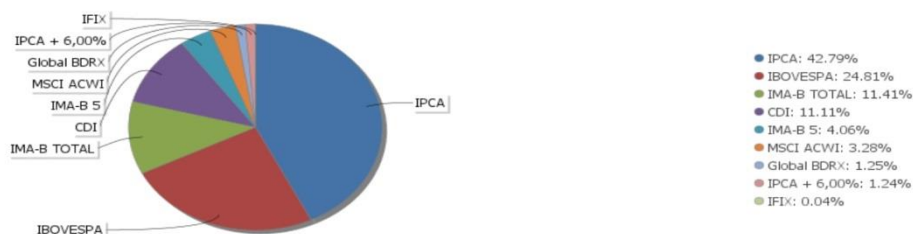
Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



13 de 29

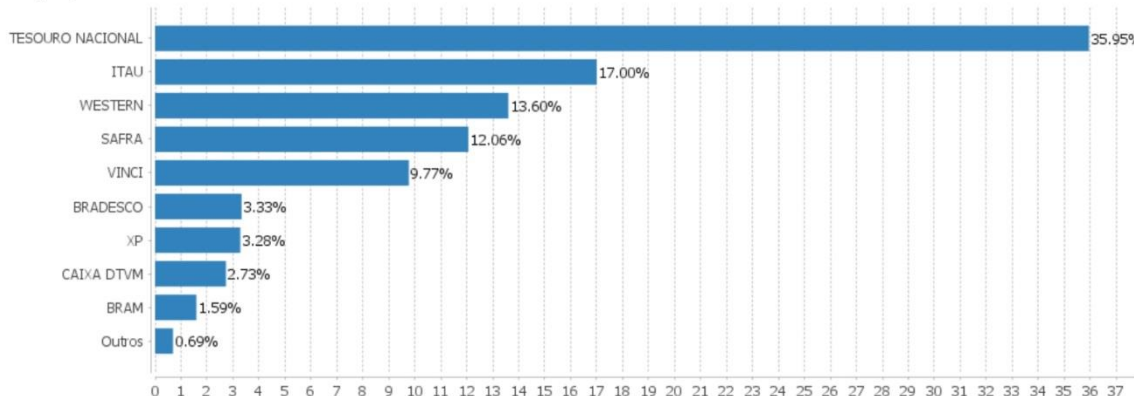


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



14 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

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
2023	1,85												1,85
IPCA + 4,72%	0,94												0,94
p.p. indexador	0,91												0,91
2022	-0,70	-0,10	2,07	-1,43	1,00	-1,85	2,08	0,61	-0,86	2,30	-0,16	-0,25	2,85
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,83
p.p. indexador	-1,64	-1,47	0,03	-2,85	0,11	-2,72	2,36	0,54	-0,97	1,33	-0,95	-1,29	-8,07
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	51,02
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	48,98

Relatório

	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
	03 meses	1,43	2,79	-1,37	4,72
	06 meses	3,50	3,98	-0,47	5,32
	12 meses	5,49	10,92	-5,43	5,47
	24 meses	11,35	29,02	-17,66	4,94
Maior rentabilidade da Carteira	36 meses	20,36	42,22	-21,86	7,42
Menor rentabilidade da Carteira	48 meses	39,31	56,36	-17,06	6,74
	Desde 31/12/2018	43,70	57,60	-13,90	6,69

15 de 29

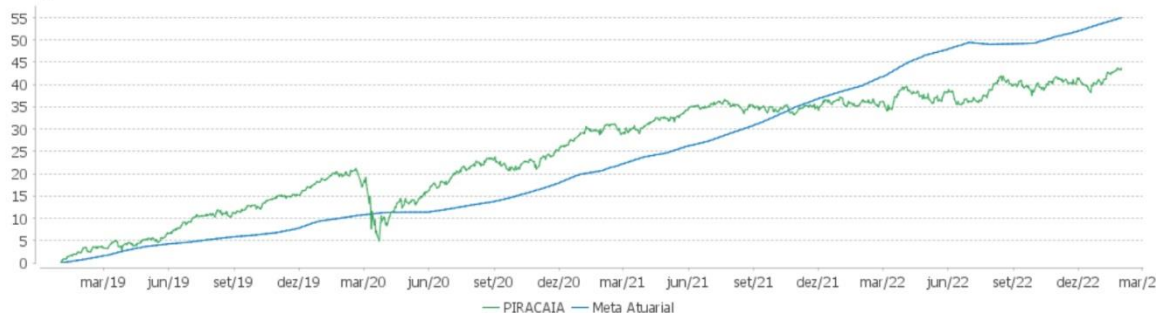


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



16 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



17 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a	0,48	0,48					
Var. IPCA p.p.	0,24	0,24					
NTN-B 150826 (5,510000%)	1,16	1,16	3,08	3,67	11,63	29,79	43,00
Var. IPCA p.p.	0,63	0,63	1,52	2,16	5,86	13,04	20,92
NTN-B 150535 (5,315000%)	1,14	1,14	3,04	3,57	11,43	25,82	31,04
Var. IPCA p.p.	0,61	0,61	1,47	2,07	5,65	9,07	8,96
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1,28	1,28	0,74	3,19	8,77	9,31	18,58
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,11	-0,11	-1,27	-1,21	-2,42	-6,96	-6,48
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	-0,15	-0,15	-2,38	1,62	4,65	-0,83	5,25
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15	-0,15	-1,39	-1,22	-2,51	-6,75	-6,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,39	1,39	2,20	4,47	10,60	14,02	22,83
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,39	1,39	3,18	1,63	3,44	8,10	11,37
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,18	0,18	-0,73	3,25	6,97	2,12	7,31
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18	0,18	0,26	0,41	-0,19	-3,81	-4,15
BB PREV IPCA III	1,38	1,38	2,19	4,44	11,72	18,11	25,93
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,34	0,34	-0,89	-0,12	-0,40	-13,07	-19,36
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	-0,03	-0,03	-1,06	2,68	6,79	5,19	10,31
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,02	-0,07	-0,16	-0,37	-0,73	-1,15
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,50	0,50	-0,90	2,12	7,81	13,13	16,12
Var. IPCA p.p.	-0,03	-0,03	-2,47	0,62	2,03	-3,63	-5,95
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,59	0,59	1,91	4,43	10,56	18,86	26,28
% do CDI	52,51	52,51	57,69	66,10	82,42	102,21	122,48
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-0,06	-0,06	-1,78	1,79	6,03	4,43	10,88
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06	-0,06	-0,79	-1,05	-1,13	-1,50	-0,58
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-0,09	-0,09	-1,23	2,56	6,74	5,27	10,40
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,09	-0,09	-0,24	-0,28	-0,42	-0,66	-1,06
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,80	0,80	2,22	5,87	11,87	15,73	20,25
% do CDI	70,95	70,95	67,34	87,50	92,68	85,25	94,37
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,03	1,03	2,68	5,77	12,46	19,88	24,28
% do CDI	91,99	91,99	81,22	86,01	97,26	107,76	113,15
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3,30	3,30	-11,00	3,46	-15,88	-24,90	-30,21
Var. IBOVESPA p.p.	-0,06	-0,06	-8,76	-6,49	-17,03	-23,48	-29,92
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	4,24	4,24	-11,98	-0,28	-10,15	-19,32	-39,19

18 de 29



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



Carteira: PIRACAIA		Data Extrato: 31/01/2023						
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.	0,87	0,87	-9,73	-10,23	-11,30	-17,90	-38,90	
VINCI MOSAICO FIA	3,24	3,24	-10,52	3,38	-8,19	-11,44	-12,64	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,13	-0,13	-8,27	-6,57	-9,34	-10,02	-12,35	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	2,43	2,43	-7,80	3,38	-2,40	-6,04	-1,15	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,93	-0,93	-5,56	-6,57	-3,55	-4,62	-0,86	
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	3,59	3,59	-2,72	9,53	0,12	-2,48	-1,60	
Var. IBOVESPA p.p.	0,22	0,22	-0,48	-0,42	-1,03	-1,05	-1,31	
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	2,42	2,42	-4,62	11,26	6,28	0,01	-6,08	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,95	-0,95	-2,37	1,31	5,13	1,43	-5,79	
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	2,46	2,46	-8,28	1,16	-4,44	-4,39	-11,74	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	-0,91	-6,04	-8,79	-5,59	-2,97	-11,45	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	4,32	4,32	6,18	-4,25	-17,40	-8,03	41,35	
Var. Global BDRX p.p.	-0,06	-0,06	-0,88	-0,62	-0,69	-2,61	-3,83	
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NIVEL I PB	2,55	2,55	4,16	-5,12	-19,13	-7,86	29,10	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,82	-0,82	6,41	-15,07	-20,28	-6,43	29,39	
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,08	-1,08	1,81	-0,28	-5,34	-4,08	29,07	
Var. MSCI ACWI p.p.	-5,75	-5,75	-5,45	-0,20	8,64	2,01	-9,55	
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,45	2,45	14,68	0,60	-11,75	-32,72		
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,22	-2,22	7,42	0,67	2,22	-26,63		
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	11,98	11,98	10,07	-2,78	-20,91	-17,38	15,14	
Var. MSCI ACWI p.p.	7,31	7,31	2,81	-2,71	-6,93	-11,29	-23,48	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,00	11,00	14,94	2,75	-26,03	-37,52	14,56	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	9,96	9,96	11,85	-1,80	-38,15	-68,71	-30,73	
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,00	13,00	17,76	5,30	-9,35	-8,12	33,62	
Var. MSCI ACWI p.p.	8,33	8,33	10,50	5,38	4,62	-2,04	-5,00	
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	6,40	6,40	7,30	3,17	-1,16	24,03	38,87	
Var. IBOVESPA p.p.	3,93	3,93	9,55	-6,78	-2,31	25,45	39,16	
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	-0,04	-0,04	5,92	1,25	-12,37	20,57	71,22	
Var. IBOVESPA p.p.	-3,41	-3,41	8,16	-8,70	-13,52	22,00	71,51	
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	-0,72	-0,72	-34,83	-34,16	4,68	-38,71	-37,46	
Var. IFIX p.p.	0,88	0,88	-29,14	-34,41	3,09	-36,69	-29,14	
PIRACAIA	1,85	1,85	1,43	3,50	5,49	11,35	20,36	
Var. IPCA + 4,88% p.p.	0,91	0,91	-1,34	-0,41	-5,27	-16,68	-19,75	
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	

19 de 29



Carteira: PIRACAIA		Data Extrato: 31/01/2023						
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%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85	
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29	

20 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

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

21 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

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 VARIÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	2,50
					O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA 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	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO 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 29



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/01/2023

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 FIP MULTISTRATEGIA 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 29



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/01/2023

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	1,10	1,10	3,25	6,75	12,54	16,51	20,51	28,48	37,42	
IRF-M 1+	0,72	0,72	0,90	6,13	8,73	4,24	10,25	25,21	40,80	
IRF-M TOTAL	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42	13,75	26,79	40,53	
IMA-B 5	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27	25,06	40,14	54,28	
IMA-B 5+	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05	0,52	22,96	44,15	
IMA-B TOTAL	-0,00	-0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93	11,46	31,65	50,23	
IMA-GERAL TOTAL	0,70	0,70	1,42	5,19	10,20	11,76	16,79	30,01	43,27	
IDKA 2	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26	25,79	39,66	54,03	
IDKA 20	-4,58	-4,58	-9,69	-0,34	-3,60	-17,66	-17,08	6,23	30,85	
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,69	
Renda Variável										
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses	
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	16,47	33,58	
IBRX 100	3,51	3,51	-2,34	9,39	0,75	-1,38	0,24	19,26	37,61	
IBRX 50	3,38	3,38	-1,47	10,88	1,52	0,57	3,26	18,48	34,15	
SMALL CAP	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13	-27,55	5,24	19,33	
Índice Consumo - ICON			-16,42	-6,37	-24,84	-42,47	-44,77	-20,86	-20,70	
Índice Dividendos - IDIV	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61	12,30	42,62	69,29	

24 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,77	3,77	2,13	-2,99	-14,07	2,21	50,95	110,51	132,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,60	-1,60	-5,69	0,25	1,59	-2,03	-8,32	17,07	23,45

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,67	4,67	7,25	-0,08	-13,97	-6,09	38,62	84,31	93,01

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	0,53	1,57	1,50	5,77	16,75	22,08	27,19	32,00
INPC	0,46	0,46	1,54	1,37	5,71	16,92	23,38	28,69	33,29
IGPM	0,21	0,21	0,09	-2,50	3,79	21,34	52,54	64,45	75,53
SELIC	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,70

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	2,58	3,55	10,01	26,28	37,25	48,75	60,49
IPCA + 5,00%	0,96	0,96	2,83	4,05	11,06	28,72	41,24	54,54	68,33
IPCA + 5,50%	1,00	1,00	2,96	4,30	11,59	29,95	43,26	57,50	72,37
IPCA + 5,89%	1,03	1,03	3,06	4,50	12,00	30,91	44,84	59,84	75,57
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29	60,50	76,48
INPC + 4,00%	0,80	0,80	2,55	3,41	9,94	26,46	38,73	50,51	62,06
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85	62,40	78,20

25 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
438	02/01/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	608.000,00	30.072,44491549	20,2178440000
436	03/01/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	60.000,00	2.981,32172128	20,1253020000
440	06/01/2023	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	40.563,77	0,00	3.235,24084472	12,5380990000
441	12/01/2023	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	363.863,17	0,00	28.931,31119653	12,5767950000
439	16/01/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	5.000.000,00	244.958,28091022	20,4116390000
434	17/01/2023	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	694.788,52	0,00	43,56750927	15,947,4005200000
442	17/01/2023	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a	4.305.211,49	0,00	6,00000000	717,535,2483330000
437	20/01/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	9.000,00	441,46253398	20,3867810000
433	24/01/2023	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	293.553,60	0,00	18,36689986	15,982,7517027000
435	24/01/2023	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	399.917,85	0,00	25,02183963	15,982,7517027000
Total			6.097.898,40	5.677.000,00		

26 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 2.862.881,56 Value-At-Risk: 2,20%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIRACAIA		2,20	2,20			129.882.649,50	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,72%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,315000%)		0,14	0,00	0,16			21.449.848,07	16,51
NTN-B 150826 (5,510000%)		0,14	0,00	0,16			25.240.970,92	19,43
Sub-total	0,51	0,14	0,00		0,05	1,15	46.690.818,99	35,95

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,65	0,05	0,43			4.259.491,75	3,28
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		2,93	0,03	0,00			2.061.311,82	1,59
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF		3,30	0,07	0,61			4.690.182,14	3,61
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,87	0,04	0,65			5.279.281,87	4,06
BB PREV IPCA III		1,35	0,00	1,35			843.028,63	0,65
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,36	0,01	2,08			1.626.311,29	1,25
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		1,95	0,04	1,96			4.558.387,39	3,51
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,67	0,00	0,67			1.432.971,40	1,10
Sub-total	4,23	2,17	0,23		-0,14	0,54	24.750.986,29	19,06

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		2,98	0,03	0,29			2.113.413,93	1,63
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		3,00	0,00	0,09			62.972,04	0,05

27 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II		0,19	0,00	11,22			3.239.521,23	2,49
Sub-total	0,14	0,19	0,00		-8,50	-0,04	3.239.521,23	2,49

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,86%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,81	-0,02	7,35			760.507,75	0,59
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		12,71	0,07	9,37			1.354.872,88	1,04
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		12,62	0,05	10,23			1.079.826,98	0,83
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,49	-0,05	13,09			1.061.053,27	0,82
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		19,50	-0,02	19,49			769.856,46	0,59
Sub-total	14,58	9,17	0,03		0,46	7,77	5.026.117,34	3,87

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,23	0,01	0,94			1.629.547,24	1,25
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,87	0,01	19,06			1.380.892,08	1,06
Sub-total	17,54	11,94	0,03		0,14	3,50	3.010.439,32	2,32

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 1,94%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII		1,94	-0,00	3,69			58.067,04	0,04
Sub-total	2,45	1,94	-0,00		-0,75	-0,72	58.067,04	0,04

29 de 29



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



Carteira: PIRACAIA		Data Extrato: 31/01/2023						
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,61	0,01	0,61			7.688.824,34	5,92
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,38	0,01	0,38			5.306.226,16	4,09
Sub-total	1,18	0,80	0,05		-0,31	0,76	15.171.436,47	11,68
Artigo 7º IV								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a		1,07	0,01	1,06			4.325.787,92	3,33
Sub-total	1,61	1,07	0,01		-0,40	0,48	4.325.787,92	3,33
Renda Variável Value-At-Risk: 12,02%								
Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI		12,23	0,02	1,21			200.596,43	0,15
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,26	0,02	7,19			225.383,91	0,17
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		11,89	0,52	2,97			6.964.222,44	5,36
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,82	0,52	5,24			7.231.903,54	5,57
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		13,86	0,11	5,68			1.241.013,17	0,96
VINCI MOSAICO FIA		14,30	0,08	5,36			849.781,29	0,65
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		13,79	0,07	5,66			869.158,28	0,67
Sub-total	21,78	12,02	1,33		0,07	2,62	17.582.059,06	13,54
Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 8,11%								
Artigo 10º I								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		10,72	0,52	14,18			10.027.435,84	7,72
Sub-total	15,61	10,72	0,52		0,34	6,40	10.027.435,84	7,72
Artigo 10º II								

28 de 29

Dando continuidade a reunião o último tópico discutido pelos membros tratou de avaliar os investimentos recomendado pelo Comitê de Investimentos e as tratativas relativas a alocações da carteira, sendo o fundo selecionado pelo colegiado o ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA – CNPJ: 21.838.150/0001-49, que é um dos ativos para pagamento de benefícios no curto prazo por conta de sua fácil operacionalização, liquidez elevada e composição de ativos rentáveis em títulos públicos, assim o cupom semestral de juros que deverá entrar em conta da autarquia durante o mês de fevereiro referente a NTN-B de vencimento em 2026 e os demais recursos do mês serão alocados neste fundo com a aprovação UNÂNIME dos membros presentes do Conselho Administrativo, e também a sobra de recursos da taxa de administração será transferida para fundo padrão com este fim na XP Investimentos, ou seja, o fundo WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI – CNPJ: 03.499.367/0001-90, que é onde está centralizado a sobra de recursos da taxa de administração de outros anos anteriores. Desta forma a decisão de alocação dos novos recursos foi totalmente aprovada. Não havendo mais nada a deliberar, a reunião foi encerrada.



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

Denise Fátima do Carmo

Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva

Fábio Araújo Piola

Lívia Silva Pereira Ferreira

Renata Suyama da Silva

Ronaldo Vasques

Robson Adão Martins Ribeiro

Auxiliar Financeiro

Claudia Leoncio da Silva

Superintendente