



## Reunião Ordinária do Conselho Administrativo

Aos 14 (quatorze) dias do mês de março 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, Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva, Denise Fátima do Carmo, Lívia Silva Pereira Ferreira e Tatiana Guimarães Moreira de Almeida. Presente também Robson Adão Martins Ribeiro, Auxiliar Financeiro. Com quórum suficiente a reunião foi iniciada às 8:47 horas. Sra. Claudia abre a reunião cumprimentando e agradecendo a todos pela presença, e em especial, parabenizando a Presidente do Conselho, Tatiana, pela certificação como membro do Conselho, pela certificadora Totum; ressaltou que o espaço da sala de reuniões está aberto e disponível para os Conselheiros que queiram realizar a prova no Piraprev, bastando fazer o agendamento para reserva da sala. Passando a **apresentação do Cenário Macroeconômico de Fevereiro de 2023:**

**Banco Central manteve a taxa básica em 13,75%. Em seu comunicado, manteve a preocupação com fatores de riscos de alta para a inflação local e global.** O Copom enfatizou que acompanhará com especial atenção os desenvolvimentos futuros da política fiscal e, em particular, seus efeitos nos preços de ativos e expectativas de inflação. O Comitê destacou que a conjuntura atual de incerteza no âmbito fiscal e com as expectativas de inflação exibindo deterioração em prazos mais longos desde a última reunião, elevam o custo da desinflação necessária para atingir as metas estabelecidas pelo Conselho Monetário Nacional. revisamos nossa expectativa para a Selic para o final de 2023, de 12,50% para 13,00% a.a., com início dos cortes a partir do quarto trimestre de 2023. **Economia brasileira encerrou o ano passado com crescimento puxado pelo comércio e setor de serviços, conforme apontado pelo IBC-Br. O indicador de atividade do Banco Central registrou alta de 0,29% na margem em dezembro de 2022, revertendo quatro quedas consecutivas.** O resultado foi superior às expectativas do mercado. Na análise do resultado de dezembro, o IBC-Br refletiu as altas das vendas no varejo ampliado (0,4%) e do resultado positivo do setor de serviços (3,1%). Contrabalanceado essas altas, a produção industrial manteve-se estável em dezembro do ano passado. Para 2023 esperamos expansão do PIB de 0,8%, impulsionada principalmente pelo setor agrícola. **Com relação à evolução dos preços, o IPCA-15, prévia da inflação ao consumidor, apresentou alta de 0,76% no mês.** Com isso, a prévia da inflação atingiu variação acumulada em 12 meses de 5,6%, abaixo do registrado no período anterior (5,9%). O grupo com maior variação positiva foi Educação (6,4%), impactado de forma mais intensa pelos reajustes de preços dos cursos regulares que geralmente ocorrem no início do ano letivo. Apesar da contínua melhora, o patamar



atual ainda não é compatível com as metas de inflação, reforçando a necessidade de manutenção do atual grau de aperto monetário. Nos EUA, o Fed elevou a taxa de juros em 25 pb, Leitura de dados demonstra o mercado de trabalho ainda aquecido. Além disso, os indicadores também mostram uma inflação ainda resiliente, com o componente de serviços seguindo pressionado. Esta combinação sugere que poderá ocorrer o prolongamento do ciclo de aperto monetário. Na Zona do Euro, a inflação mostra dinâmica desfavorável para o Banco Central Europeu (ECB), principalmente nos componentes do núcleo. Neste ambiente, é previsto que o ECB continue subindo os juros nas próximas reuniões. O firme aperto monetário reforça a perspectiva de uma atividade fraca ao longo do ano. Na China, os sinais seguem positivos, com a retomada ficando mais evidente, a atividade segue em recuperação. As informações desde então sugerem que o pior momento da dinâmica de casos de Covid-19 foi superado e que a atividade vem reagindo até melhor do que a expectativa inicial. Isso reforça a percepção mais favorável para a economia da China.

Referências:

- Bradesco Asset Management
- LDB Consultoria

A seguir, Sr. Robson apresentou a **Abertura da Carteira de Investimentos**, no site da LDB, onde se verificou que o mês de fevereiro foi encerrado com rentabilidade negativa de -0,47%, abaixo da meta atuarial de 1,17% com um Patrimônio Líquido total de R\$ **129.516.342,98** (cento e vinte e nove milhões, quinhentos e dezesseis mil, trezentos e quarenta e dois reais e noventa e oito centavos). Apresentou a rentabilidade por Artigo e Análise de liquidez, sendo 44,12% 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 0,72% na Renda Fixa, 11,30% na Renda Variável, 9,27% em Investimentos Estruturados, 7,76% em Investimentos no Exterior e 1,90% 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 fevereiro. **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 28.02.2023.

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: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 71,03%

Artigo 7º I, Alínea 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	0,06	0,92	2,07	21.647.565,67	16,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,510000%)	0,63	0,06	0,94	2,10	24.756.388,94	19,11
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,63</b>	<b>0,06</b>	<b>0,93</b>	<b>2,09</b>	<b>46.403.954,61</b>	<b>35,83</b>

Artigo 7º I, Alínea 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	5,52	-0,30	1,23	1,41	3.151.862,13	2,43	271.000.844,80	1,16
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,59	-0,28	1,26	1,23	2.087.209,57	1,61	445.810.378,85	0,47
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	6,66	-0,27	1,23	1,08	4.747.996,53	3,67	220.114.628,37	2,16
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,70	0,02	1,40	2,70	5.353.178,95	4,13	425.947.102,39	1,26
BB	BB	BB PREV IPCA III	2,28	0,01	1,34	2,74	829.959,03	0,64	183.239.139,42	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,85	0,01	1,34	2,75	1.600.460,24	1,24	3.416.468.689,80	0,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	3,52	-0,16	1,14	1,65	6.077.437,50	4,69	2.181.457.433,60	0,28
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,78	0,05	0,39	0,98	1.438.594,30	1,11	778.203.632,74	0,18
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,06</b>	<b>-0,14</b>	<b>1,23</b>	<b>1,77</b>	<b>25.286.698,25</b>	<b>19,52</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,08	-0,29	1,21	1,14	2.138.986,94	1,65	283.116.559,96	0,76
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,75	-0,30	1,22	1,13	63.742,40	0,05	1.235.830.765,45	0,01
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,34	0,06	-0,22	0,58	8.384.347,05	6,47	583.710.209,96	1,44

1 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,76	0,03	0,87	1,91	5.352.211,18	4,13	2.496.061.867,24	0,21
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>2,21</b>	<b>-0,00</b>	<b>0,36</b>	<b>1,12</b>	<b>15.939.287,57</b>	<b>12,31</b>		

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	1,39	0,03	0,98	1,47	4.368.324,92	3,37		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>1,39</b>	<b>0,03</b>	<b>0,98</b>	<b>1,47</b>	<b>4.368.324,92</b>	<b>3,37</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,54</b>	<b>-0,00</b>	<b>0,91</b>	<b>1,83</b>	<b>91.998.265,35</b>	<b>71,03</b>		

2 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL										12,63%
Artigo 8º I (Fundos de Ações)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatiliid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	21,95	-0,70	-7,67	-4,36	185.202,66	0,14	33.119.500,11	0,56
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,60	-1,05	-10,52	-7,56	201.682,64	0,16	517.170.403,48	0,04
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	19,92	-0,74	-6,70	-4,43	6.497.827,74	5,02	518.369.159,10	1,25
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DINAMIS FIC	20,67	-0,76	-6,80	-4,55	6.740.106,46	5,20	1.687.120.867,12	0,40
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,56	-1,19	-9,10	-5,25	1.128.034,24	0,87	358.025.193,09	0,32
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	23,70	-0,50	-6,47	-3,44	794.802,80	0,61	782.127.879,01	0,10
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	21,23	-0,75	-7,08	-4,80	807.638,55	0,62	125.026.962,00	0,65
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>20,35</b>	<b>-0,77</b>	<b>-6,98</b>	<b>-4,54</b>	<b>16.355.295,09</b>	<b>12,63</b>		
Renda Variável			20,35	-0,77	-6,98	-4,54	16.355.295,09	12,63		

3 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR										6,19%
Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatiliid. 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	15,42	0,50	0,93	-0,15	767.593,96	0,59	118.182.215,42	0,65
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	32,31	-0,17	-3,03	8,58	1.313.802,25	1,01	220.200.259,80	0,60
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,56	0,28	-0,86	12,03	1.070.570,83	0,83	69.754.930,67	1,53
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,72	1,23	-0,57	1,86	1.054.956,85	0,81	95.474.224,88	1,10
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	39,18	1,41	1,39	12,55	780.593,53	0,60	590.852.345,79	0,13
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>20,97</b>	<b>0,57</b>	<b>-0,77</b>	<b>6,94</b>	<b>4.987.517,42</b>	<b>3,85</b>		
Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatiliid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,14	0,39	0,75	5,10	1.641.764,32	1,27	1.983.611.681,32	0,08
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	25,79	0,33	0,23	2,79	1.384.086,33	1,07	847.652.363,95	0,16
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>25,61</b>	<b>0,36</b>	<b>0,51</b>	<b>4,03</b>	<b>3.025.850,65</b>	<b>2,34</b>		
Investimentos no Exterior			21,56	0,49	-0,29	5,83	8.013.368,07	6,19		

4 de 29



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



Carteira: PIRACAIA										Data Extrato: 28/02/2023	
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS											
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS										10,11%	
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	23,52	Dia	Mês	Ano	9.852.122,64	7,61	597.097.746,42	1,65	
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>23,52</b>	<b>-0,11</b>	<b>-1,75</b>	<b>4,54</b>	<b>9.852.122,64</b>	<b>7,61</b>			
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 MULTIESTRATÉGIA II	113,05	Dia	Mês	Ano	3.238.511,83	2,50	265.466.243,08	1,22	
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>113,05</b>	<b>-0,03</b>	<b>-0,03</b>	<b>-0,07</b>	<b>3.238.511,83</b>	<b>2,50</b>			
Investimentos Estruturados			28,24	-0,09	-1,33	3,36	13.090.634,47	10,11			

5 de 29



Carteira: PIRACAIA										Data Extrato: 28/02/2023	
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS											
FUNDOS IMOBILIÁRIOS										0,05%	
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	35,05	Dia	Mês	Ano	58.780,00	0,05	14.209.218,79	0,41	
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>35,05</b>	<b>1,23</b>	<b>1,23</b>	<b>0,50</b>	<b>58.780,00</b>	<b>0,05</b>			
Fundos Imobiliários			35,05	1,23	1,23	0,50	58.780,00	0,05			
<b>Total</b>			<b>5,41</b>	<b>-0,08</b>	<b>-0,47</b>	<b>1,37</b>	<b>129.516.342,98</b>	<b>100,00</b>			

6 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Pró-Gestão Nível 1 Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	46.403.954,61	35,83	0,00	36,34	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	25.286.698,25	19,52	0,00	20,55	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	15.939.287,57	12,31	0,00	8,91	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	4.368.324,92	3,37	0,00	3,53	20,00	0,00	20,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>91.998.265,35</b>	<b>71,03</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.355.295,09	12,63	0,00	14,97	35,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>16.355.295,09</b>	<b>12,63</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	4.987.517,42	3,85	0,00	3,56	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	3.025.850,65	2,34	0,00	2,27	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>8.013.368,07</b>	<b>6,19</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	9.852.122,64	7,61	0,00	7,40	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.238.511,83	2,50	0,00	2,41	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>13.090.634,47</b>	<b>10,11</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	58.780,00	0,05	0,00	0,07	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>58.780,00</b>	<b>0,05</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>129.516.342,98</b>	<b>100,00</b>					

7 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

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 % do CDI	0,93 101,17	2,09 101,85	2,93 91,73	4,65 72,20	11,35 87,34	430.515,27	961.392,65
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,23 133,44	1,77 86,39	1,87 58,56	3,27 50,79	8,09 62,26	291.618,29	442.886,26
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,36 39,33	1,12 54,83	1,95 61,03	4,34 67,27	10,15 78,11	57.201,66	162.806,73
Artigo 7º IV % do CDI	0,98 107,10	1,47 71,45	1,47 45,84	1,96 30,43		42.537,00	63.113,43
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-6,98 0,51	-4,54 -0,17	-5,81 0,90	-7,48 -3,29	-6,41 0,84	-1.226.763,97	-778.380,46
Artigo 9º II % do CDI	-0,77 -83,65	6,94 338,47	3,94 123,14	3,17 49,14	-11,92 -91,71	-38.599,92	323.877,19
Artigo 9º III % do CDI	0,51 55,76	4,03 196,42	-0,90 -28,03	-0,02 -0,31	-11,42 -87,83	15.411,33	117.222,38
Artigo 10º I % do CDI	-1,75 -190,42	4,54 221,24	-0,49 -15,28	4,70 72,94	-0,73 -5,62	-175.313,20	427.798,39
Artigo 10º II % do CDI	-0,03 -3,39	-0,07 -3,49	5,91 184,88	1,44 22,31	-12,31 -94,73	-1.009,40	-2.320,71
Artigo 11º % do CDI	1,23 133,73	0,50 24,19	-8,00 -250,24	-33,64 -521,98	-39,36 -302,80	712,96	290,25
<b>PIRACAIA (Total)</b>						<b>-603.689,98</b>	<b>1.718.686,11</b>

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%)	21.449.848,07	0,00	0,00	0,00	21.647.565,67	197.717,60	439.749,47
NTN-B 150826 (5,510000%)	25.240.970,92	0,00	0,00	717.379,65	24.756.388,94	232.797,67	521.643,18
					46.403.954,61	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: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA III	843.028,63	0,00	-24.288,72	0,00	829.959,03	11.219,12	22.717,53
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	2.061.311,82	0,00	0,00	0,00	2.087.209,57	25.897,75	25.378,07
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TITULOS PÚBLICOS RF	1.626.311,29	0,00	0,00	47.595,01	1.600.460,24	21.743,96	43.995,75
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1.432.971,40	0,00	0,00	0,00	1.438.594,30	5.622,90	14.025,33
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	4.558.387,39	2.170.513,69	-694.500,00	0,00	6.077.437,50	43.036,42	85.242,82
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.259.491,75	0,00	-1.160.016,29	0,00	3.151.862,13	52.386,67	60.070,41
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	4.690.182,14	0,00	0,00	0,00	4.747.996,53	57.814,39	50.697,39
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	5.279.281,87	0,00	0,00	0,00	5.353.178,95	73.897,08	140.758,96
					25.286.698,25	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	62.972,04	0,00	0,00	0,00	63.742,40	770,36	713,19
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	5.306.226,16	0,00	0,00	0,00	5.352.211,18	45.985,02	98.300,28
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.113.413,93	0,00	0,00	0,00	2.138.986,94	25.573,01	24.206,85
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	7.688.824,34	710.649,44	0,00	0,00	8.384.347,05	-15.126,73	39.586,41
					15.939.287,57	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	4.325.787,92	0,00	0,00	0,00	4.368.324,92	42.537,00	63.113,43
					4.368.324,92	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	225.383,91	0,00	0,00	0,00	201.682,64	-23.701,27	-16.492,90
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	7.231.903,54	0,00	0,00	0,00	6.740.106,46	-491.797,08	-321.090,90
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	200.596,43	0,00	0,00	0,00	185.202,66	-15.393,77	-8.437,02
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.241.013,17	0,00	0,00	0,00	1.128.034,24	-112.978,93	-62.520,55

9 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	869.158,28	0,00	0,00	0,00	807.638,55	-61.519,73	-40.681,32
VINCI MOSAICO FIA	849.781,29	0,00	0,00	0,00	794.802,80	-54.978,49	-28.289,49
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	6.964.222,44	0,00	0,00	0,00	6.497.827,74	-466.394,70	-300.868,28
					16.355.295,09	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	1.354.872,88	0,00	0,00	0,00	1.313.802,25	-41.070,63	103.846,51
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.079.826,98	0,00	0,00	0,00	1.070.570,83	-9.256,15	114.935,22
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.061.053,27	0,00	0,00	0,00	1.054.956,85	-6.096,42	19.245,81
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	769.856,46	0,00	0,00	0,00	780.593,53	10.737,07	87.036,20
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	760.507,75	0,00	0,00	0,00	767.593,96	7.086,21	-1.186,55
					4.987.517,42	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	1.629.547,24	0,00	0,00	0,00	1.641.764,32	12.217,08	79.659,45
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	1.380.892,08	0,00	0,00	0,00	1.384.086,33	3.194,25	37.562,93
					3.025.850,65	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	10.027.435,84	0,00	0,00	0,00	9.852.122,64	-175.313,20	427.798,39
					9.852.122,64	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: 28/02/2023

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	3.239.521,23	0,00	0,00	0,00	3.238.511,83	-1.009,40	-2.320,71
					3.238.511,83	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	58.067,04	0,00	0,00	0,00	0,00	58.780,00	712,96	290,25
						58.780,00	0,00	0,00

11 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	57.146.767,15	44,12	57.146.767,15	44,12
de 31 a 365 dias	15.928.365,20	12,30	73.075.132,35	56,42
acima de 365 dias	56.441.210,63	43,58	129.516.342,98	100,00

12 de 29



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

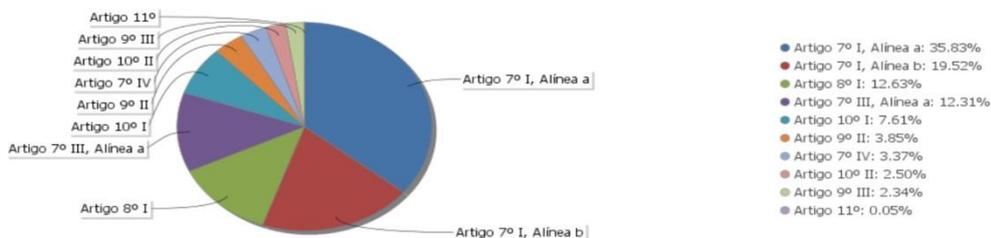


Carteira: PIRACAIA

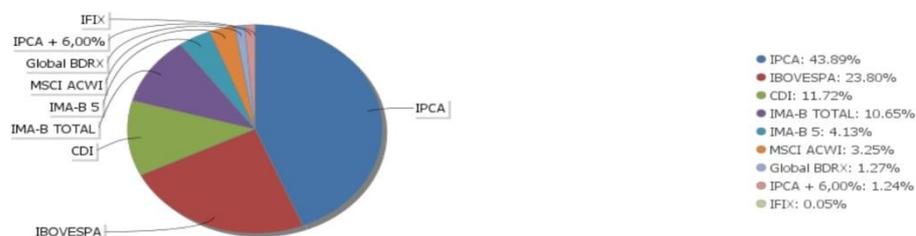
Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



13 de 29

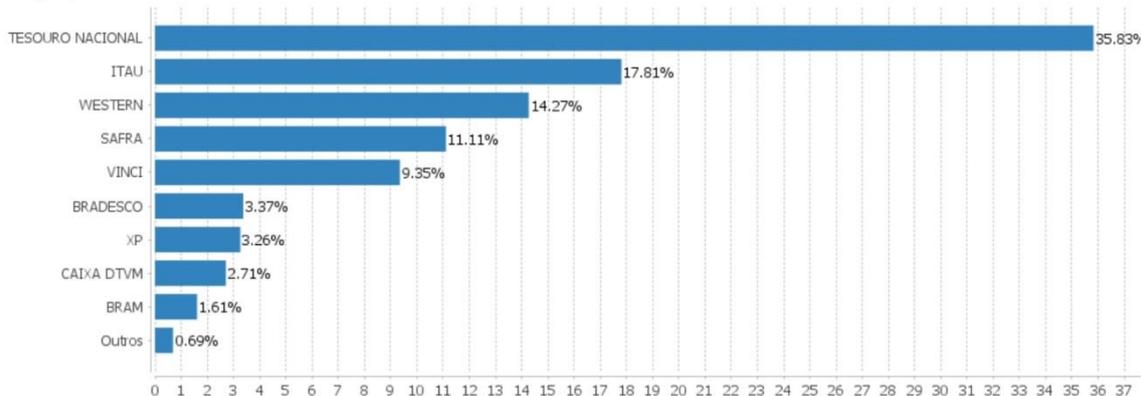


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

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: 28/02/2023

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	-0,47											1,37
IPCA + 4,72%	0,94	1,17											2,12
p.p. indexador	0,91	-1,64											-0,75
2022	-0,70	-0,10	2,07	-1,43	1,00	-1,65	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	10,93
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	0,66	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. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	25	50,00	03 meses	1,12	3,18	-2,06	4,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	50,00	06 meses	2,30	5,12	-2,73	5,02
			12 meses	5,11	10,70	-5,60	5,41
			24 meses	11,03	28,93	-17,90	4,87
Maior rentabilidade da Carteira	3,61	2020-04	36 meses	22,11	42,98	-20,87	7,31
Menor rentabilidade da Carteira	-6,31	2020-03	48 meses	38,24	56,85	-18,61	6,74
			Desde 31/12/2018	43,03	59,44	-16,42	6,65

15 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

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: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



17 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Variação da Estratégia</b>							
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a	0,98	1,47					
Var. IPCA p.p.	0,14	0,38					
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,94	2,10	2,96	4,70	11,45	30,03	43,64
Var. IPCA p.p.	0,10	0,73	0,95	1,97	5,85	13,30	20,85
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,92	2,07	2,91	4,60	11,24	26,06	31,62
Var. IPCA p.p.	0,08	0,70	0,91	1,88	5,65	9,33	8,83
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1,40	2,70	3,55	4,56	9,28	12,54	19,02
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,12	-0,24	-1,31	-2,29	-6,08	-6,99
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	1,23	1,08	0,73	1,49	5,48	2,93	5,69
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05	-0,20	-0,36	-1,53	-2,46	-6,00	-6,70
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,34	2,75	4,10	6,04	10,91	17,23	23,61
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06	1,46	3,02	3,02	2,97	8,29	11,22
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,23	1,41	1,31	3,10	7,77	5,36	7,96
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05	0,13	0,22	0,08	-0,17	-3,57	-4,42
BB PREV IPCA III	1,34	2,74	4,09	6,02	11,98	20,23	26,92
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,08	0,42	0,61	0,33	0,07	-10,93	-19,23
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,14	1,65	1,27	2,66	8,03	14,35	17,15
Var. IPCA p.p.	0,30	0,28	-0,73	-0,07	2,44	-2,38	-5,65
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	1,26	1,23	1,00	2,86	7,58	8,18	11,22
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,05	-0,08	-0,16	-0,36	-0,76	-1,17
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,39	0,98	2,37	4,17	10,00	19,47	26,04
% do CDI	42,74	47,98	74,05	64,77	76,96	100,48	117,22
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1,21	1,14	0,90	2,14	6,50	7,44	11,44
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,07	-0,14	-0,19	-0,88	-1,44	-1,49	-0,94
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	1,22	1,13	0,87	2,61	7,52	8,23	11,26
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06	-0,15	-0,22	-0,41	-0,42	-0,70	-1,12
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	-0,22	0,58	1,68	4,30	10,80	16,04	19,31
% do CDI	-23,76	28,12	52,41	66,69	83,07	82,79	86,96
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,87	1,91	3,08	5,74	12,44	21,11	24,71
% do CDI	94,39	93,04	96,23	88,99	95,68	108,91	111,27
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-10,52	-7,56	-10,33	-16,35	-20,59	-31,43	-31,67
Var. IBOVESPA p.p.	-3,02	-3,18	-3,61	-12,16	-13,34	-26,79	-32,40
VINCI MOSAICO FIA	-6,47	-3,44	-8,16	-8,70	-13,51	-14,46	-13,61

18 de 29



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



Carteira: PIRACAIA		Data Extrato: 28/02/2023						
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS								
Fundo	Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.		1,02	0,94	-1,45	-4,51	-6,26	-9,82	-14,34
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		-9,10	-5,25	-9,65	-15,70	-18,03	-23,37	-39,08
Var. IBOVESPA p.p.		-1,61	-0,87	-2,93	-11,51	-10,78	-18,74	-39,81
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		-6,70	-4,43	-7,51	-9,69	-8,45	-8,78	-1,93
Var. IBOVESPA p.p.		0,80	-0,05	-0,79	-3,50	-1,24	-4,14	-2,66
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI		-7,67	-4,36	-6,78	-5,21	-8,42	-6,86	-1,45
Var. IBOVESPA p.p.		-0,18	0,02	-0,06	-1,01	-1,16	-2,23	-2,18
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		-6,80	-4,55	-2,83	-2,67	0,27	-7,23	-2,97
Var. IBOVESPA p.p.		0,69	-0,17	3,89	1,52	7,52	-2,60	-3,70
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		-7,08	-4,80	-6,69	-11,47	-10,42	-7,84	-12,78
Var. IBOVESPA p.p.		0,41	-0,42	0,02	-7,28	-3,17	-3,20	-13,51
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I		0,75	5,10	0,06	0,40	-10,41	-10,52	51,00
Var. Global BDRX p.p.		-0,40	-0,47	-1,05	-0,13	-0,81	-2,57	-4,73
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NIVEL I PB		0,23	2,79	-2,01	-0,51	-12,58	-11,59	36,54
Var. IBOVESPA p.p.		7,72	7,17	4,71	3,68	-5,33	-6,96	35,81
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		0,93	-0,15	-0,85	2,18	-0,72	-6,38	28,90
Var. MSCI ACWI p.p.		1,85	-3,86	1,08	-0,99	8,03	3,47	-13,11
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		-0,57	1,86	4,82	2,98	-8,42	-31,41	
Var. MSCI ACWI p.p.		0,34	-1,85	6,74	-0,18	0,33	-21,55	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		-3,03	8,58	2,67	-2,35	-19,15	-21,72	17,82
Var. MSCI ACWI p.p.		-2,11	4,87	4,59	-5,51	-10,40	-11,86	-24,19
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		1,39	12,55	8,94	3,74	-16,89	-39,33	19,72
Var. IPCA + 6,00% p.p.		0,13	10,23	5,46	-1,95	-28,80	-70,49	-26,43
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		-0,86	12,03	4,78	11,41	-8,74	-9,19	41,86
Var. MSCI ACWI p.p.		0,06	8,32	6,71	8,24	0,01	0,67	-0,35
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		-1,75	4,54	-0,49	4,70	-0,73	18,78	47,42
Var. IBOVESPA p.p.		5,74	8,92	6,23	8,89	6,53	23,42	46,69
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II		-0,03	-0,07	5,91	1,44	-12,31	20,94	72,76
Var. IBOVESPA p.p.		7,46	4,31	12,63	5,63	-5,06	25,58	72,03
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII		1,23	0,50	-8,00	-33,64	-39,36	-43,44	-36,12
Var. IFIX p.p.		1,68	2,54	-5,95	-28,00	-41,81	-40,73	-30,87
PIRACAIA		-0,47	1,37	1,12	2,39	5,11	11,03	22,11
Var. IPCA + 4,88% p.p.		-1,64	-0,75	-2,05	-2,67	-5,45	-16,98	-18,83
CDI		0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA		-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73

19 de 29



Carteira: PIRACAIA		Data Extrato: 28/02/2023						
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS								
Fundo	Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%		1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%		1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

20 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

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
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		0,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIACÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	0,50

21 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

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 VARIACÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA 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 VARIACÃO 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 VARIACÃO 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: 28/02/2023

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: 28/02/2023

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	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

24 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

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	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79
Investimentos Imobiliários									
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50
Investimentos no Exterior									
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86
Indicadores Econômicos									
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31
Meta Atuarial									
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

25 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
445	01/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,00	629.500,00	30.839,66889708	20,4120220000
450	01/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,00	65.000,00	3.184,39790041	20,4120220000
455	07/02/2023	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	389.917,81	0,00	24.49293116	15.919,6058446000
444	15/02/2023	BB PREV IPCA III	0,00	24.288,72	8.791,94795200	2,7626096210
446	16/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	729.539,64	0,00	35.304,66756546	20,6641130000
447	23/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	400.477,73	0,00	19.379,22120330	20,6653160000
452	23/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	29.355,36	0,00	1.420,51348259	20,6653160000
453	23/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	264.198,24	0,00	12.784,62134332	20,6653160000
454	24/02/2023	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,00	1.160.016,29	3.013,42875661	384,9489680000
448	28/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	16.460,36	0,00	796,99982128	20,6529030000
449	28/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	47.595,01	0,00	2.304,51912741	20,6529030000
451	28/02/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	682.887,35	0,00	33.064,95701839	20,6529030000
456	28/02/2023	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	320.731,63	0,00	20,06219767	15.986,8642159000
<b>Total</b>			<b>2.881.163,13</b>	<b>1.878.805,01</b>		

26 de 29



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.511.763,17

Value-At-Risk: 1,94%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIRACAIA		1,94	1,94			129.516.342,98	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,72%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,315000%)		0,17	0,00	0,19			21.647.565,67	16,71
NTN-B 150826 (5,510000%)		0,17	0,00	0,19			24.756.388,94	19,11
<b>Sub-total</b>	0,19	0,17	0,00		0,06	0,93	46.403.954,61	35,83

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		2,64	0,04	0,48			3.151.862,13	2,43
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		3,07	0,03	0,00			2.087.209,57	1,61
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF		3,46	0,08	0,67			4.747.996,53	3,67
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,91	0,04	0,72			5.353.178,95	4,13
BB PREV IPCA III		1,36	0,00	1,36			829.959,03	0,64
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,37	0,01	2,22			1.600.460,24	1,24
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		1,96	0,05	1,96			6.077.437,50	4,69
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,90	0,00	0,90			1.438.594,30	1,11
<b>Sub-total</b>	3,69	2,19	0,26		0,08	1,23	25.286.698,25	19,52

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO		3,23	0,03	0,31			2.138.986,94	1,65
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		3,15	0,00	0,09			63.742,40	0,05

27 de 29



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,58	0,01	0,58			8.384.347,05	6,47
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,26	0,00	0,26			5.352.211,18	4,13
<b>Sub-total</b>	1,65	0,75	0,05		-0,34	0,36	15.939.287,57	12,31

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a		0,25	0,00	0,26			4.368.324,92	3,37
<b>Sub-total</b>	0,21	0,25	0,00		0,32	0,98	4.368.324,92	3,37

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,30%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI		11,63	0,01	1,24			185.202,66	0,14
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		13,63	0,02	6,68			201.682,64	0,16
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		11,39	0,44	3,02			6.497.827,74	5,02
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,31	0,44	5,57			6.740.106,46	5,20
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		13,09	0,09	5,47			1.128.034,24	0,87
VINCI MOSAICO FIA		12,99	0,06	4,96			794.802,80	0,61
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		11,75	0,05	4,81			807.638,55	0,62
<b>Sub-total</b>	15,00	11,30	1,11		-0,53	-6,98	16.355.295,09	12,63

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		10,31	0,45	14,47			9.852.122,64	7,61
<b>Sub-total</b>	15,87	10,31	0,45		-0,17	-1,75	9.852.122,64	7,61

Artigo 10º II

28 de 29



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



Carteira: PIRACAIA									Data Extrato: 28/02/2023
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS									
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II		0,20	0,00	10,61			3.238.511,83	2,50	
<b>Sub-total</b>	0,12	0,20	0,00		-8,14	-0,03	3.238.511,83	2,50	
<b>Investimentos no Exterior</b> Value-At-Risk: 9,27%									
Artigo 9º II									
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,19	-0,01	6,84			767.593,96	0,59	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		12,46	0,05	9,46			1.313.802,25	1,01	
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,77	0,04	9,70			1.070.570,83	0,83	
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,90	-0,04	12,50			1.054.956,85	0,81	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,70	-0,01	14,70			780.593,53	0,60	
<b>Sub-total</b>	15,45	8,45	0,03		-0,11	-0,77	4.987.517,42	3,85	
Artigo 9º III									
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,72	0,02	1,42			1.641.764,32	1,27	
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,49	0,02	18,38			1.384.086,33	1,07	
<b>Sub-total</b>	17,52	11,48	0,03		-0,02	0,51	3.025.850,65	2,34	
<b>Fundos Imobiliários</b> Value-At-Risk: 1,90%									
Artigo 11º									
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII		1,90	-0,00	3,70			58.780,00	0,05	
<b>Sub-total</b>	4,57	1,90	-0,00		0,07	1,23	58.780,00	0,05	

29 de 29

Sra. Claudia informou que na reunião ocorrida dia 13/03/2023 o Comitê de Investimentos indicou a aplicação de novos recursos na renda fixa, balizado pela análise de cenário e visão de mercado macro para os próximos períodos, o que fez com o que os membros dessem preferência para seleção de fundos que obtivessem maior vantagem da perpetuidade do alto nível das taxas de juros praticadas no Brasil, considerando então o nível de risco x retorno atraente e o nível de liquidez a opção foi pelo fundo ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI - CNPJ: 32.972.942/0001-28. **Os membros aprovam e referendam as indicações do Comitê. Item APROVADO.** Iniciando os Informes gerais, Sra. Claudia e Sr. Robson fizeram um resumo quanto aos **assuntos abordados no 5º Congresso Brasileiro de Investimentos dos RPPS** que ocorreu em Florianópolis SC de 08 a 10 de março. As palestras eram apresentadas em 3 auditórios, sendo possível cada um absorver o conhecimento de 2 temas abordados a cada período. Além de perceber que o Piraprev está em linha com o que sugere grandes profissionais da área, também foi possível se apropriar de conteúdos que contribuirão para que o Comitê de Investimentos atue com maior clareza do que esperar frente ao cenário local e global, buscando a maior assertividade possível para os investimentos do RPPS. A seguir Sra. Claudia informou que **houve a necessidade de realocação** no valor de R\$ 710.649,44 tendo em vista a possibilidade dos recursos alocados durante o mês de fevereiro incidirem em desenquadramento ativo nos termos da Portaria 1467/2021 e da Resolução



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

---

CMN nº 4.963, considerando que o fundo possuía posição de 0,28% em papéis da Americanas S.A., a qual teve sua nota de crédito rebaixada. Foi informado que em 20 de março o Certificado de Regularidade Previdenciária terá a validade expirada, aguardando o envio dos dados contábeis e fiscais pelo Ente, pois é o único critério com status irregular. A Sra. Claudia informa ainda que iniciaram as tratativas com o Ente para a adequação e início de utilização do SIAFIC, sistema único de contabilidade para Ente, Câmara Municipal e Autarquia. Não havendo mais nada a deliberar, a reunião foi encerrada.

Denise Fátima do Carmo

Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva

Lívia Silva Pereira Ferreira

Renata Suyama da Silva

Tatiana Guimarães Moreira de Almeida  
Presidente

Robson Adão Martins Ribeiro  
Auxiliar Financeiro

Claudia Leoncio da Silva  
Superintendente