



Reunião Ordinária do Conselho Administrativo

Aos 18 (dezoito) dias do mês de julho 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, nº 5.050 de 26 de outubro de 2021 e 5.259 de 08 de maio de 2023. Presentes os membros Renata Suyama, Denise Fátima do Carmo, Lívia Silva Pereira, Tatiana Góes Almeida, Cátia Grasseti do Nascimento Maioli, Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva e Tatiana Guimarães Moreira de Almeida. Presente também, Robson Adão Martins Ribeiro, Auxiliar Financeiro. Com quórum suficiente a reunião foi iniciada às 8:37 horas. Sra. Claudia abre a reunião cumprimentando e agradecendo a presença de todos, e fazendo a apresentação dos **processos de aposentadoria e pensão e processos licitatórios** finalizados. **Item APROVADO.**

	Nome	Processo	Concessão	Tipo	Cargo
Pensão	Vanilda da Silva Souza	14/2023	31/05/2023	Pensão por morte	
Aposentadoria	Maria Aparecida Pinheiro	15/2023	03/07/2023	Idade e contribuição	Servente Escolar

Empresa	Objeto
1. Work Med Cursos e Treinamentos Ltda.	Prestação de serviços técnicos de perícias médicas
2. Rodrigues e Figueiredo Sociedade de Advogados	Representação Piraprev – Consultoria Jurídica
3. Robson Santos Profeta (Rotec Ar Condicionado)	Manutenção ar condicionado

Passando a **apresentação do Cenário Macroeconômico de Junho de 2023**: Brasil: O cenário de inflação evoluiu de forma mais favorável recentemente. A desaceleração do IPCA parece um pouco mais rápida que a esperada, ainda que seu núcleo siga em patamar mais elevado e acima da meta. Alguns condicionantes da inflação como taxa de câmbio e commodities, apresentaram trajetória mais benigna. De acordo com o boletim Focus, o consenso para 2023 recuou para 5,0%, enquanto para 2024 está em torno de 4,0%.



	2023				2024				2025		2026	
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal*	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal*	Hoje	Comp. semanal*	Hoje	Comp. semanal*
IPCA (%)	5,12	4,95	4,95	= (1)	4,00	3,92	3,92	= (2)	3,55	▼ (1)	3,50	= (2)
PIB (var. %)	2,14	2,19	2,24	▲ (1)	1,20	1,28	1,30	▲ (1)	1,88	▲ (1)	1,90	▲ (1)
CÂMBIO (R\$/US\$)	5,00	5,00	5,00	= (4)	5,10	5,06	5,05	▼ (3)	5,15	= (1)	5,20	= (2)
SELIC (% a.a.)	12,25	12,00	12,00	= (2)	9,50	9,50	9,50	= (4)	9,00	= (23)	8,75	= (1)

* comportamento dos indicadores desde o último Focus; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento.

▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade
em relação ao Focus anterior

Na ata da última reunião do Copom que manteve a taxa Selic em 13,75%, o Banco Central sinalizou a possibilidade de início de cortes na próxima reunião. O PIB do 1º trimestre registou avanço de 1,9% na margem, superando a nossa projeção mediana das expectativas do mercado (1,2%). Internacional: Permanece a visão de um cenário internacional ainda desafiador. A inflação nas principais economias desenvolvidas continua elevada e acima da meta. O processo de desinflação em curso ocorre num ritmo mais lento, com convergência para níveis mais próximos das metas apenas para o final de 2024. O Banco Central americano (Fed) interrompeu a sequência de alta da taxa de juros e a manteve no intervalo entre 5,00% e 5,25%, conforme a expectativa do mercado. Após forte crescimento da economia chinesa, observado no primeiro trimestre do ano, os sinais de moderação da atividade têm se consolidado. Recuperação abaixo do esperado deve levar a estímulos do governo.

Referências

- Bradesco Asset
- Santander Asset Management
- LDB Consultoria

A seguir, o Sr. Robson apresentou a **Abertura da Carteira de Investimentos**, no site da LDB, onde se verificou que o mês de junho foi encerrado com rentabilidade positiva de 2,29%, acima da meta atuarial em 1,98% com um Patrimônio Líquido total de R\$ **139.490.014,97** (cento e trinta e nove milhões, quatrocentos e noventa mil, quatorze reais e noventa e sete centavos). Apresentou a rentabilidade por Artigo e Análise de liquidez, sendo 41,21% 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 0,44% na Renda Fixa, 7,59% na Renda Variável, 5,08% em Investimentos Estruturados, 5,29% em Investimentos no Exterior e 0,01% em Fundos



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

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 junho. **Item APROVADO.**





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

Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.06.2023.

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.



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 70,46%

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 150525 (6,290000%)	4,14	0,03	0,50	0,50	3.265.456,54	2,34	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,315000%)	0,47	0,02	0,42	5,99	21.868.168,24	15,68	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,620000%)	4,27	0,03	0,60	0,60	3.265.680,61	2,34	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,510000%)	0,47	0,02	0,44	6,09	25.722.016,70	18,44	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a			0,47	0,02	0,44	6,06	54.121.322,09	38,80

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	5,20	0,69	2,30	11,66	3.470.236,06	2,49	345.596.495,55	1,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,32	0,74	2,37	11,20	2.292.856,20	1,64	503.623.885,64	0,46
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	6,29	0,85	2,74	11,49	5.236.953,18	3,75	178.869.996,74	2,93
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,43	0,33	1,43	7,36	5.595.870,76	4,01	469.784.261,23	1,19
BB	BB	BB PREV IPCA III	2,11	0,05	0,93	5,54	852.599,70	0,61	188.237.769,14	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,39	0,06	0,93	5,55	1.644.178,28	1,18	3.755.106.041,15	0,04
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	3,91	0,44	2,22	10,28	6.384.178,93	4,58	2.099.537.000,43	0,30
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,45	0,08	0,82	5,91	1.508.777,17	1,08	765.888.548,32	0,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,01	0,50	1,97	9,46	26.985.650,28	19,35		

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



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,82	0,78	2,57	11,73	2.274.032,69	1,63	368.188.627,92	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,47	0,74	2,37	11,29	70.145,28	0,05	1.330.366.206,19	0,01
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,35	0,13	1,49	4,61	7.982.751,80	5,72	409.971.559,82	1,95
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,72	0,13	1,30	7,10	2.267.094,95	1,63	2.989.973.548,90	0,08
Sub-total Artigo 7º III, Alinea a			1,86	0,25	1,65	6,57	12.594.024,72	9,03		

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	0,95	0,39	0,91	6,39	4.580.404,67	3,28		
Sub-total Artigo 7º IV			0,95	0,39	0,91	6,39	4.580.404,67	3,28		
Renda Fixa			1,47	0,20	1,03	7,06	98.281.401,76	70,46		

2 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

12,74%

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	ITAÚ GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	21,21	-0,21	9,04	7,27	207.714,56	0,15	34.354.048,01	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,49	1,08	8,03	13,04	246.632,99	0,18	675.053.112,68	0,04
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	20,30	-0,00	8,75	7,37	7.299.784,00	5,23	570.091.876,05	1,28
ITAU	ITAU	ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	19,51	-0,09	5,27	-1,57	6.950.514,78	4,98	1.502.509.907,38	0,46
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,84	1,03	7,75	3,91	1.237.073,03	0,89	341.230.820,46	0,36
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	23,08	0,45	10,33	11,33	916.384,26	0,66	762.294.187,16	0,12
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	21,37	-0,02	8,45	7,12	908.694,84	0,65	127.723.279,43	0,71
Sub-total Artigo 8º I			19,86	0,07	7,35	3,70	17.766.798,46	12,74		
Renda Variável			19,86	0,07	7,35	3,70	17.766.798,46	12,74		

3 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 6,04%

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	14,37	-0,64	-2,69	-5,00	730.356,61	0,52	103.537.776,34	0,71
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	14,01	0,72	1,60	6,14	1.587.085,12	1,14	170.856.550,18	0,93
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	25,29	1,26	6,51	24,04	1.500.858,64	1,08	228.145.793,34	0,66
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25,46	1,32	7,07	28,37	1.226.731,61	0,88	71.682.061,30	1,71
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,77	-1,11	-2,81	-14,43	886.293,00	0,64	68.860.478,67	1,29
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	33,30	-0,60	0,56	21,72	844.220,96	0,61	652.308.818,52	0,13
Sub-total Artigo 9º II			16,74	0,39	2,37	11,35	6.775.545,94	4,86		

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	23,77	0,25	0,47	14,53	974.546,71	0,70	2.036.420.590,68	0,05
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	22,24	-0,24	-0,06	7,46	672.710,52	0,48	726.616.425,21	0,09
Sub-total Artigo 9º III			22,77	0,05	0,25	11,45	1.647.257,23	1,18		

Investimentos no Exterior 18,26 0,32 1,95 11,26 8.422.803,17 6,04

4 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 10,73%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatiliid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	19,27	1,30	6,92	19,83	11.293.473,24	8,10	573.296.511,87	1,97
Sub-total Artigo 10º I			19,27	1,30	6,92	19,83	11.293.473,24	8,10		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatiliid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VINCI	BEM	VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	112,55	0,10	0,10	-2,61	3.667.634,63	2,63	291.672.846,10	1,26
Sub-total Artigo 10º II			112,55	0,10	0,10	-2,61	3.667.634,63	2,63		

Investimentos Estruturados 30,18 1,00 5,16 14,51 14.961.107,87 10,73

5 de 31



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS										
0,04%										
Artigo 11* (Fundo de Investimento Imobiliário)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatílid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
KINEA	KINEA	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	34,52	0,04	0,04	-1,00	57.903,71	0,04	13.997.388,53	0,41
Sub-total Artigo 11*			34,52	0,04	0,04	-1,00	57.903,71	0,04		
Fundos Imobiliários			34,52	0,04	0,04	-1,00	57.903,71	0,04		
Total			4,83	0,27	2,29	7,63	139.490.014,97	100,00		

6 de 31



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 30/06/2023

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	54.121.322,09	38,80	0,00	36,34	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	26.985.650,28	19,35	0,00	20,55	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	12.594.024,72	9,03	0,00	8,91	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	4.580.404,67	3,28	0,00	3,53	20,00	0,00	20,00
Total Renda Fixa		98.281.401,76	70,46					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.766.798,46	12,74	0,00	14,97	35,00	0,00	35,00
Total Renda Variável		17.766.798,46	12,74					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	6.775.545,94	4,86	0,00	3,56	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.647.257,23	1,18	0,00	2,27	10,00	0,00	10,00
Total Investimentos no Exterior		8.422.803,17	6,04					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	11.293.473,24	8,10	0,00	7,40	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.667.634,63	2,63	0,00	2,41	5,00	0,00	5,00
Total Investimentos Estruturados		14.961.107,87	10,73					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11*	Fundo de Investimento Imobiliário	57.903,71	0,04	0,00	0,07	5,00	0,00	5,00
Total Fundos Imobiliários		57.903,71	0,04					5,00
Total		139.490.014,97	100,00					

7 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

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, Alinea a % do CDI	0,44 41,41	6,06 93,20	2,41 76,55	6,06 93,20	9,13 67,44	239.193,98	2.787.991,56
Artigo 7º I, Alinea b % do CDI	1,97 183,87	9,46 145,52	5,37 170,72	9,46 145,52	11,60 85,63	509.448,09	2.361.762,33
Artigo 7º III, Alinea a % do CDI	1,65 153,99	6,57 101,09	4,11 130,58	6,57 101,09	11,47 84,72	204.522,79	941.350,30
Artigo 7º IV % do CDI	0,91 84,57	6,39 98,36	3,33 105,93	6,39 98,36	7,63 56,31	41.152,22	275.193,18
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	7,35 -1,05	3,70 -3,92	12,79 -3,12	3,70 -3,92	13,20 -6,64	1.215.982,95	633.122,91
Artigo 9º II % do CDI	2,37 220,69	11,35 174,64	1,95 61,90	11,35 174,64	10,79 79,69	156.586,02	611.905,71
Artigo 9º III % do CDI	0,25 23,56	11,45 176,18	4,34 137,96	11,45 176,18	10,45 77,19	4.149,10	238.628,96
Artigo 10º I % do CDI	6,92 645,58	19,83 305,19	10,24 325,37	19,83 305,19	27,85 205,61	730.974,28	1.869.148,99
Artigo 10º II % do CDI	0,10 9,69	-2,61 -40,13	-0,81 -25,68	-2,61 -40,13	-1,33 -9,79	3.804,26	27.404,78
Artigo 11º % do CDI	0,04 3,43	-1,00 -15,42	0,62 19,80	-1,00 -15,42	-34,66 -255,90	21,26	-586,04
PIRACAIA (Total)						3.105.834,95	9.745.922,68

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150525 (6,290000%)	3.249.281,06	0,00	0,00	0,00	3.265.456,54	16.175,48	16.175,48
NTN-B 150535 (5,315000%)	21.776.488,80	0,00	0,00	0,00	21.868.168,24	91.679,44	1.265.004,79
NTN-B 150824 (7,620000%)	3.246.140,26	0,00	0,00	0,00	3.265.680,61	19.540,35	19.540,35
NTN-B 150826 (5,510000%)	25.610.217,99	0,00	0,00	0,00	25.722.016,70	111.798,71	1.487.270,94
					54.121.322,09	239.193,98	

8 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA III	844.758,17	0,00	0,00	0,00	852.599,70	7.841,53	45.358,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	2.239.837,38	0,00	0,00	0,00	2.292.856,20	53.018,82	231.024,70
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.629.004,74	0,00	0,00	0,00	1.644.178,28	15.173,54	87.713,79
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1.496.451,78	0,00	0,00	0,00	1.508.777,17	12.325,39	84.208,20
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.833.153,32	1.180.395,55	-754.000,00	0,00	6.384.178,93	124.630,06	611.908,29
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.392.267,44	0,00	0,00	0,00	3.470.236,06	77.968,62	378.444,34
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5.097.124,27	0,00	0,00	0,00	5.236.953,18	139.828,91	539.654,04
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	5.517.209,54	0,00	0,00	0,00	5.595.870,76	78.661,22	383.450,77
					26.985.650,28	509.448,09	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	68.518,87	0,00	0,00	0,00	70.145,28	1.626,41	7.116,07
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	2.238.049,20	0,00	0,00	0,00	2.267.094,95	29.045,75	342.341,03
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.216.998,76	0,00	0,00	0,00	2.274.032,69	57.033,93	243.252,60
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	7.865.935,10	0,00	0,00	0,00	7.982.751,80	116.816,70	348.640,60
					12.594.024,72	204.522,79	

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	4.539.252,45	0,00	0,00	0,00	4.580.404,67	41.152,22	275.193,18
					4.580.404,67	41.152,22	

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	228.296,71	0,00	0,00	0,00	246.632,99	18.336,28	28.457,45
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.602.809,06	0,00	0,00	0,00	6.950.514,78	347.705,72	-110.682,58
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	190.489,94	0,00	0,00	0,00	207.714,56	17.224,62	14.074,88

9 de 31



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.148.135,39	0,00	0,00	0,00	1.237.073,03	88.937,64	46.518,24
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	837.905,22	900.704,91	-900.704,91	0,00	908.694,84	70.789,62	60.374,97
VINCI MOSAICO FIA	830.605,92	0,00	0,00	0,00	916.384,26	85.778,34	93.291,97
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	6.712.573,27	0,00	0,00	0,00	7.299.784,00	587.210,73	501.087,98
					17.766.798,46	1.215.982,95	

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	1.409.190,59	0,00	0,00	0,00	1.500.858,64	91.668,05	290.902,90
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.145.778,05	0,00	0,00	0,00	1.226.731,61	80.953,56	271.096,00
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	911.942,68	0,00	0,00	0,00	886.293,00	-25.649,68	-149.418,04
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	839.495,47	0,00	0,00	0,00	844.220,96	4.725,49	150.663,63
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	1.562.026,88	0,00	0,00	0,00	1.587.085,12	25.058,24	87.085,12
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	750.526,25	0,00	0,00	0,00	730.356,61	-20.169,64	-38.423,90
					6.775.545,94	156.586,02	

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	970.006,20	0,00	0,00	0,00	974.546,71	4.540,51	162.441,84
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	673.101,93	0,00	0,00	0,00	672.710,52	-391,41	76.187,12
					1.647.257,23	4.149,10	

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	10.562.498,96	0,00	0,00	0,00	11.293.473,24	730.974,28	1.869.148,99

10 de 31



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					11.293.473,24	730.974,28	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	3.663.830,37	0,00	0,00	0,00	3.667.634,63	3.804,26	27.404,78
					3.667.634,63	3.804,26	

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	57.882,45	0,00	0,00	0,00	0,00	57.903,71	21,26	-586,04
						57.903,71	21,26	

11 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	57.489.762,92	41,21	57.489.762,92	41,21	
de 31 dias a 365 dias	21.714.517,35	15,57	79.204.280,27	56,78	
acima de 365 dias	60.285.734,70	43,22	139.490.014,97	100,00	

12 de 31

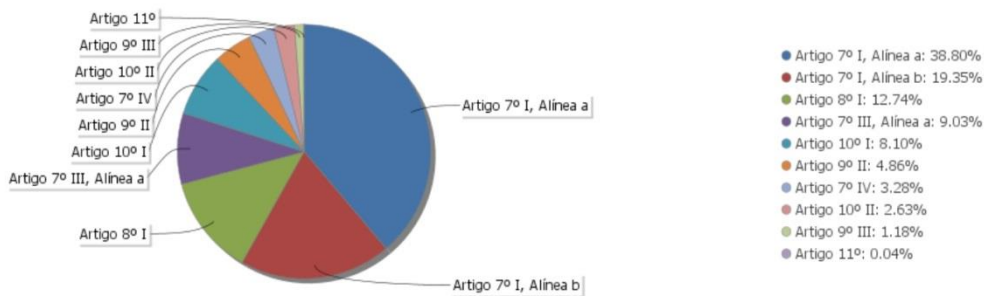


Carteira: PIRACAIA

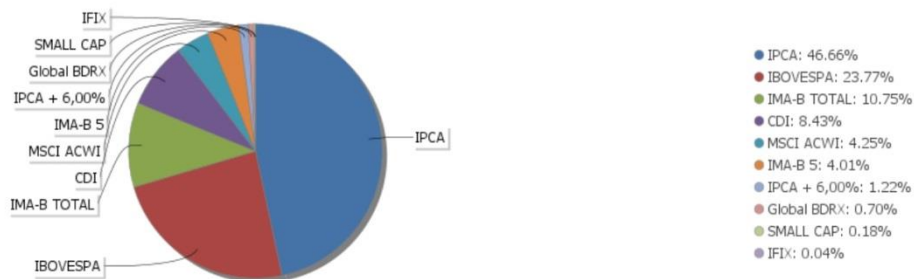
Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



13 de 31



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

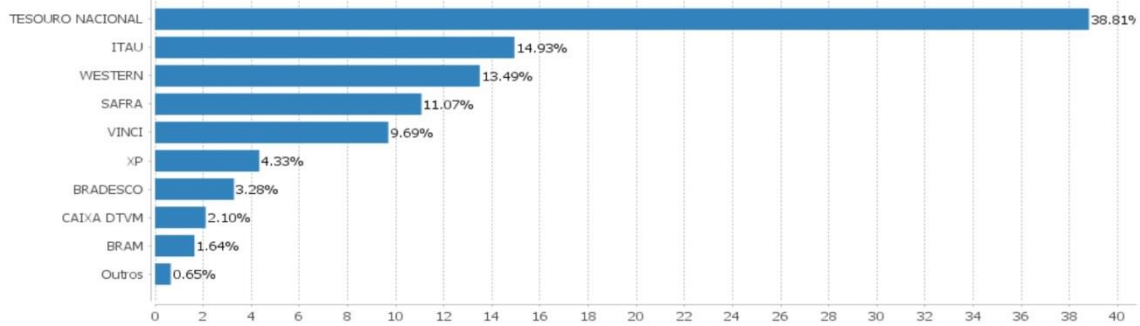


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



14 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

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	1,11	0,97	1,67	2,29							7,63
IPCA + 4,72%	0,94	1,17	1,13	0,94	0,63	0,30							5,23
p.p. indexador	0,91	-1,64	-0,03	0,03	1,04	1,98							2,40
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	18,00
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	28	51,85
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	48,15
Rentabilidade	Mês	
Maior rentabilidade da Carteira	3,61	2020-04
Menor rentabilidade da Carteira	-6,31	2020-03

Relatório

Periodo	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	5,01	1,89	3,12	4,30
06 meses	7,63	5,23	2,40	4,19
12 meses	11,66	8,09	3,57	4,83
24 meses	12,44	27,18	-14,73	4,93
36 meses	28,14	45,29	-17,14	4,93
48 meses	39,11	56,58	-17,46	6,72
Desde 31/12/2018	51,86	64,30	-12,44	6,51

15 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



16 de 31

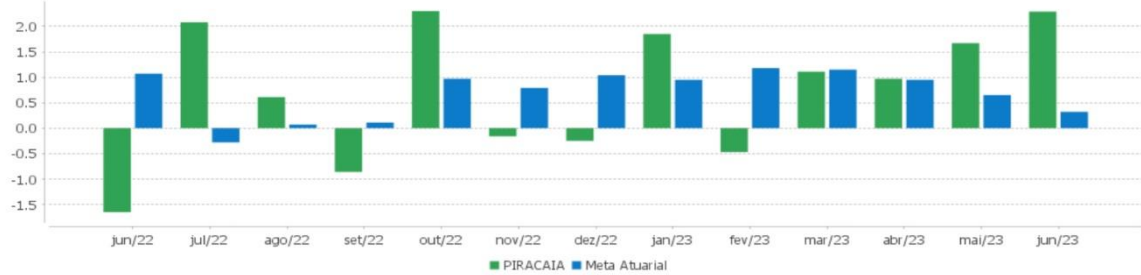


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



17 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a	0,91	6,39	3,33				
Var. IPCA p.p.	0,99	3,82	2,57				
NTN-B 150525 (6,290000%)	0,50	3,41	-0,36	3,41	3,76		
Var. IPCA p.p.	0,58	0,54	-1,12	0,54	0,60		
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,44	6,09	2,41	6,09	9,21	28,82	47,06
Var. IPCA p.p.	0,52	3,22	1,65	3,22	6,05	13,40	22,00
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,42	5,99	2,37	5,99	9,01	28,35	38,48
Var. IPCA p.p.	0,50	3,12	1,61	3,12	5,85	12,92	13,42
NTN-B 150824 (7,620000%)	0,60	3,99	2,91	3,99	4,94		
Var. IPCA p.p.	0,68	1,12	2,15	1,12	1,77		
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1,43	7,36	3,17	7,36	9,32	16,52	21,01
Var. IMA-B 5 p.p.	0,37	0,31	0,62	0,31	-0,91	-4,80	-7,67
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	2,74	11,49	7,67	11,49	12,37	12,54	18,21
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,35	0,12	0,57	0,12	-1,15	-5,27	-8,34
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,93	5,55	1,44	5,55	8,42	18,34	24,09
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,46	-5,81	-5,66	-5,81	-5,11	0,53	-2,47
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,30	11,66	7,30	11,66	13,92	14,37	20,81
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,09	0,29	0,19	0,29	0,40	-3,44	-5,75
BB PREV IPCA III	0,93	5,54	1,44	5,54	9,24	21,24	28,43
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,52	-0,32	-0,75	-0,32	-0,08	-8,42	-20,45
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB	2,37	11,20	7,03	11,20	13,18	17,03	25,29
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,16	-0,07	-0,16	-0,35	-0,78	-1,27
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	2,22	10,28	5,91	10,28	12,95	23,06	25,02
Var. IPCA p.p.	2,30	7,41	5,15	7,41	9,79	7,64	-0,04
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,82	5,91	3,56	5,91	10,77	23,24	26,30
% do CDI	76,83	90,96	113,26	90,96	79,49	99,45	100,49
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,57	11,73	7,47	11,73	12,55	16,53	24,65
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18	0,37	0,37	0,37	-0,98	-1,28	-1,91
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	2,37	11,29	7,16	11,29	13,23	17,19	25,59
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,08	0,06	-0,08	-0,30	-0,62	-0,97
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,49	4,61	3,33	4,61	11,11	19,58	22,25
% do CDI	138,54	70,93	105,98	70,93	82,07	83,80	85,02
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1,30	7,10	3,67	7,10	13,07	25,65	28,46

18 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
% do CDI	121,07	109,27	116,52	109,27	96,49	109,74	108,74
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8,03	13,04	24,57	13,04	18,85	-28,83	-2,28
Var. SMALL CAP p.p.	-0,14	-0,22	-0,60	-0,22	-0,94	-1,19	-3,32
VINCI MOSAICO FIA	10,33	11,33	19,32	11,33	16,60	-11,98	13,19
Var. IBOVESPA p.p.	1,33	3,72	3,41	3,72	-3,23	-5,11	-11,04
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	7,75	3,91	15,52	3,91	5,48	-28,99	-13,96
Var. IBOVESPA p.p.	-1,26	-3,70	-0,39	-3,70	-14,36	-22,12	-38,19
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	8,75	7,37	16,30	7,37	13,90	-10,69	14,20
Var. IBOVESPA p.p.	-0,25	-0,24	0,40	-0,24	-5,94	-3,82	-10,03
ITAU GOVERNANÇA CORPORATIVA ACOES FI	9,04	7,27	15,93	7,27	18,46	-10,15	22,08
Var. IBOVESPA p.p.	0,04	-0,34	0,02	-0,34	-1,37	-3,28	-2,15
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5,27	-1,57	7,34	-1,57	13,35	-15,61	15,87
Var. IBOVESPA p.p.	-3,74	-9,18	-8,57	-9,18	-6,48	-8,73	-8,36
VINCI FATORIAL DINÂMICO FIA	8,45	7,12	15,84	7,12	11,75	-14,66	9,40
Var. IBOVESPA p.p.	-0,55	-0,49	-0,06	-0,49	-8,09	-7,79	-14,83
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,47	14,53	5,60	14,53	13,40	-1,43	24,43
Var. Global BDRX p.p.	-0,02	-0,61	-0,29	-0,61	-1,04	-2,02	-4,32
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-0,06	7,46	2,43	7,46	6,61	-9,35	17,08
Var. IBOVESPA p.p.	-9,06	-0,15	-13,48	-0,15	-13,23	-2,48	-7,15
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-2,69	-5,00	-3,51	-5,00	-1,29	-4,82	0,97
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,59	-9,18	-3,66	-9,18	-6,56	3,80	-13,51
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-2,81	-14,43	-12,93	-14,43	-20,69	-37,10	-28,47
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,72	-18,61	-13,08	-18,61	-25,96		
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	1,60	-5,49	7,20	-5,49	-0,91	29,15	
Var. MSCI ACWI p.p.	1,70	-9,67	7,05	-9,67	-6,18	37,78	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	6,51	24,04	8,57	24,04	18,53	-18,54	14,00
Var. MSCI ACWI p.p.	6,60	19,86	8,42	19,86	13,26	-9,91	-0,48
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,56	21,72	5,61	21,72	25,89	-30,09	-9,99
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,16	15,86	3,41	15,86	16,57	-59,75	-58,87
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7,07	28,37	7,88	28,37	37,38	0,10	39,76
Var. MSCI ACWI p.p.	7,16	24,19	7,73	24,19	32,11	8,73	25,27
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	6,92	19,83	10,24	19,83	27,85	20,43	66,80
Var. IBOVESPA p.p.	-2,08	12,22	-5,67	12,22	8,01	27,30	42,57
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	0,10	2,93	-1,87	2,93	4,29	25,30	86,14
Var. IBOVESPA p.p.	-8,90	-4,68	-17,78	-4,68	-15,54	32,18	61,91
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	0,04	-1,00	0,62	-1,00	-34,66	-27,96	-40,14

19 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
Var. IFIX p.p.	-4,67	-11,05	-13,66	-11,05	-47,52	-42,50	-52,58
PIRACAIA	2,29	7,63	5,01	7,63	11,66	12,44	28,14
Var. IPCA + 4,88% p.p.	1,98	2,40	3,12	2,40	3,65	-14,11	-15,42
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

20 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

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
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		0,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50

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

O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100%

21 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

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 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	2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIACÃO DO CERTIFICADO DE DEPOSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	0,50
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+1 du	D+1 du	D+6 du		
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	Não se aplica	Não se aplica				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80

22 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
INVESTIMENTO NO EXTERIOR						
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	D+3	D+3	D+3	D+5		0,60
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTISTRATÉGIA II	Não se aplica	Não se aplica				
VINCI FATORIAL DINÂMICO 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 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

24 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

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	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

25 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (6,290000%)	3.265.456,54	6,290000	3.278.732,84	6,043200	13.276,30
NTN-B 150535 (5,315000%)	21.868.168,24	5,315000	22.023.611,58	5,229500	155.443,34
NTN-B 150824 (7,620000%)	3.265.680,61	7,620000	3.273.133,25	7,388100	7.452,64
NTN-B 150826 (5,510000%)	25.722.016,70	5,510000	25.791.444,09	5,410000	69.427,39

26 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
495	01/06/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	691.000,00	31.495,35956215	21,9397400000
499	01/06/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	63.000,00	2.871,50166775	21,9397400000
496	05/06/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	25.517,19	0,00	1.156,56523216	22,0629060000
497	09/06/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	404.807,75	0,00	18.301,50914936	22,1188180000
501	09/06/2023	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	900.704,91	0,00	338.445,78250860	2,6612975000
502	09/06/2023	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	0,00	900.704,91	338.445,78250860	2,6612975000
498	23/06/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	449.044,85	0,00	20.181,91890564	22,2498590000
500	23/06/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	301.025,76	0,00	13.529,33337690	22,2498590000
Total			2.081.100,46	1.654.704,91		

27 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 2.052.438,43 Value-At-Risk: 1,47%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIRACAIA		1,47	1,47			139.490.014,97	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,44%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,290000%)		0,22	-0,00	0,24			3.265.456,54	2,34
NTN-B 150535 (5,315000%)		0,13	-0,00	0,12			21.868.168,24	15,68
NTN-B 150824 (7,620000%)		0,23	-0,00	0,27			3.265.680,61	2,34
NTN-B 150826 (5,510000%)		0,13	-0,00	0,12			25.722.016,70	18,44
Sub-total	0,37	0,12	-0,01		-1,72	0,44	54.121.322,09	38,80

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		1,91	0,02	0,13			3.470.236,06	2,49
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		1,85	0,01	0,01			2.292.856,20	1,64
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF		1,83	0,03	0,30			5.236.953,18	3,75
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,02	0,01	0,32			5.595.870,76	4,01
BB PREV IPCA III		0,83	0,00	0,82			852.599,70	0,61
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,83	0,00	1,60			1.644.178,28	1,18
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,45	0,03	1,47			6.384.178,93	4,58
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,68	0,00	0,68			1.508.777,17	1,08
Sub-total	3,26	1,31	0,10		0,28	1,97	26.985.650,28	19,35

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

28 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO		1,93	0,01	0,24			2.274.032,69	1,63
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,94	0,00	0,11			70.145,28	0,05
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,59	0,01	0,59			7.982.751,80	5,72
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,32	0,00	0,32			2.267.094,95	1,63
Sub-total	1,42	0,62	0,02		0,41	1,65	12.594.024,72	9,03

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		0,16	0,00	0,18			4.580.404,67	3,28
Sub-total	1,31	0,16	0,00		-0,13	0,91	4.580.404,67	3,28

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,59%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI		8,43	0,01	0,58			207.714,56	0,15
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11,19	0,02	0,18			246.632,99	0,18
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		8,24	0,36	1,63			7.299.784,00	5,23
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,98	0,27	4,12			6.950.514,78	4,98
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		8,78	0,06	3,21			1.237.073,03	0,89
VINCI MOSAICO FIA		9,94	0,05	3,01			916.384,26	0,66
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		8,75	0,05	1,92			908.694,84	0,65
Sub-total	15,04	7,59	0,82		0,42	7,35	17.766.798,46	12,74

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,29%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		6,73	0,40	8,81			11.293.473,24	8,10
Sub-total	10,53	6,73	0,40		0,56	6,92	11.293.473,24	8,10

29 de 31



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTISTRATÉGIA II		3,45	0,01	9,32			3.667.634,63	2,63
Sub-total	0,36	3,45	0,01		-2,69	0,10	3.667.634,63	2,63

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,08%

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		5,85	-0,01	6,09			730.356,61	0,52
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR		4,62	0,01	7,57			1.587.085,12	1,14
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		9,04	0,06	7,67			1.500.858,64	1,08
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,43	0,05	7,59			1.226.731,61	0,88
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,59	-0,01	7,77			886.293,00	0,64
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,84	0,00	11,85			844.220,96	0,61
Sub-total	8,78	4,92	0,10		0,15	2,37	6.775.545,94	4,86

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,63	0,01	0,62			974.546,71	0,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		7,14	0,01	11,89			672.710,52	0,48
Sub-total	12,90	7,27	0,02		-0,06	0,25	1.647.257,23	1,18

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,01%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII		0,01	0,00	2,19			57.903,71	0,04

30 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,13	0,01	0,00		-8,14	0,04	57.903,71	0,04

31 de 31



O Sr. Robson informou que na reunião ocorrida dia 12/07/2023 o Comitê de Investimentos indicou que este é o momento preciso para investimentos pré-fixados, tendo em vista a sinalização do COPOM em iniciar o corte de juros já para a próxima reunião que ocorrerá no início de agosto. Frente a isso iniciou-se uma corrida para busca de novos Fundos de Investimentos com essa característica, solicitado à vários gestores, para aplicação dos novos aportes, a partir das próximas contribuições previdenciárias, a fim de garantir a máxima rentabilidade com a taxa Selic ainda em 13,75%. Os Fundos serão analisados pelo Comitê para definição da melhor estratégia em reunião extraordinária que deve ocorrer até o final de julho. Assim, as novas aplicações se mantêm em renda fixa, com a característica de pré-fixado, após análise do Comitê de Investimentos. **Item APROVADO.** A seguir a Sra. Claudia comunicou o início dos trabalhos para a renovação da Certificação Pró-Gestão, porém com esforços redobrados para a conquista da Certificação no nível II, demonstrando que o Piraprev segue num processo contínuo de aperfeiçoamento da gestão. A certificação atual vencerá em 27/10/2023. A seguir informou aos membros que divergências foram encontradas no SICONFI Sistema de Informações Contábeis e Fiscais do Setor Público Brasileiro, referente aos dados do Piraprev, após a consolidação e envio realizados pelo ente. No exercício anterior o Piraprev já teve sua classificação rebaixada do 15º para o 199º lugar no Brasil pelo Indicador de Situação Previdenciária ISP por conta de valores informados erroneamente. É público que a Prefeitura teve e ainda tem sérios problemas com o sistema de contabilidade, anterior e a atual, que ainda busca corrigir dados e valores gerados incorretamente. O Sr. Rubens, contador do Piraprev está em contato com o contador contratado pela Prefeitura para que corrija os dados e o Piraprev possa assumir a colocação e classificação que realmente faz jus, e, caso a correção não seja realizada a Superintendente oficializará o Sr. Prefeito quanto ao ocorrido e suas consequências. Por fim, Sra. Claudia realizou um sorteio entre os membros que tem disponibilidade, para a participação no EXPERT XP, pois o Piraprev recebeu 3 convites em cortesia. O membro sorteado foi Denise Fátima do Carmo que participará com um representante do Comitê de Investimentos e a Superintendente do Piraprev. O evento ocorrerá em São Paulo, de 31/08 a 02/09/2023. Sendo só, a reunião foi encerrada.

Piracaia, 18 de julho de 2023.



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

Cátia Grasseti do Nascimento Maioli

Denise Fátima do Carmo

Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva

Lívia Silva Pereira

Renata Suyama

Tatiana Guimarães Moreira de Almeida
Presidente

Tatiane Góes Almeida

Robson Adão Martins Ribeiro
Auxiliar Financeiro

Claudia Leoncio da Silva
Superintendente