



### Reunião Ordinária do Conselho Administrativo

Aos 17 (dezesete) dias do mês de outubro 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 Denise Fátima do Carmo, Tatiana Góes Almeida, Cátia Grasseti do Nascimento Maioli, Renata Suyama e Tatiana Guimarães Moreira de Almeida. Presente também, Robson Adão Martins Ribeiro, Auxiliar Financeiro. Com quórum suficiente a reunião foi iniciada às 8:45 horas, com a Sra. Claudia cumprimentando e agradecendo a presença de todos. Inicialmente fez a **apresentação dos processos licitatórios, de aposentadoria e de pensão por morte**, todos verificados e aprovados pelos membros. **Item APROVADO.**

	Nome	Processo	Concessão	Tipo	Cargo
Aposentadorias	Maria Margarete da Silva	20/2023	02/10/2023	Professor	Professor
Pensão	Ricardo Ap. Fernandes de Moraes / Samuel Fernandes R. Moraes / Raquel Fernandes Moraes	21/2023	02/10/2023	Pensão por morte	Verônica Sebastiana Pereira Fernandes Moraes (Professora)

	Nome	Processo	Objeto
Licitação	Instituto TOTUM de Desenvolvimento e Gestão Empresarial Ltda.	14/2023	Contratação de Empresa especializada para Certificação do IPSPMP-PIRAPREV no Pró-Gestão RPPS Nível II
	Tecnopública Tecnologia em Administração Pública Ltda.	16/2023	Contratação de Empresa especializada na prestação de serviços contábeis no âmbito da administração pública aplicada a Regime Próprio de Previdência Social para o IPSPMP-PIRAPREV

### Sra. Claudia iniciou a apresentação do **Cenário Macroeconômico – Setembro 2023**

O PIB do 2º trimestre avançou 0,9% na margem, superando projeções e expectativas do mercado (0,3%). A indústria avançou 0,9%, em função da atividade extrativa mineral, enquanto o setor de serviços cresceu 0,6%. Destaque também para a agropecuária. Outro destaque relevante foi o desempenho líquido negativo do setor externo, com alta de 2,9% das exportações aquém da



elevação de 4,5% das importações. Os resultados revelaram resiliência do consumo, na contramão das expectativas de desaceleração diante do aperto monetário. O Banco Central sinalizou manutenção do ritmo de corte de juros de 50 pb nas próximas reuniões. As condições locais com destaque para as incertezas fiscais e a resiliência da economia deve manter o COPOM cauteloso em acelerar a magnitude dos cortes.

Os dados de emprego mostraram estabilidade do mercado de trabalho. Segundo a PNAD Contínua, a taxa de desemprego atingiu 7,8% no trimestre encerrado em agosto, em linha com as expectativas. O rendimento médio real habitual teve alta de 0,3% na margem no trimestre móvel encerrado em agosto, acompanhado pela massa de rendimento real.

No cenário externo, destaque para a elevação das taxas de juros de longo prazo nos EUA e interrupção da desaceleração da economia chinesa, pelas diversas medidas anunciadas nos últimos meses, sugerindo provável estabilização do crescimento. Lançamentos e vendas de imóveis residenciais ainda segue presente, mas os estímulos fiscais e monetários têm dado algum suporte para o restante da economia, sugerindo que pior momento para economia chinesa ficou para trás.

Fed manteve a taxa de juros inalterada, em linha com as expectativas, sem sinalizar o encerramento do ciclo. O Banco Central Europeu indicou o encerramento do ciclo de alta dos juros, permanecendo a expectativa de que a economia mais fraca continue a contribuir para a desinflação na região.

Referência:

Bradesco Asset Management

Logo em seguida o Sr. Robson apresentou a Abertura da Carteira de Investimentos, no site da LDB, onde se verificou que o mês de setembro foi encerrado com rentabilidade negativa de -0,09%, abaixo da meta atuarial em -0,72% com um Patrimônio Líquido total de R\$ **140.791.519,42** (cento e quarenta milhões, setecentos e noventa e um mil, quinhentos e dezenove reais e quarenta e dois centavos) Apresentou também a rentabilidade por Artigo e Análise de liquidez, sendo 41,74% 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 demonstrando VaR de 0,36% na Renda Fixa, 6,82% na Renda Variável, 4,63% em Investimentos Estruturados, 3,81% em Investimentos no Exterior e 0,49% 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 setembro. **Item APROVADO.**



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



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.09.2023.

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: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 71,12%

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

Emissor	Título Público	Volatili-d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,290000%)	4,15	0,05	0,73	2,55	3.332.175,54	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,315000%)	0,37	0,04	0,66	7,90	22.263.061,45	15,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,620000%)	3,00	0,05	0,83	2,98	3.245.582,11	2,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,510000%)	0,37	0,04	0,68	8,05	25.455.925,40	18,08
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alinea a</b>		<b>0,37</b>	<b>0,04</b>	<b>0,68</b>	<b>8,05</b>	<b>54.296.744,50</b>	<b>38,57</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili-d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	3,23	0,31	0,15	1,09	12.982.736,35	9,22	129.177.898,25	10,05
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,76	0,53	-1,05	10,68	475.414,07	0,34	391.123.621,73	0,12
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,95	0,51	-0,97	10,54	4.716,47	0,00	559.428.321,06	0,00
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5,97	0,62	-1,38	10,23	331.401,74	0,24	175.206.136,20	0,19
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,27	0,33	-0,32	8,46	5.653.537,75	4,02	458.976.163,58	1,23
BB	BB	BB PREV IPCA III	1,86	0,16	1,09	8,79	853.625,14	0,61	188.464.404,15	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,87	0,16	1,10	8,81	1.651.179,01	1,17	3.791.584.166,14	0,04
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,86	0,41	-0,30	11,35	7.028.944,52	4,99	2.195.169.805,31	0,32
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,89	0,03	0,41	7,63	1.533.242,27	1,09	666.747.713,80	0,23
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alinea b</b>			<b>3,68</b>	<b>0,32</b>	<b>0,02</b>	<b>10,89</b>	<b>30.514.797,32</b>	<b>21,67</b>		

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

1 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili-d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,36	0,57	-1,26	10,64	77.129,66	0,05	470.464.896,61	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,09	0,52	-1,00	10,71	69.777,77	0,05	1.357.142.226,13	0,01
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,37	0,13	0,79	7,89	8.233.325,22	5,85	359.052.244,60	2,29
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,86	0,17	0,42	9,32	2.272.111,09	1,61	2.836.954.249,95	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alinea a</b>			<b>1,58</b>	<b>0,14</b>	<b>0,68</b>	<b>9,50</b>	<b>10.652.343,74</b>	<b>7,57</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili-d. 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	0,81	-0,02	0,71	8,47	4.669.795,48	3,32		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>0,81</b>	<b>-0,02</b>	<b>0,71</b>	<b>8,47</b>	<b>4.669.795,48</b>	<b>3,32</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,33</b>	<b>0,13</b>	<b>0,48</b>	<b>8,98</b>	<b>100.133.681,04</b>	<b>71,12</b>		

2 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL 12,29%

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	20,19	0,73	0,92	6,46	206.151,12	0,15	32.819.516,65	0,63
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,89	1,17	-2,87	4,86	228.786,41	0,16	663.773.561,70	0,03
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	19,82	0,73	-0,29	4,79	7.124.671,83	5,06	523.513.516,16	1,36
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DINAMIS FIC	18,39	0,40	-0,20	-4,19	6.765.518,95	4,81	1.385.431.873,10	0,49
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,38	1,41	-0,53	-1,58	1.171.725,52	0,83	260.783.503,19	0,45
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	22,15	1,05	-0,03	10,30	907.888,81	0,64	679.201.219,91	0,13
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	21,09	0,75	0,33	5,96	898.917,11	0,64	151.482.616,97	0,59
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,09</b>	<b>0,67</b>	<b>-0,25</b>	<b>0,99</b>	<b>17.303.659,75</b>	<b>12,29</b>		
Renda Variável			19,09	0,67	-0,25	0,99	17.303.659,75	12,29		

3 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 5,95%

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 INTERIACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,41	-0,43	0,08	-1,62	756.341,92	0,54	109.200.105,60	0,69
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	13,73	-1,37	6,02	9,46	1.636.665,48	1,16	189.065.805,51	0,87
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	23,18	0,45	-5,72	23,57	1.495.155,57	1,06	219.244.938,37	0,68
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTEC ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,92	0,01	-6,53	14,49	1.094.086,51	0,78	61.493.451,45	1,78
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,50	-0,27	-2,21	-15,94	870.592,87	0,62	60.961.663,70	1,43
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,81	2,40	-3,77	22,95	852.712,00	0,61	634.297.137,32	0,13
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>15,05</b>	<b>-0,02</b>	<b>-1,85</b>	<b>10,20</b>	<b>6.705.554,35</b>	<b>4,76</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	21,98	-0,35	-3,57	16,05	987.453,61	0,70	1.999.422.357,55	0,05
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	20,29	-0,62	-2,80	10,06	689.018,52	0,49	693.152.671,17	0,10
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>20,93</b>	<b>-0,46</b>	<b>-3,26</b>	<b>13,43</b>	<b>1.676.472,13</b>	<b>1,19</b>		
Investimentos no Exterior			16,45	-0,11	-2,14	10,72	8.382.026,48	5,95		

4 de 31



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



Carteira: PIRACAIA										Data Extrato: 29/09/2023	
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS											
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS										10,59%	
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)											
Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo	
				Dia	Mês	Ano					
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	16,86	-0,25	-4,40	17,53	11.076.523,40	7,87	538.230.379,11	2,06	
Sub-total Artigo 10º I			16,86	-0,25	-4,40	17,53	11.076.523,40	7,87			
Artigo 10º II (Fundo de Participação)											
Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo	
				Dia	Mês	Ano					
VINCI	BEM	VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTISTRATÉGIA II	100,67	2,98	2,98	0,17	3.831.191,04	2,72	310.744.480,29	1,23	
Sub-total Artigo 10º II			100,67	2,98	2,98	0,17	3.831.191,04	2,72			
Investimentos Estruturados			27,50	0,56	-2,54	13,75	14.907.714,44	10,59			

5 de 31



Carteira: PIRACAIA										Data Extrato: 29/09/2023	
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS											
FUNDOS IMOBILIÁRIOS										0,05%	
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)											
Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo	
				Dia	Mês	Ano					
KINEA	KINEA	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	35,86	9,62	9,62	10,17	64.437,71	0,05	15.576.886,87	0,41	
Sub-total Artigo 11º			35,86	9,62	9,62	10,17	64.437,71	0,05			
Fundos Imobiliários			35,86	9,62	9,62	10,17	64.437,71	0,05			
Total			4,36	0,23	-0,09	8,54	140.791.519,42	100,00			

6 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	54.296.744,50	38,57	0,00	36,34	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	30.514.797,32	21,67	0,00	20,55	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	10.652.343,74	7,57	0,00	8,91	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	4.669.795,48	3,32	0,00	3,53	20,00	0,00	20,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100.133.681,04</b>	<b>71,12</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.303.659,75	12,29	0,00	14,97	35,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>17.303.659,75</b>	<b>12,29</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	6.705.554,35	4,76	0,00	3,56	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.676.472,13	1,19	0,00	2,27	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>8.382.026,48</b>	<b>5,95</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	11.076.523,40	7,87	0,00	7,40	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.831.191,04	2,72	0,00	2,41	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>14.907.714,44</b>	<b>10,59</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	64.437,71	0,05	0,00	0,07	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>64.437,71</b>	<b>0,05</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>140.791.519,42</b>	<b>100,00</b>					

7 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

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	0,68	8,05	1,88	4,33	10,66	368.215,76	3.794.461,30
% do CDI	70,05	81,05	58,28	66,95	79,28		
Artigo 7º I, Alínea b	0,02	10,89	1,31	6,75	11,20	1.750,39	2.714.912,23
% do CDI	1,67	109,72	40,74	104,42	83,30		
Artigo 7º III, Alínea a	0,68	9,50	2,75	6,97	11,55	72.537,08	1.241.669,32
% do CDI	70,06	95,73	85,51	107,84	85,89		
Artigo 7º IV	0,71	8,47	1,95	5,35	8,86	33.018,48	364.583,99
% do CDI	73,06	85,30	60,61	82,71	65,94		
Artigo 8º I	-0,25	0,99	-2,61	9,85	-1,28	-42.703,35	169.984,20
Var. IBOVESPA p.p.	-0,96	-5,23	-1,32	-4,56	-7,21		
Artigo 9º II	-1,85	10,20	-1,03	0,89	15,01	-126.536,36	541.914,12
% do CDI	-190,02	102,73	-32,08	13,83	111,63		
Artigo 9º III	-3,26	13,43	1,77	6,19	17,63	-56.424,10	267.843,86
% do CDI	-334,06	135,24	55,08	95,72	131,14		
Artigo 10º I	-4,40	17,53	-1,92	8,12	28,73	-510.371,25	1.652.199,15
% do CDI	-451,91	176,59	-59,66	125,53	213,72		
Artigo 10º II	2,98	0,17	2,85	2,02	4,68	126.135,71	148.961,19
% do CDI	305,77	1,71	88,57	31,25	34,80		
Artigo 11º	9,62	10,17	11,28	11,98	-27,58	5.655,85	5.947,96
% do CDI	987,17	102,43	350,46	185,21	-205,16		
<b>PIRACAIA (Total)</b>						<b>-128.721,79</b>	<b>10.902.477,32</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 150525 (6,290000%)	3.307.881,20	0,00	0,00	0,00	3.332.175,54	24.294,34	82.894,48
NTN-B 150535 (5,315000%)	22.116.856,30	0,00	0,00	0,00	22.263.061,45	146.205,15	1.659.898,00
NTN-B 150824 (7,620000%)	3.218.743,80	0,00	0,00	0,00	3.245.582,11	26.838,31	95.524,45
NTN-B 150826 (5,510000%)	25.285.047,44	0,00	0,00	0,00	25.455.925,40	170.877,96	1.956.144,37
					<b>54.296.744,50</b>	<b>368.215,76</b>	

8 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA III	844.382,05	0,00	0,00	0,00	853.625,14	9.243,09	71.267,68
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4.762,80	0,00	0,00	0,00	4.716,47	-46,33	237.998,25
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.633.244,20	0,00	0,00	0,00	1.651.179,01	17.934,81	137.929,75
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1.526.923,68	0,00	0,00	0,00	1.533.242,27	6.318,59	108.673,30
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	6.788.852,61	1.058.821,37	-795.000,00	0,00	7.028.944,52	-23.729,46	66.1283,89
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	12.962.793,93	0,00	0,00	0,00	12.982.736,35	19.942,42	132.947,03
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	480.439,66	0,00	0,00	0,00	475.414,07	-5.025,59	383.622,35
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	336.023,70	0,00	0,00	0,00	331.401,74	-4.621,96	540.072,22
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	5.671.802,93	0,00	0,00	0,00	5.653.537,75	-18.265,18	441.117,76
					30.514.797,32	1.750,39	

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	70.479,04	0,00	0,00	0,00	69.777,77	-701,27	6.748,56
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	2.304.451,97	0,00	-42.000,00	0,00	2.272.111,09	9.659,12	389.357,17
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	78.115,24	0,00	0,00	0,00	77.129,66	-985,58	246.349,57
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	8.168.760,41	0,00	0,00	0,00	8.233.325,22	64.564,81	599.214,02
					10.652.343,74	72.537,08	

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	4.636.777,00	0,00	0,00	0,00	4.669.795,48	33.018,48	364.583,99
					4.669.795,48	33.018,48	

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	235.539,77	0,00	0,00	0,00	228.786,41	-6.753,36	10.610,87
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6.779.267,69	0,00	0,00	0,00	6.765.518,95	-13.748,74	-295.678,41

9 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	204.275,67	0,00	0,00	0,00	206.151,12	1.875,45	12.511,44
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.177.933,92	0,00	0,00	0,00	1.171.725,52	-6.208,40	-18.829,27
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	895.932,52	0,00	0,00	0,00	898.917,11	2.984,59	50.597,24
VINCI MOSAICO FIA	908.159,44	0,00	0,00	0,00	907.888,81	-270,63	84.796,52
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	7.145.254,09	0,00	0,00	0,00	7.124.671,83	-20.582,26	325.975,81
					17.303.659,75	-42.703,35	

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	1.585.784,01	0,00	0,00	0,00	1.495.155,57	-90.628,44	285.199,83
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTEC ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.170.465,55	0,00	0,00	0,00	1.094.086,51	-76.379,04	138.450,90
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	890.242,27	0,00	0,00	0,00	870.592,87	-19.649,40	-165.118,17
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	886.130,90	0,00	0,00	0,00	852.712,00	-33.418,90	159.154,67
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	1.543.714,54	0,00	0,00	0,00	1.636.665,48	92.950,94	136.665,48
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	755.753,44	0,00	0,00	0,00	756.341,92	588,48	-12.438,59
					6.705.554,35	-126.536,36	

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	1.024.062,67	0,00	0,00	0,00	987.453,61	-36.609,06	175.348,74
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	708.833,56	0,00	0,00	0,00	689.018,52	-19.815,04	92.495,12
					1.676.472,13	-56.424,10	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

10 de 31





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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	11.586.894,65	0,00	0,00	0,00	11.076.523,40	-510.371,25	1.652.199,15
					11.076.523,40	-510.371,25	

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 MULTISTRATÉGIA II	3.663.055,33	42.000,00	0,00	0,00	3.831.191,04	126.135,71	148.961,19
					3.831.191,04	126.135,71	

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	58.781,86	0,00	0,00	0,00	0,00	64.437,71	5.655,85	5.947,96
						64.437,71	5.655,85	

11 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	58.762.837,22	41,74	58.762.837,22	41,74	
de 31 dias a 365 dias	27.146.328,77	19,28	85.909.165,99	61,02	
acima de 365 dias	54.882.353,43	38,98	140.791.519,42	100,00	

12 de 31



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

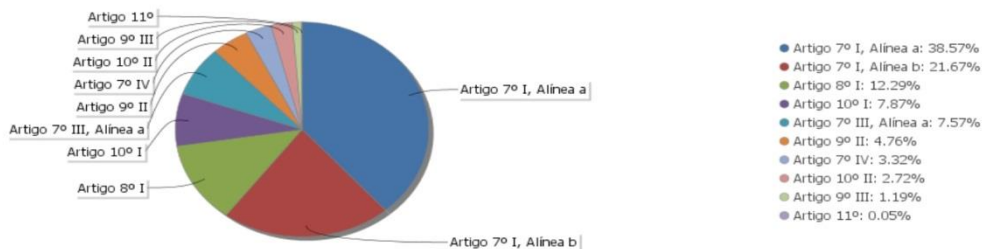


Carteira: PIRACAIA

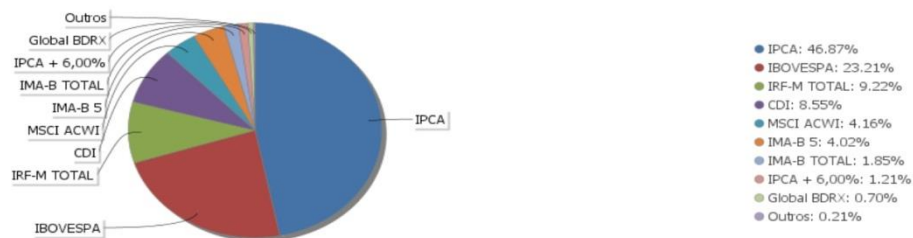
Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



13 de 31

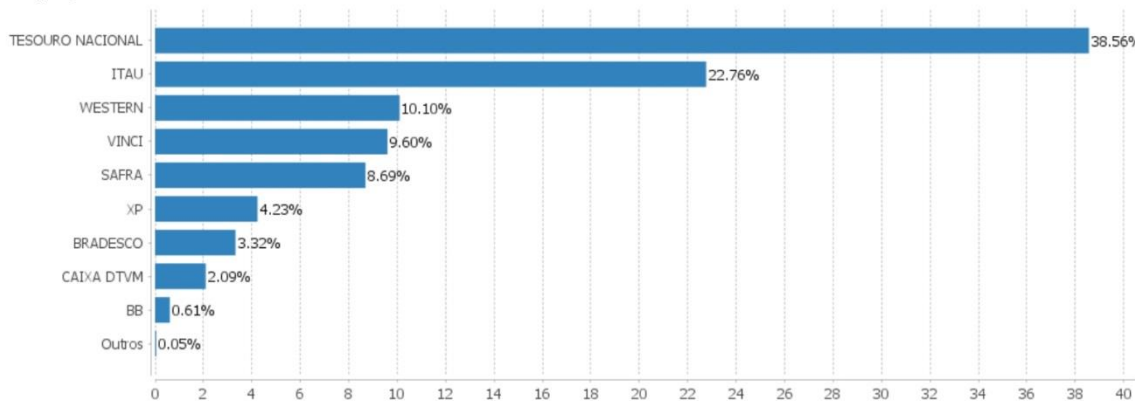


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



14 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

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	1,24	-0,30	-0,09				8,54
IPCA + 4,72%	0,94	1,17	1,13	0,94	0,63	0,30	0,51	0,65	0,63				7,12
p.p. indexador	0,91	-1,64	-0,03	0,03	1,04	1,98	0,74	-0,96	-0,72				1,42
2022	-0,70	-0,10	2,07	-1,43	1,00	-1,85	2,08	0,61	-0,86	2,30	-0,16	-0,25	2,85
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,93
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	0,68	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	29	50,88
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	49,12
	<b>Rentabilidade</b>	<b>Mês</b>
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	0,84	1,80	-0,95	3,68
	06 meses	5,90	3,72	2,17	4,01
	12 meses	10,58	10,15	0,43	4,36
	24 meses	14,34	23,97	-9,63	4,85
	36 meses	26,30	44,07	-17,77	4,80
	48 meses	35,57	56,76	-21,20	6,71
	Desde 31/12/2018	53,14	67,26	-14,12	6,39

15 de 31

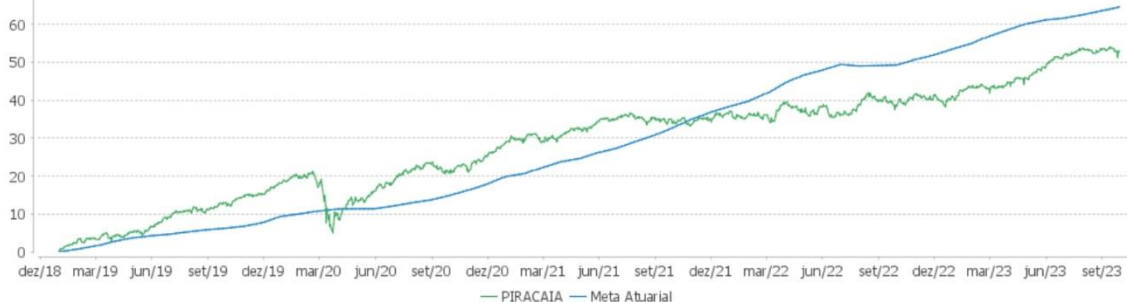


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



16 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



17 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Varição da Estratégia</b>							
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,47 5,27	1,95 1,34	5,35 3,97			
NTN-B 150525 (6,290000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	5,52 2,02	2,04 1,43	1,68 0,30	5,16 -0,02		
NTN-B 150826 (5,510000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,42	8,05 4,55	1,85 1,24	4,31 2,94	10,69 5,50	25,96 13,23	46,29 22,01
NTN-B 150535 (5,315000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	7,90 4,40	1,81 1,19	4,22 2,84	10,48 5,30	25,49 12,77	37,75 13,48
NTN-B 150824 (7,620000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,57	6,45 2,95	2,37 1,75	5,35 3,97	9,58 4,39		
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,32 -0,46	8,46 -0,43	1,03 -0,70	4,23 -0,08	9,76 -1,88	17,99 -3,98	21,44 -7,78
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,15 -0,02	11,39 -0,24	1,77 -0,06	7,31 -0,14	13,26 -0,32	21,98 -0,69	20,48 -0,94
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,38 -0,43	10,23 -0,55	-1,13 -0,60	6,46 -0,09	8,91 -2,13	14,71 -4,38	16,72 -7,98
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,10 2,04	8,81 -1,97	3,09 3,61	4,57 -1,97	11,76 0,72	21,08 1,99	26,98 2,28
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,05 -0,10	10,68 -0,11	-0,88 -0,36	6,36 -0,19	11,04 -0,01	16,63 -2,46	19,21 -5,50
BB PREV IPCA III Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,09 0,37	8,79 0,70	3,08 0,97	4,56 0,22	11,73 0,28	22,62 -3,98	31,02 -16,90
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,41 42,46	7,63 76,84	1,62 50,36	5,24 81,06	10,08 74,99	20,94 81,16	27,71 93,71
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,97 -0,03	10,54 -0,25	-0,60 -0,08	6,39 -0,16	10,71 -0,34	18,31 -0,78	23,45 -1,25
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,30 -0,56	11,35 7,85	0,97 0,36	6,94 5,56	10,76 5,57	22,65 9,93	25,99 1,71
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,26 -0,32	10,64 -0,15	-0,98 -0,46	6,42 -0,13	10,10 -0,94	16,54 -2,56	22,54 -2,16
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,00 -0,05	10,71 -0,08	-0,52 -0,00	6,60 0,05	10,65 -0,40	18,53 -0,56	23,83 -0,87
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,79	7,89	3,14	6,58	10,47	22,52	25,50

18 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	81,09	79,51	97,49	101,71	77,90	87,27	86,56
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	<b>0,42</b>	<b>9,32</b>	<b>2,07</b>	<b>5,81</b>	<b>12,21</b>	<b>24,91</b>	<b>30,57</b>
Var. do CDI	42,89	93,89	64,37	89,91	90,86	96,53	103,40
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-2,87	<b>4,86</b>	-7,24	<b>15,55</b>	-3,23	-21,52	-10,58
Var. SMALL CAP p.p.	-0,03	-0,19	0,01	-0,54	-0,29	-0,69	-2,22
VINCI MOSAICO FIA	-0,03	<b>10,30</b>	-0,93	<b>18,21</b>	<b>3,58</b>	-0,04	<b>11,21</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,74	4,08	0,36	3,80	-2,35	-5,07	-12,01
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-0,53	-1,58	-5,28	<b>9,42</b>	-11,12	-23,18	-12,82
Var. IBOVESPA p.p.	-1,24	-7,81	-3,99	-4,99	-17,05	-28,21	-36,04
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	-0,29	<b>4,79</b>	-2,40	<b>13,51</b>	-0,45	-1,62	<b>9,96</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,00	-1,43	-1,11	-0,90	-6,38	-6,65	-13,25
ITAÚ GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	<b>0,92</b>	<b>6,46</b>	-0,75	<b>15,06</b>	<b>5,74</b>	<b>3,04</b>	<b>21,49</b>
Var. IBOVESPA p.p.	0,21	0,24	0,54	0,64	-0,19	-1,99	-1,72
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	-0,20	-4,19	-2,66	<b>4,48</b>	-1,31	-7,29	<b>10,57</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	-10,41	-1,37	-9,93	-7,25	-12,32	-12,64
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	<b>0,33</b>	<b>5,96</b>	-1,08	<b>14,59</b>	<b>1,09</b>	-4,04	<b>13,00</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,38	-0,26	0,21	0,18	-4,84	-9,07	-10,21
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-3,57	<b>16,05</b>	<b>1,32</b>	<b>7,00</b>	<b>20,13</b>	-7,28	<b>9,65</b>
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-1,18	-0,49	-0,82	-1,72	-1,99	-4,99
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-2,80	<b>10,06</b>	<b>2,42</b>	<b>4,91</b>	<b>14,38</b>	-13,81	<b>3,96</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-3,51	3,84	3,71	-9,50	8,45	-18,84	-19,25
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	<b>0,08</b>	-1,62	<b>3,56</b>	-0,08	<b>0,68</b>	-8,68	-3,56
Var. MSCI ACWI p.p.	2,69	-5,75	3,61	-0,18	-9,26	6,09	-6,74
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-2,21	-15,94	-1,77	-14,47	-12,32	-36,21	
Var. MSCI ACWI p.p.	0,40	-20,07	-1,72	-14,57	-22,25	-21,44	
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	<b>6,02</b>	-2,54	<b>3,12</b>	<b>10,55</b>	-6,82	<b>32,11</b>	
Var. MSCI ACWI p.p.	8,63	-6,66	3,17	10,45	-16,75	46,88	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-5,72	<b>23,57</b>	-0,38	<b>8,15</b>	<b>26,65</b>	-18,22	<b>2,39</b>
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,11	19,44	-0,33	8,05	16,72	-3,44	-0,78
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-3,77	<b>22,95</b>	<b>1,01</b>	<b>6,67</b>	<b>25,17</b>	-31,61	-25,87
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-4,50	14,85	-1,11	2,32	13,72	-58,21	-73,78
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-6,53	<b>14,49</b>	-10,81	-3,78	<b>26,82</b>	-10,80	<b>11,35</b>
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,92	10,36	-10,76	-3,88	16,89	3,98	8,17
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-4,40	<b>17,53</b>	-1,92	<b>8,12</b>	<b>28,73</b>	<b>16,77</b>	<b>52,30</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-5,12	11,31	-0,63	-6,29	22,80	11,74	29,09
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTISTRATÉGIA II	<b>2,98</b>	<b>5,87</b>	<b>2,85</b>	<b>0,93</b>	<b>10,63</b>	<b>32,11</b>	<b>93,92</b>

19 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,27	-0,35	4,14	-13,49	4,70	27,07	70,71
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	<b>9,62</b>	<b>10,17</b>	<b>11,28</b>	<b>11,98</b>	-27,58	-28,21	-34,55
Var. IFIX p.p.	9,42	-2,11	9,26	-4,62	-35,22	-46,76	-49,74
PIRACAIA	-0,09	<b>8,54</b>	<b>0,84</b>	<b>5,90</b>	<b>10,58</b>	<b>14,34</b>	<b>26,30</b>
Var. IPCA + 4,88% p.p.	-0,72	1,42	-0,95	2,17	0,47	-9,23	-16,33
CDI	<b>0,97</b>	<b>9,93</b>	<b>3,22</b>	<b>6,47</b>	<b>13,44</b>	<b>25,80</b>	<b>29,57</b>
IBOVESPA	<b>0,71</b>	<b>6,22</b>	-1,29	<b>14,41</b>	<b>5,93</b>	<b>5,03</b>	<b>23,21</b>
INPC + 6,00%	<b>0,57</b>	<b>7,49</b>	<b>1,71</b>	<b>3,97</b>	<b>10,73</b>	<b>25,81</b>	<b>47,70</b>
IPCA + 6,00%	<b>0,72</b>	<b>8,10</b>	<b>2,11</b>	<b>4,35</b>	<b>11,44</b>	<b>26,60</b>	<b>47,91</b>

20 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BB PREV IPCA III	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS 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	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	0,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100%	0,50

21 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	DA VARIÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO 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 VARIÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	0,50
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
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				

22 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+2 du		1,00
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 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 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

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	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	12,82	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	15,28	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-4,75	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

24 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Investimentos Estruturados**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-3,22	7,19	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	2,91	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-4,93	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	6,57	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	7,34	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	7,72	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	8,01	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	5,97	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

25 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

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%)	3.332.175,54	6,290000	3.358.445,53	5,740000	26.269,99
NTN-B 150535 (5,315000%)	22.263.061,45	5,315000	21.611.772,20	5,686500	-651.289,25
NTN-B 150824 (7,620000%)	3.245.582,11	7,620000	3.278.647,13	6,346000	33.065,02
NTN-B 150826 (5,510000%)	25.455.925,40	5,510000	25.400.219,18	5,596700	-55.706,22

26 de 31





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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
532	01/09/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	705.000,00	31.079,90639526	22,6834660000
536	01/09/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	90.000,00	3.967,64762493	22,6834660000
533	11/09/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	418.326,01	0,00	18.413,85648324	22,7180010000
538	12/09/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	294.302,53	0,00	12.930,01337847	22,7611930000
534	13/09/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	282.839,08	0,00	12.413,81828725	22,7842130000
537	22/09/2023	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINAMICO RF LP FIC FI	0,00	42.000,00	3.068,64537792	13,6868210000
540	26/09/2023	VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	42.000,00	0,00	42,00000000	1.000,0000000000
535	29/09/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	47.842,79	0,00	2.114,76641924	22,6232030000
539	29/09/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	15.510,96	0,00	685,62174861	22,6232030000
<b>Total</b>			<b>1.100.821,37</b>	<b>837.000,00</b>		

27 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 1.813.486,41 Value-At-Risk: 1,29%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIRACAIA		1,29		1,29			140.791.519,42	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,36%

Artigo 7º I, Alinea 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 150525 (6,290000%)		0,20	-0,00	0,21			3.332.175,54	2,37
NTN-B 150535 (5,315000%)		0,07	0,00	0,07			22.263.061,45	15,81
NTN-B 150824 (7,620000%)		0,07	0,00	0,07			3.245.582,11	2,31
NTN-B 150826 (5,510000%)		0,07	0,00	0,07			25.455.925,40	18,08
<b>Sub-total</b>	0,13	0,06	0,00		-2,19	0,68	54.296.744,50	38,57

Artigo 7º I, Alinea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI		0,96	0,05	0,00			12.982.736,35	9,22
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		1,89	0,00	0,12			475.414,07	0,34
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		1,85	0,00	0,00			4.716,47	0,00
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF		2,44	0,00	0,69			331.401,74	0,24
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,31	0,02	0,60			5.653.537,75	4,02
BB PREV IPCA III		0,47	0,00	0,48			853.625,14	0,61
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,48	0,00	1,79			1.651.179,01	1,17
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,29	0,04	1,30			7.028.944,52	4,99
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,94	0,00	0,94			1.533.242,27	1,09
<b>Sub-total</b>	2,51	1,01	0,12		-0,38	0,02	30.514.797,32	21,67

Artigo 7º III, Alinea a

28 de 31



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



Carteira: PIRACAIA		EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS							Data Extrato: 29/09/2023	
<b>Artigo 7º IV</b>										
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		2,08	0,00	0,28			77.129,66	0,05		
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,83	0,00	0,06			69.777,77	0,05		
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,49	0,01	0,49			8.233.325,22	5,85		
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,56	0,00	0,56			2.272.111,09	1,61		
<b>Sub-total</b>	<b>1,09</b>	<b>0,50</b>	<b>0,02</b>		<b>-0,27</b>	<b>0,68</b>	<b>10.652.343,74</b>	<b>7,57</b>		
<b>Artigo 7º V</b>										
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		0,12	0,00	0,13			4.669.795,48	3,32		
<b>Sub-total</b>	<b>0,24</b>	<b>0,12</b>	<b>0,00</b>		<b>-1,09</b>	<b>0,71</b>	<b>4.669.795,48</b>	<b>3,32</b>		
<b>Renda Variável</b> Value-At-Risk: 6,82%										
<b>Artigo 8º I</b>										
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		7,34	0,01	0,46			206.151,12	0,15		
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,75	0,01	0,43			228.786,41	0,16		
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		7,16	0,31	1,47			7.124.671,83	5,06		
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,46	0,26	2,87			6.765.518,95	4,81		
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		8,35	0,06	3,52			1.171.725,52	0,83		
VINCI MOSAICO FIA		7,91	0,04	2,36			907.888,81	0,64		
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		7,47	0,04	1,24			898.917,11	0,64		
<b>Sub-total</b>	<b>14,15</b>	<b>6,82</b>	<b>0,74</b>		<b>-0,09</b>	<b>-0,25</b>	<b>17.303.659,75</b>	<b>12,29</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b> Value-At-Risk: 3,81%										
<b>Artigo 10º I</b>										
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		5,12	0,30	6,87			11.076.523,40	7,87		
<b>Sub-total</b>	<b>10,55</b>	<b>5,12</b>	<b>0,30</b>		<b>-0,51</b>	<b>-4,40</b>	<b>11.076.523,40</b>	<b>7,87</b>		

29 de 31



Carteira: PIRACAIA		EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS							Data Extrato: 29/09/2023	
<b>Artigo 10º II</b>										
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		0,10	0,00	7,38			3.831.191,04	2,72		
<b>Sub-total</b>	<b>159,95</b>	<b>0,10</b>	<b>0,00</b>		<b>0,01</b>	<b>2,98</b>	<b>3.831.191,04</b>	<b>2,72</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b> Value-At-Risk: 4,63%										
<b>Artigo 9º II</b>										
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		5,26	-0,01	5,31			756.341,92	0,54		
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR		6,75	-0,01	8,14			1.636.665,48	1,16		
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		7,78	0,05	6,63			1.495.155,57	1,06		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,10	0,05	7,87			1.094.086,51	0,78		
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		7,64	-0,00	7,38			870.592,87	0,62		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,21	0,00	9,21			852.712,00	0,61		
<b>Sub-total</b>	<b>6,92</b>	<b>4,46</b>	<b>0,09</b>		<b>-0,41</b>	<b>-1,85</b>	<b>6.705.554,35</b>	<b>4,76</b>		
<b>Artigo 9º III</b>										
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		6,88	0,01	0,68			987.453,61	0,70		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		6,57	0,01	10,38			689.018,52	0,49		
<b>Sub-total</b>	<b>10,32</b>	<b>6,60</b>	<b>0,02</b>		<b>-0,41</b>	<b>-3,26</b>	<b>1.676.472,13</b>	<b>1,19</b>		
<b>Fundos Imobiliários</b> Value-At-Risk: 0,49%										
<b>Artigo 11º</b>										
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira		

30 de 31



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



Carteira: PIRACAIA		Data Extrato: 29/09/2023						
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
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII		0,49	0,00	1,98			64.437,71	0,05
<b>Sub-total</b>	32,61	0,49	0,00		0,27	9,62	64.437,71	0,05

31 de 31

O Sr. Robson informou que na reunião ocorrida dia 11/10/2023 que o Comitê de Investimentos recomendou que os novos recursos devessem ser aplicados no fundo de investimento SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR - 39.723.347/0001-06, isto, considerando a volatilidade de mercado trazido pelas decisões de tomadas de juros globais e pela composição da carteira deste fundo, que no último trimestre tem apostado em ativos do governo americano, aproveitando-se assim das subidas de taxas de juros, sendo assim foram referendadas as recomendações do Comitê de Investimentos. **Item APROVADO.** A seguir a Sra.Claudia informou que esteve novamente com o Sr.Prefeito para tratar das **contribuições atrasadas**, quando ele manteve o posicionamento de não realizar o parcelamento que lhe é permitido por lei, pois pretende quitar os débitos nos próximos meses. Informou também que **ainda não recebeu o relatório final da Auditoria do TCESP** referente ao exercício 2022. Informou também que em breve **receberemos o Auditor da Totum de forma presencial** para a verificação dos itens necessários para a certificação no nível II do Pró-Gestão. Por fim, informou que o Piraprev está totalmente **em dia com o E-Social**. Sendo o que havia a apresentar a reunião foi encerrada.

Piracaia, 17 de outubro de 2023.



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

---

Cátia Grasseti do Nascimento Maioli

Robson Adão Martins Ribeiro  
Auxiliar Financeiro

Denise Fátima do Carmo

Claudia Leoncio da Silva  
Superintendente

Lívia Silva Pereira

Renata Suyama

Tatiana Guimarães Moreira de Almeida  
Presidente  
Tatiane Góes Almeida