



## Reunião Ordinária do Conselho Administrativo

Aos 19 (dezenove) dias do mês de setembro 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, Eliana Fátima de Paula Gomes da Silva, Lívia Silva Pereira, Renata Suyama e Tatiana Guimarães Moreira de Almeida. Presente também, Robson Adão Martins Ribeiro, Auxiliar Financeiro. Com quórum suficiente a reunião foi iniciada às 8:43 horas, assim o Sr. Robson abre a reunião cumprimentando e agradecendo a presença de todos e apresentando o cenário de agosto:

### Internacional

**EUA** – Indicadores recentes levam a **revisões de crescimento para cima**, 2,0% em 2023 e 1,0% em 2024. **Os dados mostram uma economia sólida, avançando além do esperado**, inclusive com chance de aceleração na taxa de crescimento do terceiro trimestre. Isso sugere que a alta das taxas de juros até agora vem tendo efeito menos restritivo que o previsto. O mercado de trabalho segue aquecido, ainda que em trajetória de desaceleração. Esse ambiente aponta para uma chance menor de recessão nos EUA. Ciclo de alta dos juros americanos **foi provavelmente encerrado**, apesar da chance de um ajuste residual.

**China** – Revisão do crescimento para baixo, para a faixa de 5,0% em 2023 e 4,5% em 2024. **Os números divulgados nos últimos meses desapontaram, mostrando que o** efeito da reabertura pós-Covid-19 foi mais curto e menos intenso do que o previsto, enquanto o setor imobiliário segue fragilizado, afetando negativamente o crescimento. Nesse ambiente, a China deverá continuar crescendo abaixo do potencial, a despeito das medidas de estímulo que vêm sendo anunciadas.

Para a **Zona do Euro**, as expectativas se mantiveram ao redor de 0,5% e 1,0 para 2023 e 2024, respectivamente.

### Brasil

**Crescimento do PIB volta a surpreender positivamente no segundo trimestre.** A expansão de 0,9% superou as previsões, com contribuição positiva dos setores industrial (+0,9%) e de serviços (0,6%),



reforçando a percepção de uma economia resiliente. Para os próximos trimestres, **esperamos que a economia mostre desaceleração**, com crescimento mais baixo do que o observado no primeiro semestre, refletindo os efeitos da política monetária mais restritiva. Essa dinâmica deverá levar a um crescimento mais próximo de 3,0% neste ano.

**Não houve alteração nas expectativas para a política monetária.** Considerando os indicadores recentes, a sinalização dada pelo Copom após a reunião de agosto parece seguir válida, ou seja, o Copom deve voltar a reduzir os juros em 0,5% na sua reunião de setembro, para 12,75%. Para o final de 2023 e 2024, projeções seguem em 11,75% e 9,5% respectivamente.

O **Ibovespa** teve retornos negativos com queda mais acentuada que a das bolsas globais, sendo as maiores quedas do segmento de bancos e serviços financeiros com a expectativa dos impactos da reforma fiscal.

## Focus | MEDIANAS DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO

8 de setembro de 2023

	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 (%)	4,84	4,92	4,93	▲ (2)	3,86	3,88	3,89	▲ (3)	3,50	= (7)	3,50	= (10)
PIB (var. %)	2,29	2,56	2,64	▲ (3)	1,30	1,32	1,47	▲ (1)	2,00	▲ (1)	2,00	= (5)
CÂMBIO (R\$/US\$)	4,93	4,98	5,00	▲ (1)	5,00	5,00	5,02	▲ (1)	5,10	= (2)	5,15	▼ (1)
SELIC (% a.a.)	11,75	11,75	11,75	= (5)	9,00	9,00	9,00	= (5)	8,50	= (5)	8,50	= (6)

\* 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



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



#### BOLSA DE VALORES

	Valor	mês %	12m %	ano
Ibovespa	115.742	-5,09%	5,68%	5,47%
S&P500	4.508	-1,77%	13,97%	17,40%
DAX	15.947	-3,04%	24,25%	14,53%
FTSE	7.439	-3,38%	2,13%	-0,17%
Nikkei	32.619	-1,67%	16,12%	25,00%



#### OUTROS VALORES

##### Moedas

Dólar à vista B3	4,95	4,49%	-4,95%	-6,38%
BRL/USD	4,96	4,85%	-4,42%	-6,16%
BRL/EUR	5,37	3,34%	3,08%	-5,06%
USD/EUR	1,08	-1,40%	7,85%	1,29%
YEN/USD	145,54	2,28%	4,74%	11,00%
DXY	47,97	-1,89%	-4,16%	-3,86%

##### Juros brasileiros

Futuro de DI Jan/24	12,39	-0,19	-0,59	-1,02
Futuro de DI Jan/25	10,53	-0,08	-1,44	-2,13
Futuro de DI Jan/29	10,83	0,30	-1,07	-1,84

##### Índices de Renda Fixa

IMA-B	9.547,62	-0,38%	13,76%	11,84%
IMA-B5	8.706,20	0,61%	11,97%	8,75%
IRF-M	17.161,42	0,76%	14,96%	11,43%
IRFM-1	14.641,91	1,15%	13,74%	9,05%
CDI		1,14%	13,55%	8,87%



#### COMMODITIES

Petróleo	83,63	2,24%	-6,61%	4,20%
Ouro	1.942,30	-1,44%	13,19%	7,09%

Fonte: Bloomberg Elaboração: SAM | Agosto 2023

#### Referência

- Santander Asset Management

A seguir, apresentou a Abertura da Carteira de Investimentos, no site da LDB, onde se verificou que o mês de agosto foi encerrado com rentabilidade negativa de -0,30%, abaixo da meta atuarial em 0,96% com um Patrimônio Líquido total de R\$ **140.656.419,84** (cento e quarenta milhões, seiscentos e cinquenta e seis mil, quatrocentos e dezenove reais e oitenta e quatro centavos). Apresentou também a rentabilidade por Artigo e Análise de liquidez, sendo 42,08% 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, 7,33% na Renda Variável, 4,84% em Investimentos Estruturados, 4,12% em Investimentos no Exterior e 0,10% 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 agosto. **Item APROVADO.**





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

Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.08.2023.

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: 31/08/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 70,69%

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	0,04	0,78	1,80	3.307.881,20	2,35	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,315000%)	0,41	0,03	0,70	7,19	22.116.856,30	15,72	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,620000%)	3,00	0,05	0,90	2,13	3.218.743,80	2,29	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,510000%)	0,41	0,03	0,72	7,33	25.285.047,44	17,98	
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>			<b>0,41</b>	<b>0,03</b>	<b>0,72</b>	<b>7,31</b>	<b>53.928.528,74</b>	<b>38,34</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	3,29	-0,23	0,74	0,93	12.962.793,93	9,22	137.539.732,69	9,42
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,72	-0,65	-0,52	11,85	480.439,66	0,34	418.018.599,03	0,11
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,92	-0,64	-0,40	11,62	4.762,80	0,00	561.329.311,89	0,00
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5,97	-0,74	-0,48	11,77	336.023,70	0,24	176.629.282,64	0,19
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,33	-0,37	0,47	8,81	5.671.802,93	4,03	460.238.353,70	1,23
BB	BB	BB PREV IPCA III	2,04	-0,01	0,90	7,62	844.382,05	0,60	186.423.704,08	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,05	-0,01	0,90	7,63	1.633.244,20	1,16	3.750.386.694,20	0,04
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,93	-0,36	0,37	11,68	6.788.852,61	4,83	2.203.872.085,49	0,31
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,87	-0,43	0,35	7,18	1.526.923,68	1,09	683.129.636,69	0,22
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,81</b>	<b>-0,29</b>	<b>0,56</b>	<b>10,87</b>	<b>30.249.225,56</b>	<b>21,51</b>		

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

1 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

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	5,39	-0,68	-0,47	12,05	78.115,24	0,06	467.885.245,04	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,06	-0,63	-0,34	11,82	70.479,04	0,05	1.389.232.597,65	0,01
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,38	-0,05	1,20	7,05	8.168.760,41	5,81	363.455.477,79	2,25
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,84	-0,15	0,65	8,87	2.304.451,97	1,64	2.919.877.676,62	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alinea a</b>			<b>1,68</b>	<b>-0,08</b>	<b>1,06</b>	<b>8,76</b>	<b>10.621.806,66</b>	<b>7,55</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRADESCO	BRADESCO	LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a	0,85	-0,13	0,66	7,70	4.636.777,00	3,30		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>0,85</b>	<b>-0,13</b>	<b>0,66</b>	<b>7,70</b>	<b>4.636.777,00</b>	<b>3,30</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,38</b>	<b>-0,08</b>	<b>0,70</b>	<b>8,46</b>	<b>99.436.337,96</b>	<b>70,69</b>		

2 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

12,33%

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	20,75	-1,57	-4,93	5,49	204.275,67	0,15	32.968.039,53	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,28	-2,49	-7,25	7,96	235.539,77	0,17	684.787.474,06	0,03
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	20,11	-1,56	-5,22	5,10	7.145.254,09	5,08	538.649.866,95	1,33
ITAU	ITAU	ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	19,06	-0,77	-4,95	-3,99	6.779.267,69	4,82	1.414.031.639,81	0,48
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,47	-2,09	-8,94	-1,06	1.177.933,92	0,84	262.165.274,91	0,45
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	22,64	-1,69	-4,62	10,34	908.159,44	0,65	679.403.683,67	0,13
VINCI	BEM	VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	21,32	-1,64	-4,93	5,61	895.932,52	0,64	149.263.798,37	0,60
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,53</b>	<b>-1,32</b>	<b>-5,36</b>	<b>1,24</b>	<b>17.346.363,10</b>	<b>12,33</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>19,53</b>	<b>-1,32</b>	<b>-5,36</b>	<b>1,24</b>	<b>17.346.363,10</b>	<b>12,33</b>		

3 de 31



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 6,09%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VINCI	BTG PACTUAL	VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,74	1,69	4,54	-1,69	755.753,44	0,54	107.300.327,71	0,70
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	14,12	-0,43	-1,02	3,24	1.543.714,54	1,10	194.005.202,46	0,80
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	24,23	0,85	-0,43	31,06	1.585.784,01	1,13	235.828.232,83	0,67
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	23,95	-0,16	-6,06	22,48	1.170.465,55	0,83	66.687.535,28	1,76
XP	BNP PARIBAS	J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,20	1,38	-1,98	-14,05	890.242,27	0,63	65.719.736,87	1,35
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,05	2,56	1,35	27,77	886.130,90	0,63	665.927.943,70	0,13
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>15,69</b>	<b>0,76</b>	<b>-1,04</b>	<b>12,28</b>	<b>6.832.090,71</b>	<b>4,86</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,55	1,65	2,90	20,35	1.024.062,67	0,73	2.114.296.555,90	0,05
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	20,95	1,49	3,77	13,23	708.833,56	0,50	732.547.750,88	0,10
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>21,53</b>	<b>1,69</b>	<b>3,25</b>	<b>17,24</b>	<b>1.732.896,23</b>	<b>1,23</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>17,05</b>	<b>0,92</b>	<b>-0,20</b>	<b>13,14</b>	<b>8.564.986,94</b>	<b>6,09</b>		

4 de 31



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 10,84%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18,07	-0,09	-0,96	22,95	11.586.894,65	8,24	583.410.718,64	1,99
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>18,07</b>	<b>-0,09</b>	<b>-0,96</b>	<b>22,95</b>	<b>11.586.894,65</b>	<b>8,24</b>		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VINCI	BEM	VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	101,97	-0,09	-0,09	-2,73	3.663.055,33	2,60	310.744.480,29	1,18
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>101,97</b>	<b>-0,09</b>	<b>-0,09</b>	<b>-2,73</b>	<b>3.663.055,33</b>	<b>2,60</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>28,48</b>	<b>-0,09</b>	<b>-0,75</b>	<b>16,72</b>	<b>15.249.949,98</b>	<b>10,84</b>		

5 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,04%

Artigo 11\* (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
KINEA	KINEA	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	34,55	1,28	1,28	0,50	58.781,86	0,04	14.209.667,58	0,41
<b>Sub-total Artigo 11*</b>			<b>34,55</b>	<b>1,28</b>	<b>1,28</b>	<b>0,50</b>	<b>58.781,86</b>	<b>0,04</b>		
Fundos Imobiliários			34,55	1,28	1,28	0,50	58.781,86	0,04		
<b>Total</b>			<b>4,49</b>	<b>-0,18</b>	<b>-0,30</b>	<b>8,64</b>	<b>140.656.419,84</b>	<b>100,00</b>		

6 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Pró-Gestão Nível 1 Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alinea a	Títulos do Tesouro Nacional	53.928.528,74	38,34	0,00	36,34	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alinea b	Fundos 100% Títulos Públicos	30.249.225,56	21,51	0,00	20,55	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alinea a	Fundos Renda Fixa	10.621.806,66	7,55	0,00	8,91	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	4.636.777,00	3,30	0,00	3,53	20,00	0,00	20,00
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>99.436.337,96</b>	<b>70,69</b>					<b>100,00</b>
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.346.363,10	12,33	0,00	14,97	35,00	0,00	35,00
<b>Total Renda Variável</b>		<b>17.346.363,10</b>	<b>12,33</b>					<b>35,00</b>
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	6.832.090,71	4,86	0,00	3,56	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.732.896,23	1,23	0,00	2,27	10,00	0,00	10,00
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>8.564.986,94</b>	<b>6,09</b>					<b>10,00</b>
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	11.586.894,65	8,24	0,00	7,40	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	3.663.055,33	2,60	0,00	2,41	5,00	0,00	5,00
<b>Total Investimentos Estruturados</b>		<b>15.249.949,98</b>	<b>10,84</b>					<b>15,00</b>
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	58.781,86	0,04	0,00	0,07	5,00	0,00	5,00
<b>Total Fundos Imobiliários</b>		<b>58.781,86</b>	<b>0,04</b>					<b>5,00</b>
<b>Total</b>		<b>140.656.419,84</b>	<b>100,00</b>					

7 de 31





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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,72 63,52	7,31 82,49	1,63 49,25	5,12 76,63	10,01 73,85	390.084,33	3.426.245,54
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,56 49,24	10,87 122,65	3,29 99,17	8,94 133,93	12,51 92,31	158.687,62	2.713.161,84
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,06 92,89	8,76 98,81	3,74 112,71	7,55 113,08	12,21 90,12	111.232,72	1.169.132,24
Artigo 7º IV % do CDI	0,66 57,97	7,70 86,86	2,15 64,73	6,15 92,03	8,23 60,71	30.421,82	331.565,51
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-5,36 -0,27	1,24 -4,23	4,81 -2,03	6,06 -4,24	-1,87 -7,55	-981.549,21	212.687,55
Artigo 9º II % do CDI	-1,04 -91,11	12,28 138,48	3,22 97,01	4,99 74,68	8,31 61,33	-71.683,03	688.450,48
Artigo 9º III % do CDI	3,25 285,66	17,24 194,48	5,46 164,63	12,70 190,21	12,68 93,56	54.618,27	324.267,96
Artigo 10º I % do CDI	-0,96 -84,46	22,95 258,80	9,70 292,18	17,61 263,68	23,14 170,72	-112.576,97	2.162.570,40
Artigo 10º II % do CDI	-0,09 -7,54	-2,73 -30,78	-0,02 -0,64	-2,66 -39,83	-1,26 -9,30	-3.151,05	22.825,48
Artigo 11º % do CDI	1,28 112,68	0,50 5,63	1,55 46,81	0,00 0,05	-33,64 -248,20	745,01	292,11
<b>PIRACAIA (Total)</b>						<b>-423.150,49</b>	<b>11.031.199,11</b>

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150525 (6,290000%)	3.282.187,89	0,00	0,00	0,00	3.307.881,20	25.693,31	58.600,14
NTN-B 150535 (5,315000%)	21.963.435,08	0,00	0,00	0,00	22.116.856,30	153.421,22	1.513.692,85
NTN-B 150824 (7,620000%)	3.285.818,59	0,00	0,00	96.082,60	3.218.743,80	29.007,81	68.686,14
NTN-B 150826 (5,510000%)	25.838.050,18	0,00	0,00	734.964,73	25.285.047,44	181.961,99	1.785.266,41
					53.928.528,74	390.084,33	

8 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

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	861.586,29	0,00	-24.884,04	0,00	844.382,05	7.679,80	62.024,59
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4.782,16	0,00	0,00	0,00	4.762,80	-19,36	238.044,58
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.661.562,52	0,00	0,00	43.215,23	1.633.244,20	14.896,91	119.994,94
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1.521.644,15	0,00	0,00	0,00	1.526.923,68	5.279,53	102.354,71
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	6.121.598,09	1.413.270,35	-762.000,00	0,00	6.788.852,61	15.984,17	685.013,35
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	12.424.988,49	445.245,39	0,00	0,00	12.962.793,93	92.560,05	113.004,61
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	482.935,86	0,00	0,00	0,00	480.439,66	-2.496,20	388.647,94
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	337.659,22	0,00	0,00	0,00	336.023,70	-1.635,52	544.694,18
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	5.645.364,69	0,00	0,00	0,00	5.671.802,93	26.438,24	459.382,94
					30.249.225,56	158.687,62	

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	70.722,98	0,00	0,00	0,00	70.479,04	-243,94	7.449,83
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	2.289.467,90	0,00	0,00	0,00	2.304.451,97	14.984,07	379.698,05
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	78.486,93	0,00	0,00	0,00	78.115,24	-371,69	247.335,15
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	8.071.896,13	0,00	0,00	0,00	8.168.760,41	96.864,28	534.649,21
					10.621.806,66	111.232,72	

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 BRANCO SA 6,80% a.a	4.606.355,18	0,00	0,00	0,00	4.636.777,00	30.421,82	331.565,51
					4.636.777,00	30.421,82	

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	253.957,11	0,00	0,00	0,00	235.539,77	-18.417,34	17.364,23
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	7.132.108,27	0,00	0,00	0,00	6.779.267,69	-352.840,58	-281.929,67

9 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	214.872,25	0,00	0,00	0,00	204.275,67	-10.596,58	10.635,99
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.293.529,70	0,00	0,00	0,00	1.177.933,92	-115.595,78	-12.620,87
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	942.385,80	0,00	0,00	0,00	895.932,52	-46.453,28	47.612,65
VINCI MOSAICO FIA	952.127,13	0,00	0,00	0,00	908.159,44	-43.967,69	85.067,15
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	7.538.932,05	0,00	0,00	0,00	7.145.254,09	-393.677,96	346.558,07
					17.346.363,10	-981.549,21	

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	1.592.711,04	0,00	0,00	0,00	1.585.784,01	-6.927,03	375.828,27
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.245.931,75	0,00	0,00	0,00	1.170.465,55	-75.466,20	214.829,94
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	908.221,12	0,00	0,00	0,00	890.242,27	-17.978,85	-145.468,77
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	874.363,38	0,00	0,00	0,00	886.130,90	11.767,52	192.573,57
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	1.559.590,91	0,00	0,00	0,00	1.543.714,54	-15.876,37	43.714,54
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	722.935,54	0,00	0,00	0,00	755.753,44	32.817,90	-13.027,07
					6.832.090,71	-71.663,03	

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	995.165,94	0,00	0,00	0,00	1.024.062,67	28.896,73	211.957,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	683.112,02	0,00	0,00	0,00	708.833,56	25.721,54	112.310,16
					1.732.896,23	54.618,27	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

10 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

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	11.699.471,62	0,00	0,00	0,00	11.586.894,65	-112.576,97	2.162.570,40
					11.586.894,65	-112.576,97	

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	3.666.206,38	0,00	0,00	0,00	3.663.055,33	-3.151,05	22.825,48
					3.663.055,33	-3.151,05	

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	58.036,85	0,00	0,00	0,00	0,00	58.781,86	745,01	292,11
						58.781,86	745,01	

11 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Liquidez**

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	59.184.063,94	42,08	59.184.063,94	42,08	
de 31 dias a 365 dias	27.099.515,63	19,27	86.283.579,57	61,34	
acima de 365 dias	54.372.840,27	38,66	140.656.419,84	100,00	

12 de 31

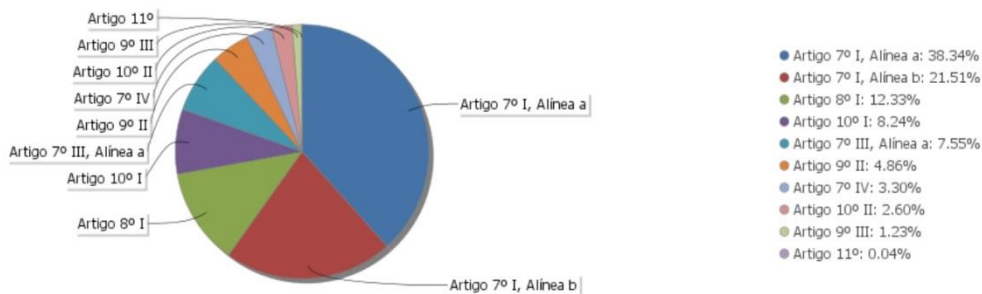


Carteira: PIRACAIA

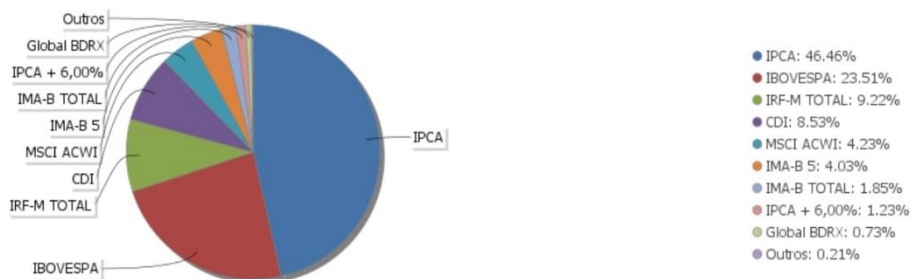
Data Extrato: 31/08/2023

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Artigo**



**Alocação Por Estratégia**



13 de 31



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

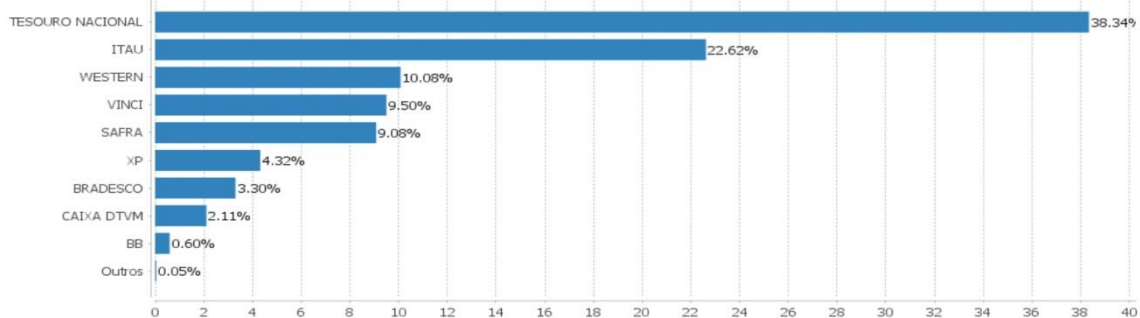


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



14 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

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					8,64
IPCA + 4,72%	0,94	1,17	1,13	0,94	0,63	0,30	0,51	0,65					6,45
p.p. indexador	0,91	-1,64	-0,03	0,03	1,04	1,98	0,74	-0,96					2,18
2022	-0,70	-0,10	2,07	-1,43	1,00	-1,65	2,08	0,61	-0,86	2,30	-0,16	-0,25	2,85
IPCA + 4,88%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,93
p.p. indexador	-1,64	-1,47	0,03	-2,85	0,11	-2,72	2,36	0,54	-0,97	1,33	-0,95	-1,29	-8,07
2021	-0,04	-0,18	1,36	1,36	1,48	0,55	0,03	-0,07	-0,79	-0,37	0,92	1,87	6,25
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-0,71	-1,42	-0,05	0,63	0,20	-0,42	-1,40	-1,40	-2,40	-2,05	-0,45	0,65	-9,75
2020	0,99	-1,89	-6,31	3,61	1,93	2,26	2,71	1,12	-1,49	-0,17	3,35	3,20	9,21
IPCA + 5,50%	0,68	0,63	0,54	0,11	0,04	0,71	0,85	0,69	1,09	1,31	1,32	1,82	10,24
p.p. indexador	0,31	-2,53	-6,85	3,50	1,89	1,55	1,85	0,44	-2,58	-1,48	2,03	1,37	-1,03
2019	3,15	0,30	0,52	1,27	1,20	2,42	1,40	0,52	1,52	1,46	0,53	2,59	18,22
IPCA + 5,50%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	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	51,79
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	48,21
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	3,25	1,47	1,78	2,73
06 meses	7,17	4,25	2,92	3,91
12 meses	9,73	9,58	0,15	4,49
24 meses	13,53	25,17	-11,64	4,85
36 meses	24,53	44,74	-20,20	4,84
48 meses	37,76	56,42	-18,66	6,68
Desde 31/12/2018	53,28	66,21	-12,93	6,40

15 de 31



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

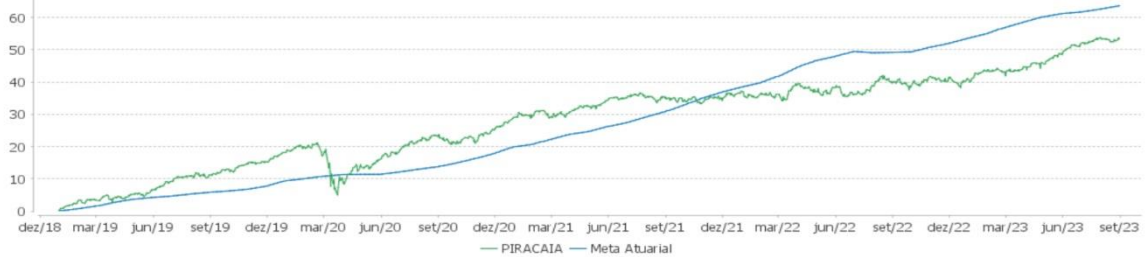


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



16 de 31

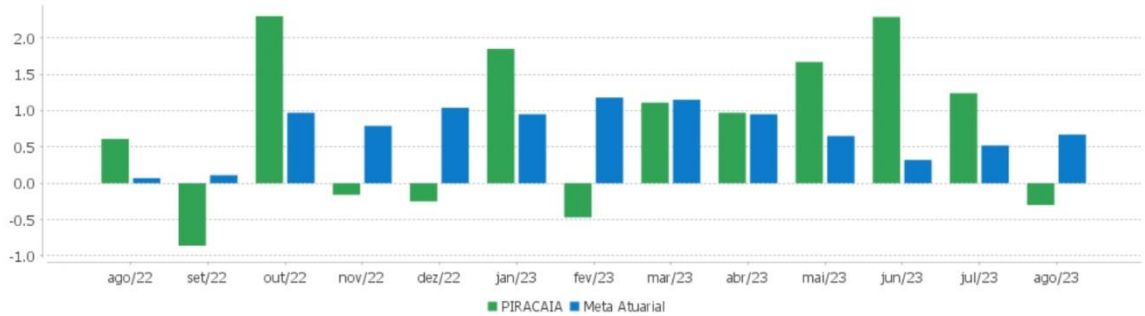


Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

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: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Variação da Estratégia</b>							
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a	0,66	7,70	2,15	6,15			
Var. IPCA p.p.	0,43	4,77	1,88	4,31			
NTN-B 150525 (6,290000%)	0,78	4,75	1,80	2,47	4,56		
Var. IPCA p.p.	0,55	1,52	1,53	0,64	-0,04		
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,72	7,33	1,61	5,12	10,05	27,14	46,53
Var. IPCA p.p.	0,49	4,10	1,34	3,28	5,44	13,40	21,78
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,70	7,19	1,56	5,02	9,85	26,67	37,98
Var. IPCA p.p.	0,47	3,96	1,29	3,19	5,24	12,93	13,23
NTN-B 150824 (7,620000%)	0,90	5,57	2,13	6,18	8,96		
Var. IPCA p.p.	0,67	2,34	1,86	4,35	4,35		
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	0,47	8,81	2,80	5,95	10,78	19,17	20,85
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,14	0,07	0,14	0,19	-1,18	-3,86	-8,05
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	0,74	11,22	3,74	9,41	14,63	21,38	19,61
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,22	-0,07	-0,15	-0,33	-0,67	-0,93
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	-0,48	11,77	3,00	10,58	12,22	15,72	15,76
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,11	-0,07	0,17	0,15	-1,54	-4,35	-8,23
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,90	7,63	2,92	4,76	11,09	20,92	24,64
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,28	-4,21	0,09	-5,67	-2,68	0,85	0,65
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,52	11,85	2,47	10,29	13,71	17,13	17,92
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,14	0,00	-0,36	-0,14	-0,05	-2,94	-6,07
BB PREV IPCA III	0,90	7,62	2,91	4,75	11,05	22,75	29,46
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,14	0,30	1,12	-0,14	0,19	-5,02	-19,05
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,35	7,18	2,04	6,14	10,57	22,74	27,23
% do CDI	30,45	81,03	61,35	91,95	77,99	90,47	95,50
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,37	11,68	3,52	9,87	12,79	24,05	26,07
Var. IPCA p.p.	0,14	8,45	3,25	8,04	8,18	10,31	1,33
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TÍTULOS PUB	-0,40	11,62	2,75	10,27	13,42	19,28	22,74
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,22	-0,08	-0,16	-0,35	-0,79	-1,25
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-0,47	12,05	2,87	10,78	13,15	18,33	22,03
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,10	0,21	0,04	0,36	-0,61	-1,73	-1,96
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-0,34	11,82	2,86	10,57	13,46	19,55	23,15
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,03	-0,02	0,03	0,14	-0,31	-0,52	-0,84
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,20	7,05	3,85	6,43	11,01	21,96	24,13

18 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Variação da Estratégia</b>							
% do CDI	105,33	79,48	115,98	96,34	81,22	87,36	84,62
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,65	8,87	2,97	6,83	12,95	25,95	29,91
% do CDI	57,45	99,99	89,39	102,23	95,58	103,25	104,89
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-7,25	7,96	3,17	16,79	-2,31	-24,48	-13,39
Var. SMALL CAP p.p.	0,17	-0,17	-0,09	-0,62	-0,37	-0,72	-2,58
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-8,94	-1,06	2,60	4,42	-11,97	-29,02	-19,40
Var. IBOVESPA p.p.	-3,85	-6,53	-4,24	-5,88	-17,65	-26,47	-35,88
VINCI MOSAICO FIA	-4,62	10,34	9,34	14,26	4,32	-6,98	8,11
Var. IBOVESPA p.p.	0,47	4,86	2,50	3,96	-1,35	-4,42	-8,37
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	-5,22	5,10	6,45	9,96	-0,69	-6,54	5,23
Var. IBOVESPA p.p.	-0,14	-0,38	-0,39	-0,34	-6,37	-3,99	-11,25
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA ACOES FI	-4,93	5,49	7,24	10,30	4,56	-4,77	14,36
Var. IBOVESPA p.p.	0,15	0,02	0,40	-0,00	-1,12	-2,21	-2,11
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	-4,95	-3,99	2,67	0,58	-2,10	-13,16	5,30
Var. IBOVESPA p.p.	0,14	-9,47	-4,16	-9,72	-7,78	-10,60	-11,18
VINCI FATORIAL DINÂMICO FIA	-4,93	5,61	6,93	10,93	-1,80	-9,79	7,44
Var. IBOVESPA p.p.	0,16	0,14	0,09	0,63	-7,48	-7,23	-9,03
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,90	20,35	5,57	14,51	14,97	-4,08	11,45
Var. Global BDRX p.p.	-0,36	-1,08	-0,40	-0,51	-0,67	-2,01	-4,96
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	3,77	13,23	5,31	10,15	9,59	-12,05	4,24
Var. IBOVESPA p.p.	8,85	7,75	-1,53	-0,15	3,91	-9,49	-12,23
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4,54	-1,69	0,70	-1,54	0,60	-6,60	-1,87
Var. MSCI ACWI p.p.	3,81	-6,61	-1,83	-4,64	-5,75	4,82	-7,41
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,98	-14,05	-2,38	-15,61	-13,10	-31,49	-20,65
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,71	-20,96	-4,91	-18,71	-19,45	-20,07	
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	-1,02	-8,07	-1,17	-7,07	-4,95	25,08	
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,75	-14,99	-3,70	-10,17	-11,31	36,50	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-0,43	31,06	12,53	20,70	17,87	-17,62	5,32
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,16	24,15	10,00	17,61	11,51	-6,20	-0,22
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,35	27,77	5,56	13,52	17,77	-28,49	-20,65
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,58	20,45	3,77	8,63	6,91	-56,26	-69,16
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTEC ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-6,06	22,48	2,15	9,33	21,80	-8,87	17,83
Var. MSCI ACWI p.p.	-6,78	15,56	-0,37	6,24	15,45	2,55	12,29
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-0,96	22,95	9,70	17,61	23,14	16,57	51,68
Var. IBOVESPA p.p.	4,12	17,47	2,86	7,31	17,46	19,13	35,20
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	-0,09	2,81	-0,02	2,88	4,36	26,43	86,26

19 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
Var. IBOVESPA p.p	5,00	-2,67	-6,86	-7,42	-1,32	28,99	69,78
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	1,28	0,50	1,55	0,00	-33,64	-36,62	-40,48
Var. IFIX p.p.	0,79	-11,56	-5,06	-14,40	-41,59	-53,46	-55,96
PIRACAIA							
Var. IPCA + 4,88% p.p.	-0,30	8,64	3,25	7,17	9,73	13,53	24,53
CDI	-0,96	2,18	1,78	2,92	0,21	-11,17	-18,67
IBOVESPA	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
INPC + 6,00%	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
IPCA + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

20 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

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	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	1,90
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		0,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100%	0,50

21 de 31



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/08/2023

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 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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/08/2023

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 MULTIESTRATÉGIA 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





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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

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	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45

24 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

25 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

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%)	3.307.881,20	6,290000	3.337.858,14	5,690000	29.976,94
NTN-B 150535 (5,315000%)	22.116.856,30	5,315000	21.957.671,75	5,404200	-159.184,55
NTN-B 150824 (7,620000%)	3.218.743,80	7,620000	3.242.464,07	6,772200	23.720,27
NTN-B 150826 (5,510000%)	25.285.047,44	5,510000	25.476.947,31	5,220000	191.899,87

26 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
524	01/08/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	697.000,00	30.828,83886164	22,6087010000
529	01/08/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	65.000,00	2.874,99931995	22,6087010000
523	08/08/2023	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	445.245,39	0,00	11.667,81057380	38,1601490000
522	15/08/2023	BB PREV IPCA III	0,00	24.884,04	8.607,07885900	2,8911132810
525	15/08/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	831.047,31	0,00	36.516,34520930	22,7582280000
526	16/08/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	482.474,77	0,00	21.200,45633677	22,7577540000
527	17/08/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	43.215,23	0,00	1.901,46265105	22,7273620000
530	21/08/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	27.982,13	0,00	1.234,36777654	22,6692000000
528	31/08/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	22.244,78	0,00	980,33074382	22,6910970000
531	31/08/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.306,13	0,00	277,91208155	22,6910970000
<b>Total</b>			<b>1.858.515,74</b>	<b>786.884,04</b>		

27 de 31



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



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.885.706,78

Value-At-Risk: 1,34%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIRACAIA		1,34	1,34			140.656.419,84	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,36%

##### Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,290000%)		0,23	-0,00	0,25			3.307.881,20	2,35
NTN-B 150535 (5,315000%)		0,10	0,00	0,11			22.116.856,30	15,72
NTN-B 150824 (7,620000%)		0,10	0,00	0,11			3.218.743,80	2,29
NTN-B 150826 (5,510000%)		0,10	0,00	0,11			25.285.047,44	17,98
<b>Sub-total</b>	0,19	0,09	0,00		-2,21	0,72	53.928.528,74	38,34

##### Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI		1,02	0,04	0,00			12.962.793,93	9,22
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA		1,87	0,00	0,14			480.439,66	0,34
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB		1,88	0,00	0,00			4.762,80	0,00
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF		2,07	0,00	0,44			336.023,70	0,24
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF		1,15	0,02	0,53			5.671.802,93	4,03
BB PREV IPCA III		0,48	0,00	0,51			844.382,05	0,60
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,49	0,00	1,78			1.633.244,20	1,16
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		1,35	0,03	1,35			6.788.852,61	4,83
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,96	0,00	0,96			1.526.923,68	1,09
<b>Sub-total</b>	2,37	1,01	0,10		-0,24	0,56	30.249.225,56	21,51

##### Artigo 7º III, Alínea a

28 de 31



Carteira: PIRACAIA

Data Extrato: 31/08/2023

### 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
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,02	0,00	0,25			78.115,24	0,06
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,88	0,00	0,07			70.479,04	0,05
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,49	0,01	0,49			8.168.760,41	5,81
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,48	0,00	0,48			2.304.451,97	1,64
<b>Sub-total</b>	1,12	0,45	0,01		-0,07	1,06	10.621.806,66	7,55

##### Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BBDC - BCO BRADESCO SA 6,80% a.a		0,12	0,00	0,15			4.636.777,00	3,30
<b>Sub-total</b>	0,57	0,12	0,00		-0,84	0,66	4.636.777,00	3,30

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 7,33%

##### Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI		7,30	0,01	0,53			204.275,67	0,15
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,96	0,01	0,41			235.539,77	0,17
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		7,82	0,34	1,45			7.145.254,09	5,08
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,99	0,28	2,76			6.779.267,69	4,82
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		8,18	0,06	3,31			1.177.933,92	0,84
VINCI MOSAICO FIA		8,30	0,05	2,28			908.159,44	0,65
VINCI FATORIAL DINAMICO FIA		7,67	0,04	1,23			895.932,52	0,64
<b>Sub-total</b>	11,69	7,33	0,79		-0,56	-5,36	17.346.363,10	12,33

#### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,12%

##### Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO		5,42	0,32	7,41			11.586.894,65	8,24
<b>Sub-total</b>	11,95	5,42	0,32		-0,18	-0,96	11.586.894,65	8,24

29 de 31



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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º II

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 MULTISTRATÉGIA II		0,09	0,00	7,60			3.663.055,33	2,60
<b>Sub-total</b>	0,28	0,09	0,00		-4,30	-0,09	3.663.055,33	2,60

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,84%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		6,09	-0,01	5,88			755.753,44	0,54
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR		5,71	0,01	7,76			1.543.714,54	1,10
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		8,29	0,06	7,01			1.585.784,01	1,13
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,33	0,05	8,30			1.170.465,55	0,83
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,81	-0,00	8,32			890.242,27	0,63
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,25	-0,00	9,25			886.130,90	0,63
<b>Sub-total</b>	10,55	4,71	0,10		-0,21	-1,04	6.832.090,71	4,86

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,04	0,01	0,87			1.024.062,67	0,73
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		6,69	0,01	11,00			708.833,56	0,50
<b>Sub-total</b>	16,58	6,75	0,02		0,13	3,25	1.732.896,23	1,23

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,10%

Artigo 11º

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



Carteira: PIRACAIA Data Extrato: 31/08/2023

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		0,10	-0,00	1,81			58.781,86	0,04
<b>Sub-total</b>	4,22	0,10	-0,00		0,03	1,28	58.781,86	0,04

31 de 31



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

O Sr. Robson informou que na reunião ocorrida dia 14/09/2023 que o Comitê de Investimentos indicou que novos recursos devem ser aplicados nos fundos ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI - 21.838.150/0001-49 e ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI - 10.396.381/0001-23, o primeiro para abarcar os pagamentos de benefícios no curto prazo e o segundo para captar a entrada de recursos de aporte, ambos os ativos possuem liquidez em suas carteiras para atender o pagamento de passivos e estão devidamente registrados e em ordem dentro do sistema do RPPS, com as quedas das taxas de juros os dois fundos devem ser beneficiados por suas composições em ativos pré-fixados que irão trazer rentabilidade e capitalização para o patrimônio, e para integralizar a chamada de capital foi selecionado o fundo ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI - 32.972.942/0001-28, sendo assim referendadas as recomendações do Comitê de Investimentos. Em tempo os membros do Conselho Administrativo referendaram também a decisão de manutenção do fundo KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - 14.423.780/0001-97 pelo prazo de mais três meses, encerrando em 14 de novembro de 2023. **Item APROVADO.** A seguir a Sra.Claudia informou que esteve pessoalmente com o Sr.Prefeito para tratar das contribuições atrasadas, quando ele manifestou não ter interesse de realizar o parcelamento que lhe é permitido por lei, pois a intenção é de no máximo ficar atrasado em no máximo um mês, pagando juros e multa, até que possa quitar e manter os pagamentos em dia. Na data de hoje os pagamentos de agosto estão atrasados. Apesar disso foi possível renovar o Certificado de Regularidade Previdenciária CRP até 17/03/2024 tendo em vista o atraso ser de apenas um mês e devido a data de envio das informações serem do mês anterior. Sra. Claudia informou também que o Piraprev recebeu nos dias 12 e 13/09 a visita do Sr. Edgar Inoue, fiscal do Tribunal de Contas do Estado para a auditoria in loco. Os itens solicitados na requisição nº 1 foram entregues com um dia de antecedência, bem como foram entregues para análise documentos durante o período em que o mesmo esteve na sede do Piraprev. A seguir a Sra. Claudia apresentou o **processo de aposentadoria** concedido em setembro, além de um **processo licitatório**. **Item APROVADO.**

Aposentadorias	Nome	Processo	Concessão	Tipo	Cargo
	Edson Constantino	18/2023	01/09/2023	Incapacidade permanente	Pedreiro oficial

Licitação	Nome	Processo	Objeto
	Porto Seguro Cia de Seguros Gerais	15/2023	Seguro patrimonial sede Instituto.



Sendo o que havia a apresentar a reunião foi encerrada.

Piracaia, 19 de setembro de 2023.

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