



LDB
EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA -
JANEIRO 2023
CONSOLIDADO



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 98,61%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,810000%)	2,90	0,07	1,18	1,18	41.288.743,81	9,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,310000%)	4,23	0,05	1,22	1,22	15.225.867,83	3,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	2,86	0,01	1,18	1,18	75.584.396,42	18,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,900000%)	4,18	0,05	1,19	1,19	20.531.195,97	4,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,720000%)	4,11	0,04	1,18	1,18	53.895.215,12	12,87
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,57	0,04	1,18	1,18	206.525.419,15	49,33

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				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,39	0,10	0,65	0,65	4.058.108,03	0,97	6.574.841.764,48	0,06
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,07	0,05	1,12	1,12	3.482.100,84	0,83	31.492.016.561,99	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,09	0,05	1,12	1,12	25.186.725,72	6,02	16.267.911.192,80	0,15
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,44	0,05	1,08	1,08	2.960.097,37	0,71	188.457.644,48	1,57
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,63	0,04	1,38	1,38	3.855.727,89	0,92	1.237.319.342,14	0,31
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,45	0,06	1,06	1,06	21.421.247,07	5,12	6.562.900.517,46	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,06	1,12	1,12	3.909.792,71	0,93	6.631.421.970,83	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,09	0,69	0,69	3.086.361,96	0,74	483.170.355,38	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,62	0,04	1,37	1,37	3.176.190,89	0,76	7.844.346.137,20	0,04
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,83	-0,01	1,44	1,44	2.223.240,36	0,53	7.184.164.479,15	0,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,51	0,09	0,72	0,72	4.358.787,96	1,04	163.738.025,51	2,66
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	-0,03	1,41	1,41	1.739.544,40	0,42	6.830.711.830,39	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,64	0,04	1,37	1,37	9.153.737,54	2,19	5.664.338.306,58	0,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,35	0,15	0,50	0,50	778.939,07	0,19	2.164.364.253,13	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,07	1,04	1,04	730.528,67	0,17	5.210.677.767,90	0,01
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,07	0,05	1,11	1,11	10.525.579,36	2,51	3.967.773.287,89	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,18	0,05	1,10	1,10	100.646.709,84	24,04		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,66	0,09	0,64	0,64	10.518.436,31	2,51	198.095.679,31	5,31
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,05	1,12	1,12	7.438.230,92	1,78	12.971.898.325,20	0,06
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,65	0,03	1,36	1,36	38.579.572,27	9,21	909.292.349,38	4,24
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,13	1,13	48.147.120,21	11,50	8.262.735.410,47	0,58
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,22	0,04	0,80	0,80	996.460,97	0,24	602.825.328,24	0,17
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,51	0,05	1,17	1,17	105.679.820,68	25,24		
Renda Fixa			1,15	0,04	1,16	1,16	412.851.949,67	98,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,39%

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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	21,50	-0,50	0,42	0,42	5.809.190,70	1,39	39.502.496,93	14,71
Sub-total Artigo 10º I			21,50	-0,50	0,42	0,42	5.809.190,70	1,39		
Investimentos Estruturados			11,30	-0,50	0,42	0,42	5.809.190,70	1,39		
Total			1,18	0,04	1,15	1,15	418.661.140,37	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	206.525.419,15	49,33	0,00	43,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	100.646.709,84	24,04	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	105.679.820,68	25,24	0,00	26,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	412.851.949,67	98,61					100,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	5.809.190,70	1,39	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	5.809.190,70	1,39					15,00
Total		418.661.140,37	100,00					

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	1,18 105,24	1,18 105,24	3,12 94,56			2.412.942,26	2.412.942,26
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,10 97,51	1,10 97,51	2,66 80,63	5,70 84,96	11,58 90,41	1.090.080,68	1.090.080,68
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 104,06	1,17 104,06	2,61 79,04	5,46 81,43	11,66 91,05	1.215.493,61	1.215.493,61
Artigo 10º I % do CDI	0,42 37,71	0,42 37,71	-3,45 -104,36	-0,78 -11,62	3,13 24,41	24.503,88	24.503,88
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						4.743.020,43	4.743.020,43

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,810000%)	40.806.209,20	0,00	0,00	0,00	41.288.743,81	482.534,61	482.534,61
NTN-B 150535 (6,310000%)	15.041.700,38	0,00	0,00	0,00	15.225.867,83	184.167,45	184.167,45
NTN-B 150545 (5,730000%)	74.705.692,66	0,00	0,00	0,00	75.584.396,42	878.703,76	878.703,76
NTN-B 150830 (5,900000%)	20.289.707,93	0,00	0,00	0,00	20.531.195,97	241.488,04	241.488,04
NTN-B 150840 (5,720000%)	53.269.166,72	0,00	0,00	0,00	53.895.215,12	626.048,40	626.048,40
					206.525.419,15	0,00	0,00

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 RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	4.031.994,60	0,00	0,00	0,00	4.058.108,03	26.113,43	26.113,43
BB PREV RF IDKA2	2.191.761,66	0,00	0,00	0,00	2.223.240,36	31.478,70	31.478,70
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.327.690,38	0,00	0,00	0,00	4.358.787,96	31.097,58	31.097,58
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	9.029.604,58	0,00	0,00	0,00	9.153.737,54	124.132,96	124.132,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	21.197.199,11	0,00	0,00	0,00	21.421.247,07	224.047,96	224.047,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.715.376,98	0,00	0,00	0,00	1.739.544,40	24.167,42	24.167,42
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.154.692,61	0,00	-21.486,17	0,00	3.176.190,89	42.984,45	42.984,45
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.065.251,30	0,00	0,00	0,00	3.086.361,96	21.110,66	21.110,66
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.866.441,39	0,00	0,00	0,00	3.909.792,71	43.351,32	43.351,32
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	24.131.604,37	1.422.961,56	-641.809,26	0,00	25.186.725,72	273.969,05	273.969,05
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	723.039,09	0,00	0,00	0,00	730.528,67	7.489,58	7.489,58
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	775.048,99	0,00	0,00	0,00	778.939,07	3.890,08	3.890,08
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	0,00	0,00	0,00	3.482.100,84	38.528,16	38.528,16
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.803.274,93	0,00	0,00	0,00	3.855.727,89	52.452,96	52.452,96
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	2.928.602,57	0,00	0,00	0,00	2.960.097,37	31.494,80	31.494,80
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	10.410.074,92	0,00	0,00	0,00	10.525.579,36	115.504,44	115.504,44
					100.646.709,84	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	3.443.572,68	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.218.241,87	150.358,14	-12.239,93	0,00	7.438.230,92	81.870,84	81.870,84
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	46.554.687,12	2.901.010,44	-1.846.843,15	0,00	48.147.120,21	538.265,80	538.265,80
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	38.060.750,82	0,00	0,00	0,00	38.579.572,27	518.821,45	518.821,45
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	10.451.512,11	0,00	0,00	0,00	10.518.436,31	66.924,20	66.924,20
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	988.582,52	0,00	0,00	0,00	996.460,97	7.878,45	7.878,45
					105.679.820,68	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	5.784.686,82	0,00	0,00	0,00	5.809.190,70	24.503,88	24.503,88
					5.809.190,70	0,00	0,00

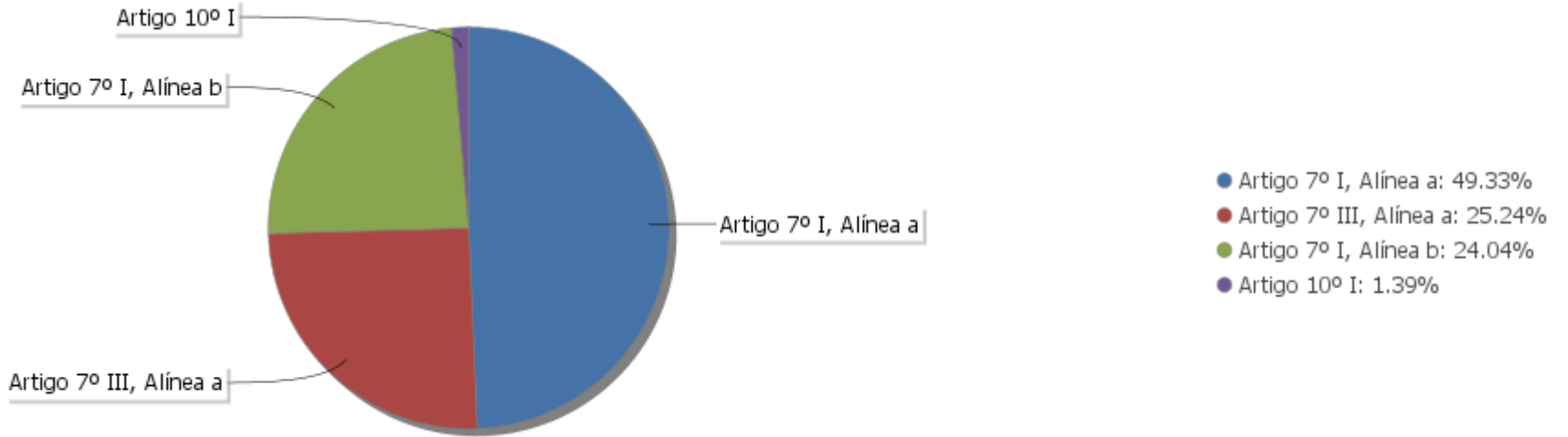
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

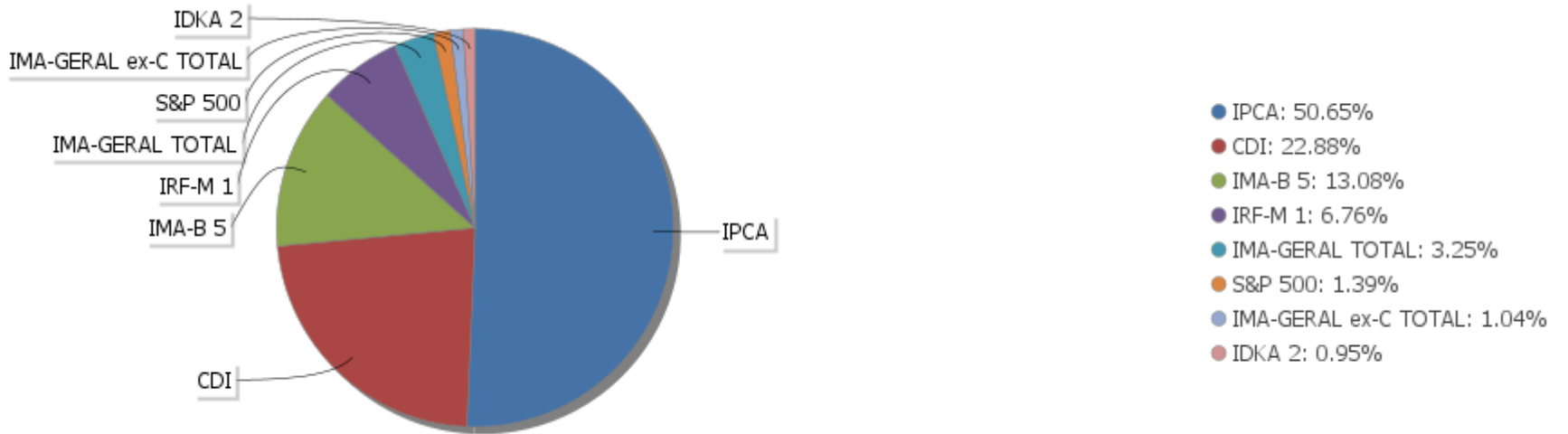
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	206.326.530,52	49,28	206.326.530,52	49,28	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	206.326.530,52	49,28	
acima de 365 dias	212.334.609,85	50,72	418.661.140,37	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

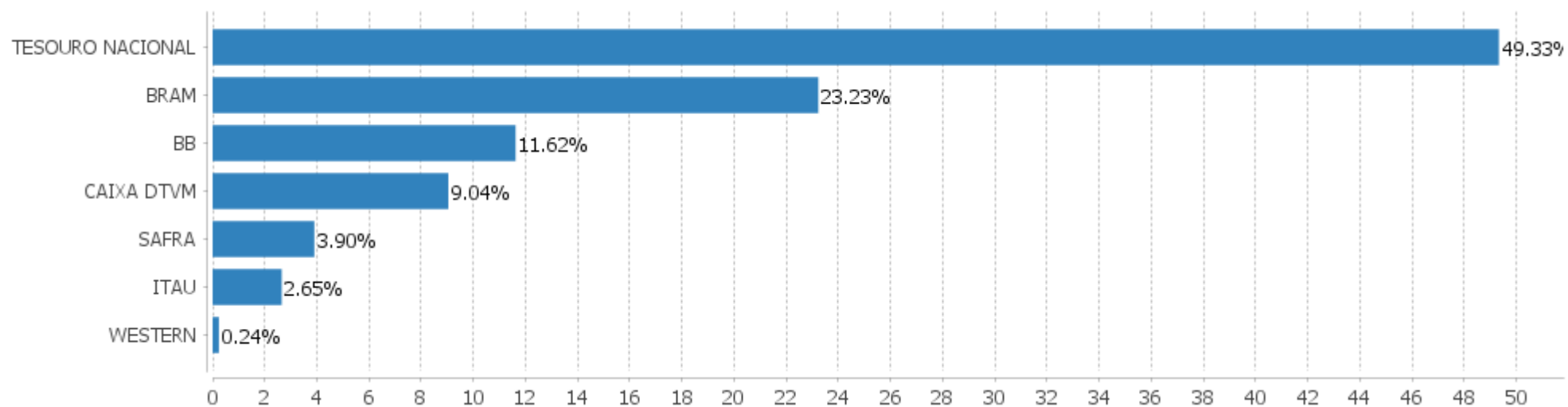


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



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	1,15												1,15
IPCA + 4,90%	0,95												0,95
p.p. indexador	0,20												0,20
2022	0,33	0,89	1,61	1,00	0,89	0,61	0,53	0,76	0,87	1,05	0,64	0,93	10,59
IPCA + 5,00%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98	0,80	1,05	11,05
p.p. indexador	-0,62	-0,49	-0,45	-0,43	-0,01	-0,47	0,81	0,68	0,75	0,07	-0,16	-0,12	-0,47
2021										-0,89	1,68	0,81	1,59
IPCA + 6,00%										1,72	1,42	1,27	4,47
p.p. indexador										-2,61	0,26	-0,46	-2,88

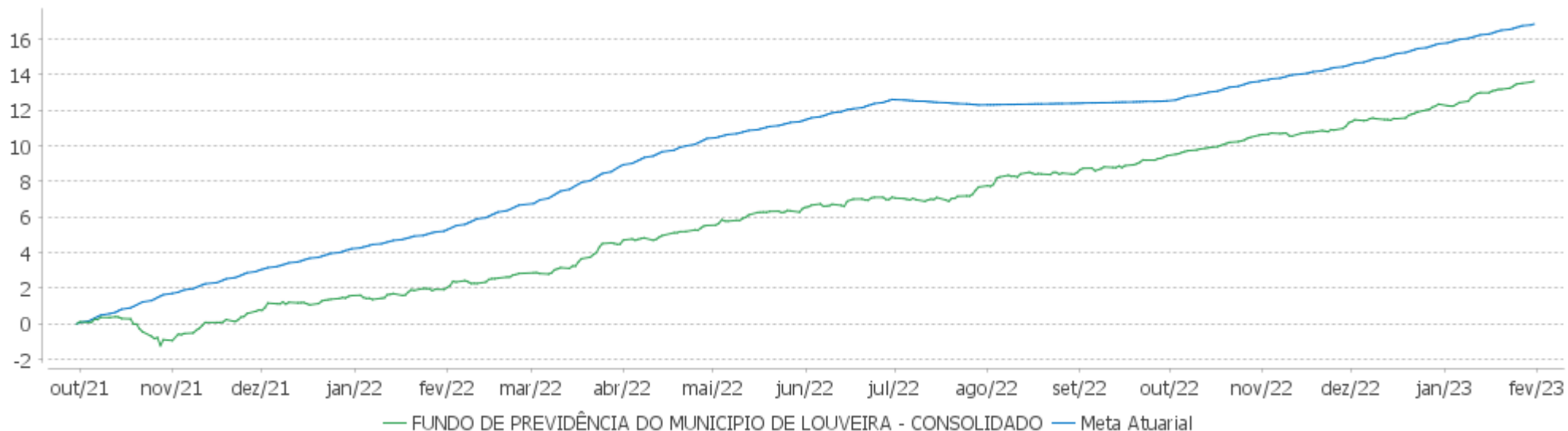
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

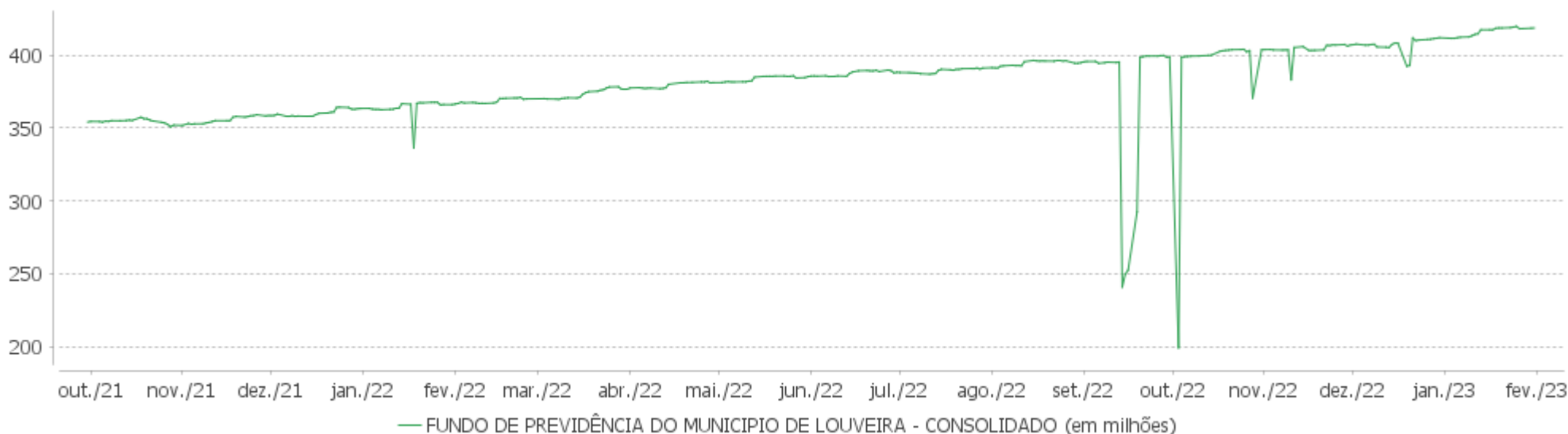
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	6	37,50	03 meses	2,74	2,83	-0,09	0,94
Meses abaixo - Meta Atuarial	10	62,50	06 meses	5,52	4,04	1,48	1,01
			12 meses	11,48	11,05	0,43	1,18
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11	Desde 30/09/2021	13,64	17,12	-3,48	1,43
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

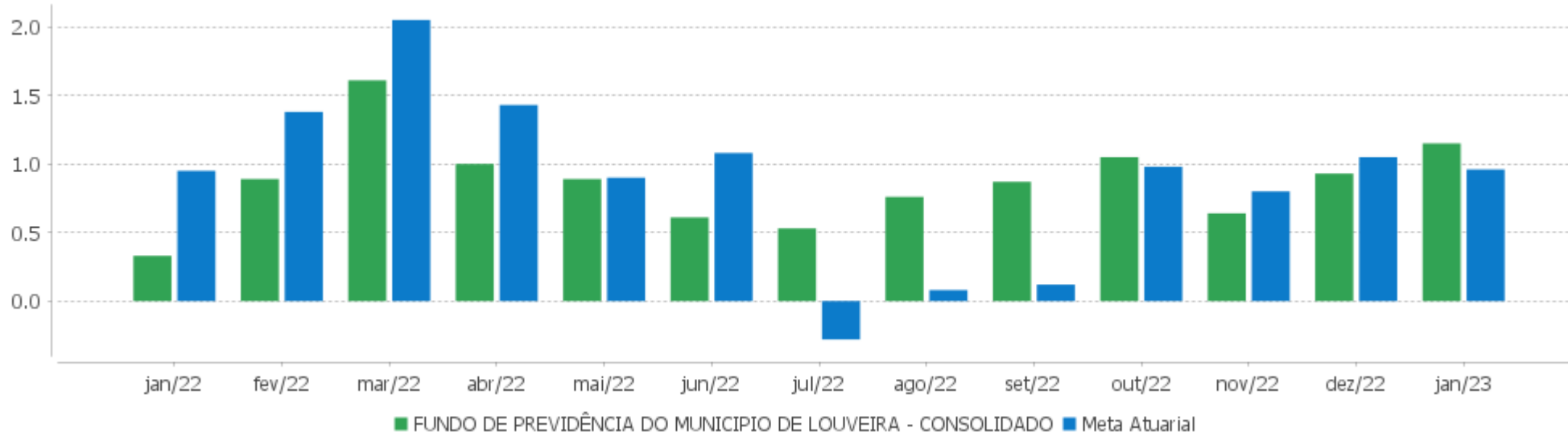


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (6,310000%) Var. IPCA p.p.	1,22 0,69	1,22 0,69	0,25 -1,32	1,01 -0,50	5,96 0,19		
NTN-B 150830 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,18 1,61	0,90 -0,60	5,75 -0,02		
NTN-B 150840 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,14 1,57	0,87 -0,63	5,71 -0,07		
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,14 1,57	3,74 2,23	8,72 2,95		
NTN-B 150535 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,16 1,59	3,84 2,34	8,82 3,05		
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,08 -0,02	1,08 -0,02	3,19 -0,07	6,68 -0,07	12,34 -0,21	16,14 -0,38	19,74 -0,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,37 -0,02	1,37 -0,02	1,95 -0,06	4,36 -0,04	11,08 -0,11	15,87 -0,40	24,28 -0,78
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,38 -0,02	1,38 -0,02	1,96 -0,05	4,32 -0,08	11,00 -0,19	15,85 -0,42	24,35 -0,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,06 -0,04	1,06 -0,04	3,16 -0,09	6,58 -0,17	12,22 -0,32	15,86 -0,66	19,41 -1,10
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,37 -0,02	1,37 -0,02	1,92 -0,08	4,27 -0,13	10,93 -0,26	15,65 -0,63	24,08 -0,98
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,12 99,40	1,12 99,40	3,22 97,56	6,65 99,07	12,79 99,81	18,38 99,58	21,06 98,15
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,69 -0,01	0,69 -0,01	1,39 -0,03	5,28 0,09	10,13 -0,07	11,07 -0,69	15,33 -1,46
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	1,11 98,77	1,11 98,77	3,27 98,92	6,68 99,65	12,70 99,15	18,26 98,93	20,94 97,60
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,50 -0,03	0,50 -0,03	-0,90 -2,47	2,12 0,62	7,81 2,03	13,13 -3,63	16,12 -5,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,44 -0,00	1,44 -0,00	2,00 0,10	4,40 0,41	10,88 0,02	15,84 -0,42	24,75 -1,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,04 0,51	1,04 0,51	2,28 0,71	6,11 4,60	11,10 5,33	11,70 -5,06	18,20 -3,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,41	1,41	1,94	4,22	10,56	15,58	24,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IDKA 2 p.p.	-0,03	-0,03	0,03	0,23	-0,30	-0,68	-1,34
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 0,02	1,12 0,02	3,23 -0,02	6,66 -0,09	12,31 -0,23	16,01 -0,50	19,75 -0,76
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,65 0,12	0,65 0,12	1,30 -0,26	4,80 3,30	9,80 4,02	11,11 -5,64	
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,72	0,72	1,55	5,43	10,23	11,06	15,02
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	1,12 99,60	1,12 99,60	3,26 98,76	6,67 99,43	12,76 99,60	18,34 99,36	21,03 98,02
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,36 -0,03	1,36 -0,03	1,93 -0,08	4,22 -0,19	10,70 -0,49	14,87 -1,41	23,18 -1,88
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,13 100,38	1,13 100,38	3,39 102,66	6,94 103,53	13,39 104,56	19,73 106,95	22,02 102,64
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,12 100,04	1,12 100,04	3,30 100,03	6,77 100,88	12,97 101,23	18,92 102,53	21,55 100,44
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI % do CDI	0,80 70,95	0,80 70,95	2,22 67,34	5,87 87,50	11,87 92,68	15,73 85,25	20,25 94,37
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,64 -0,06	0,64 -0,06	1,27 -0,15	4,97 -0,22	9,79 -0,41	10,36 -1,40	15,86 -0,93
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	0,42 -3,34	0,42 -3,34	-3,45 -5,57				
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,15 0,20	1,15 0,20	2,74 -0,07	5,52 1,52	11,48 0,53		
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI			D+0	D+0		0,10
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,10	1,10	3,25	6,75	12,54	16,51	20,51	28,48	37,42
IRF-M 1+	0,72	0,72	0,90	6,13	8,73	4,24	10,25	25,21	40,80
IRF-M TOTAL	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42	13,75	26,79	40,53
IMA-B 5	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27	25,06	40,14	54,28
IMA-B 5+	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05	0,52	22,96	44,15
IMA-B TOTAL	-0,00	-0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93	11,46	31,65	50,23
IMA-GERAL TOTAL	0,70	0,70	1,42	5,19	10,20	11,76	16,79	30,01	43,27
IDKA 2	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26	25,79	39,66	54,03
IDKA 20	-4,58	-4,58	-9,69	-0,34	-3,60	-17,66	-17,08	6,23	30,85
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,69

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	16,47	33,58
IBRX 100	3,51	3,51	-2,34	9,39	0,75	-1,38	0,24	19,26	37,61
IBRX 50	3,38	3,38	-1,47	10,88	1,52	0,57	3,26	18,48	34,15
SMALL CAP	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13	-27,55	5,24	19,33
Índice Consumo - ICON			-16,42	-6,37	-24,84	-42,47	-44,77	-20,86	-20,70
Índice Dividendos - IDIV	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61	12,30	42,62	69,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	03/01/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	12.413,24	3.374,60934300	3,6784230000
2	03/01/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.072,93	2.466,52713400	3,6784230000
3	11/01/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	491.277,71	0,00	102.994,48295100	4,7699420000
4	13/01/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.610.573,82	0,00	178.250,25200000	14,6455547000
5	17/01/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	150.358,14	0,00	55.118,86174100	2,7278890610
6	17/01/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	641.809,26	134.290,14396400	4,7792730000
7	17/01/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	290.436,62	0,00	19.812,47300000	14,6592817000
8	17/01/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	200.000,00	13.643,23300000	14,6592817000
9	18/01/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	931.683,85	0,00	194.846,33286400	4,7816340000
10	26/01/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.646.843,15	111.960,85800000	14,7090972000
11	27/01/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.239,93	4.468,78484800	2,7389839560
Total			4.474.330,14	2.522.378,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.546.681,32

Value-At-Risk: 0,37%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO		0,37	0,37			418.661.140,37	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,28%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,810000%)		0,17	0,00	0,19			41.288.743,81	9,86
NTN-B 150535 (6,310000%)		0,20	0,00	0,25			15.225.867,83	3,64
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,18	-0,00	0,20			75.584.396,42	18,05
NTN-B 150830 (5,900000%)		0,14	0,00	0,18			20.531.195,97	4,90
NTN-B 150840 (5,720000%)		0,14	0,00	0,19			53.895.215,12	12,87
Sub-total	0,51	0,12	0,01		0,11	1,18	206.525.419,15	49,33

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		1,36	0,01	1,37			4.058.108,03	0,97
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI		0,01	-0,00	0,01			3.482.100,84	0,83
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	0,00	0,02			25.186.725,72	6,02
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,15	-0,00	0,20			2.960.097,37	0,71
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,40	0,01	0,00			3.855.727,89	0,92
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,15	0,01	0,03			21.421.247,07	5,12
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,15	0,00	0,02			3.909.792,71	0,93
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,34	0,01	0,08			3.086.361,96	0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,39	0,01	0,02			3.176.190,89	0,76
BB PREV RF IDKA2		1,52	0,01	0,36			2.223.240,36	0,53
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,23	0,01	1,23			4.358.787,96	1,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,56	0,01	0,37			1.739.544,40	0,42
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,40	0,03	0,02			9.153.737,54	2,19
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,95	0,00	1,96			778.939,07	0,19
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,62	0,00	0,65			730.528,67	0,17
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	0,00	0,01			10.525.579,36	2,51
Sub-total	0,94	0,47	0,10		-0,03	1,10	100.646.709,84	24,04

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		1,28	0,03	0,03			10.518.436,31	2,51
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			7.438.230,92	1,78
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,39	0,12	0,03			38.579.572,27	9,21
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	-0,00	0,01			48.147.120,21	11,50
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,61	0,00	0,61			996.460,97	0,24
Sub-total	1,13	0,63	0,15		0,04	1,17	105.679.820,68	25,24

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,69%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		10,69	0,11	18,34			5.809.190,70	1,39
Sub-total	25,49	10,69	0,11		-0,03	0,42	5.809.190,70	1,39