LDB EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

ABRIL 2023

Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.04.2023.

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 **98,59%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,810000%)	2,88	0,13	1,00	4,69	42.721.629,93	9,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,310000%)	4,22	0,11	1,04	4,86	15.772.079,15	3,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	2,84	0,07	0,99	4,67	78.194.466,29	17,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,900000%)	3,01	0,11	1,01	4,72	20.642.579,16	4,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,720000%)	2,98	0,09	0,99	4,67	54.202.525,40	12,46
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,46**	**0,09**	**1,00**	**4,69**	**211.533.279,93**	**48,62**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,03	0,05	0,89	4,15	9.918.108,05	2,28	36.382.532.815,75	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,05	0,03	0,84	4,08	33.787.614,86	7,77	14.112.115.876,43	0,24
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,40	0,04	0,84	4,19	1.516.286,73	0,35	262.693.406,72	0,58
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,40	0,02	0,83	4,11	11.820.406,69	2,72	6.489.955.274,11	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,50	-0,10	0,89	5,25	3.229.973,67	0,74	8.356.195.901,98	0,04
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,75	-0,15	0,68	5,08	2.303.062,43	0,53	7.136.555.126,91	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,85	-0,13	0,72	5,12	1.803.174,26	0,41	6.998.568.436,27	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,52	-0,10	0,89	5,25	4.368.739,62	1,00	5.743.838.589,97	0,08
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,03	0,05	0,89	4,13	10.839.610,19	2,49	4.782.179.808,47	0,23
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,05**	**0,01**	**0,85**	**4,31**	**79.586.976,50**	**18,29**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,60	-0,09	1,22	4,75	5.800.805,94	1,33	173.515.091,28	3,34
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,89	4,09	32.013.118,16	7,36	14.478.047.383,36	0,22
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,53	-0,11	0,88	5,22	29.795.793,38	6,85	997.254.506,58	2,99
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,05	0,90	4,13	69.217.278,45	15,91	7.884.712.793,21	0,88
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,30	0,03	0,27	1,51	1.003.478,88	0,23	526.517.248,87	0,19
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**1,34**	**0,01**	**0,90**	**4,51**	**137.830.474,81**	**31,68**		
		Renda Fixa	**0,96**	**0,05**	**0,94**	**4,55**	**428.950.731,24**	**98,59**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 1,41%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	17,28	1,00	0,99	5,72	6.115.404,06	1,41	41.584.747,70	14,71
		Sub-total Artigo 10º I	**17,28**	**1,00**	**0,99**	**5,72**	**6.115.404,06**	**1,41**		
		Investimentos Estruturados	**12,38**	**1,00**	**0,99**	**5,72**	**6.115.404,06**	**1,41**		
		Total	**1,00**	**0,06**	**0,94**	**4,57**	**435.066.135,30**	**100,00**		

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**ALM**	**Limite Legal**
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	211.533.279,93	48,62	0,00	43,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	79.586.976,50	18,29	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	137.830.474,81	31,68	0,00	26,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	**428.950.731,24**	**98,59**					100,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	6.115.404,06	1,41	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**6.115.404,06**	**1,41**					15,00
Total		**435.066.135,30**	**100,00**					

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	1,00 108,82	4,69 111,77	3,47 114,09	6,70 103,98		2.092.583,52	9.516.814,77
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,85 92,38	4,31 102,57	3,18 104,45	5,92 91,93	11,39 85,15	668.909,44	3.686.966,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,90 97,89	4,51 107,35	3,30 108,50	6,00 93,05	10,92 81,65	1.230.403,61	5.382.062,00
Artigo 10º I % do CDI	0,99 107,64	5,72 136,17	5,27 173,33	1,64 25,49	5,82 43,53	59.848,98	330.717,24
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						**4.051.745,55**	**18.916.560,43**

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%)	42.298.927,81	0,00	0,00	0,00	42.721.629,93	422.702,12	1.915.420,73
NTN-B 150535 (6,310000%)	15.610.435,54	0,00	0,00	0,00	15.772.079,15	161.643,61	730.378,77
NTN-B 150545 (5,730000%)	77.424.861,82	0,00	0,00	0,00	78.194.466,29	769.604,47	3.488.773,63
NTN-B 150830 (5,900000%)	20.436.971,77	0,00	0,00	0,00	20.642.579,16	205.607,39	940.955,71
NTN-B 150840 (5,720000%)	53.669.499,47	0,00	0,00	0,00	54.202.525,40	533.025,93	2.441.285,93
					211.533.279,93	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 IDKA2	2.287.567,81	0,00	0,00	0,00	2.303.062,43	15.494,62	111.300,77
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.330.029,47	0,00	0,00	0,00	4.368.739,62	38.710,15	339.135,04
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.723.280,79	0,00	0,00	0,00	11.820.406,69	97.125,90	623.207,58
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.790.317,11	0,00	0,00	0,00	1.803.174,26	12.857,15	87.797,28
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.201.631,71	0,00	0,00	0,00	3.229.973,67	28.341,96	162.539,83

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.670.296,75	1.075.298,47	-1.238.950,23	0,00	33.787.614,86	280.969,87	1.190.732,68
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	9.830.747,27	0,00	0,00	0,00	9.918.108,05	87.360,78	289.510,90
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.503.630,79	0,00	0,00	0,00	1.516.286,73	12.655,94	87.684,16
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	10.744.217,12	0,00	0,00	0,00	10.839.610,19	95.393,07	429.535,27
					79.586.976,50	0,00	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.641.129,25	176.973,25	-85.817,29	0,00	32.013.118,16	280.832,95	861.147,23
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	68.045.356,38	2.451.572,35	-1.898.225,82	0,00	69.217.278,45	618.575,54	2.419.949,15
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	29.537.200,36	0,00	0,00	0,00	29.795.793,38	258.593,02	1.735.042,56
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5.731.093,76	0,00	0,00	0,00	5.800.805,94	69.712,18	349.293,83
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1.000.788,96	0,00	0,00	0,00	1.003.478,88	2.689,92	14.896,36
					137.830.474,81	0,00	

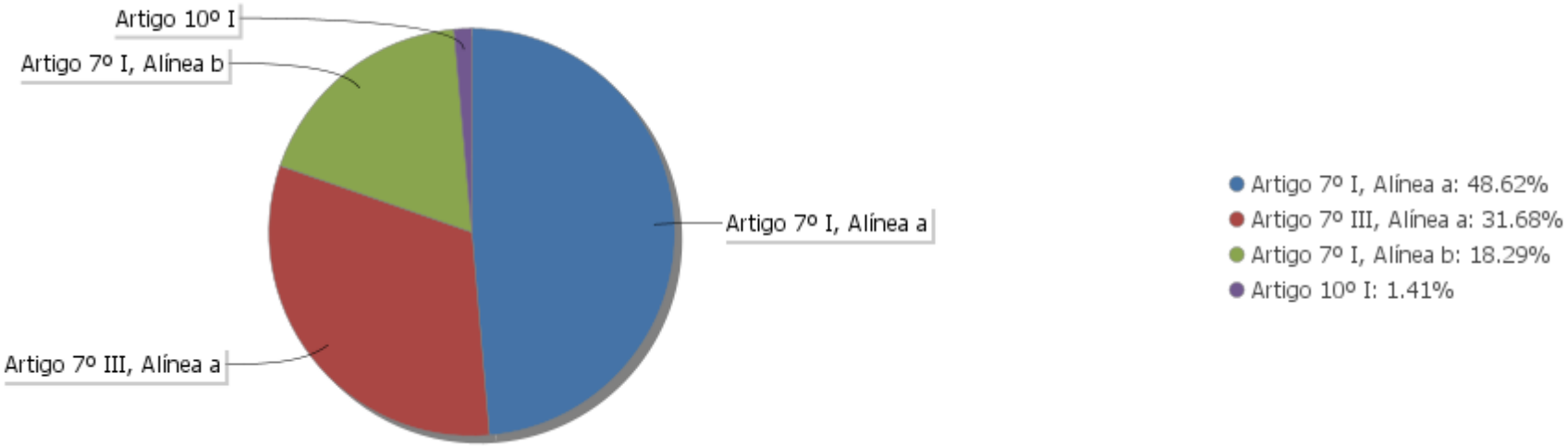
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	6.055.555,08	0,00	0,00	0,00	6.115.404,06	59.848,98	330.717,24
					6.115.404,06	0,00	

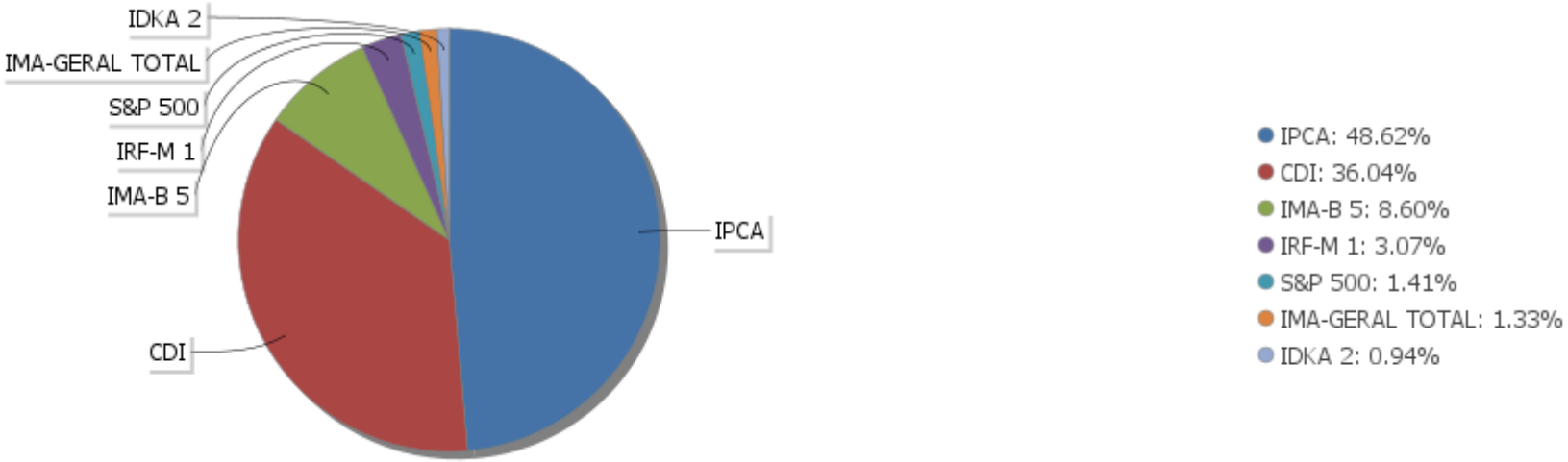
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
de 0 a 30 dias	217.417.451,31	49,97	217.417.451,31	49,97	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	217.417.451,31	49,97	
acima de 365 dias	217.648.683,99	50,03	435.066.135,30	100,00	

Alocação por Artigo

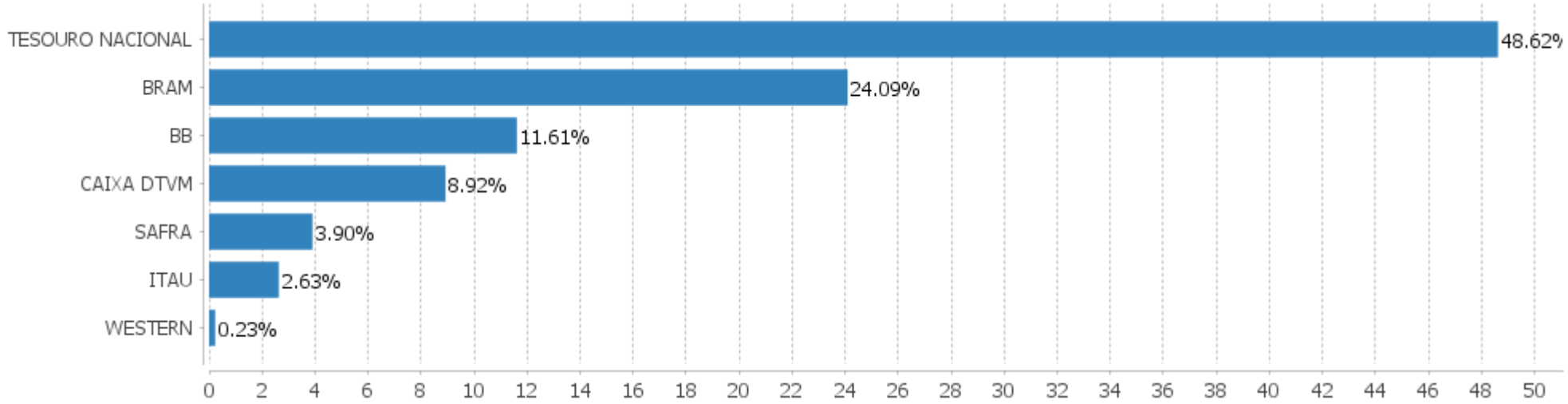


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,15	1,03	1,38	0,94									4,57
IPCA + 5,08%	0,97	1,20	1,17	0,97									4,37
p.p. indexador	0,18	-0,17	0,21	-0,03									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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	7	36,84
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	63,16

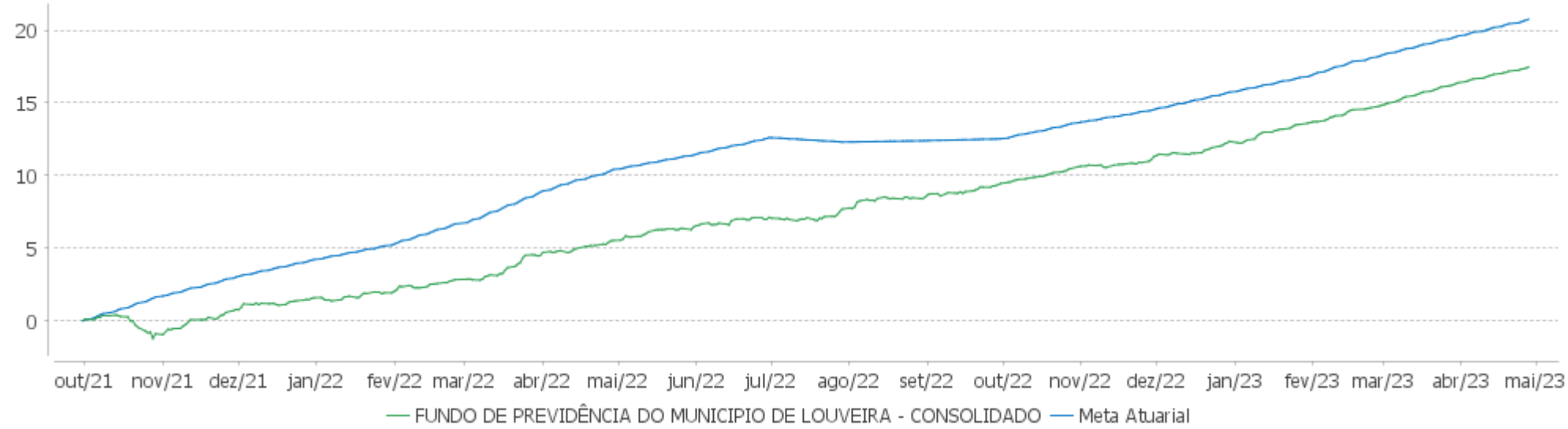
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10

Relatório

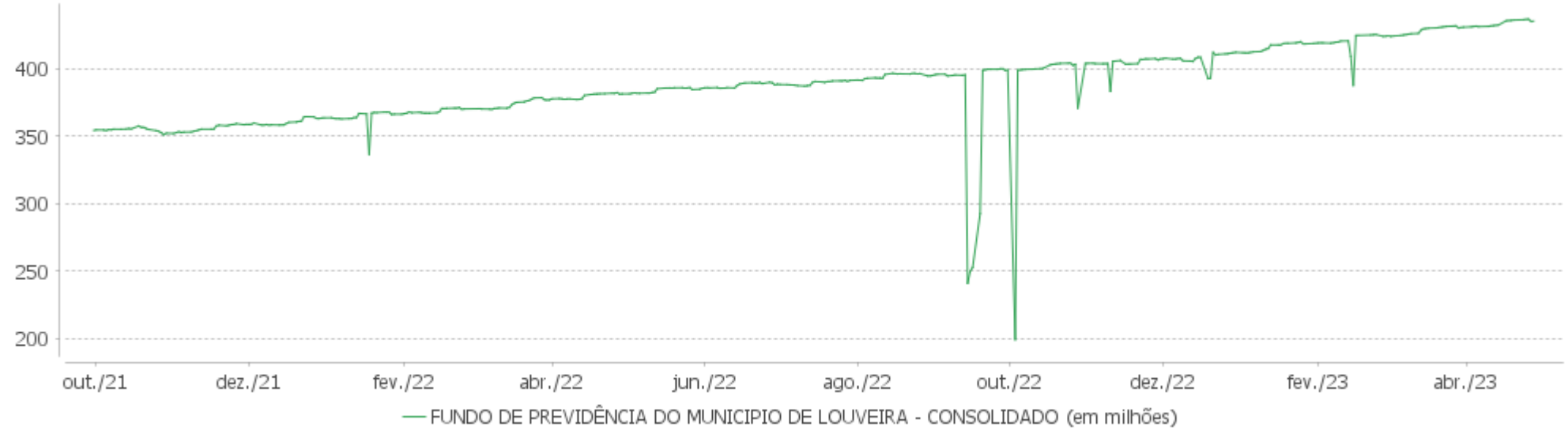
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,38	3,37	0,02	0,35
06 meses	6,21	6,30	-0,09	0,73
12 meses	11,32	9,40	1,92	1,00
24 meses				
Desde 30/09/2021	17,48	21,08	-3,60	1,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

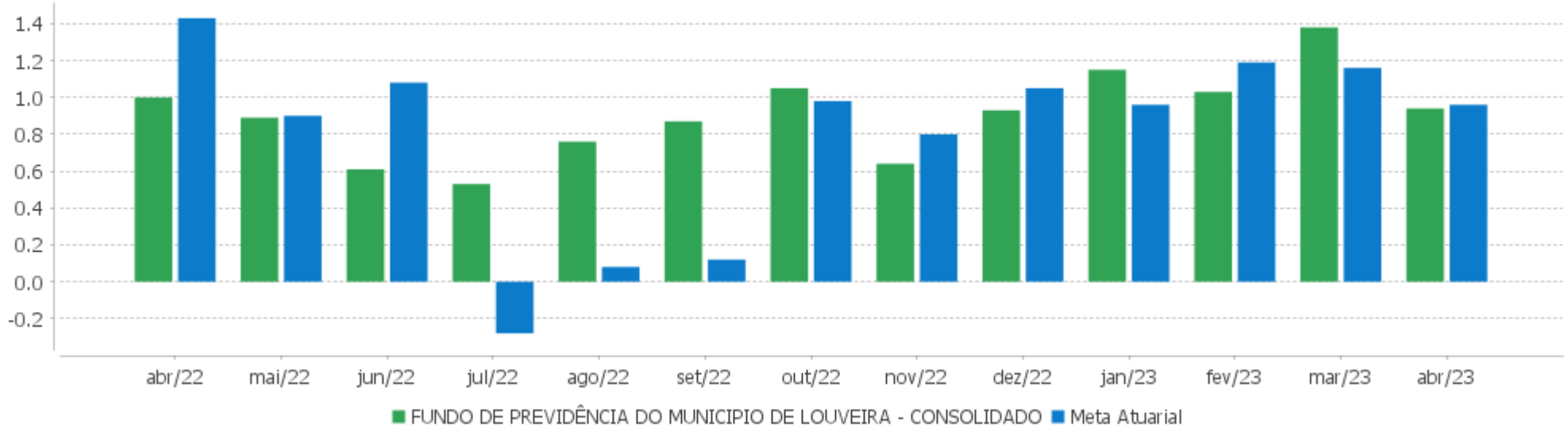


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



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%)	1,04	4,86	3,59	3,84	4,68		
Var. IPCA p.p.	0,43	2,14	1,41	0,06	0,50		
NTN-B 150830 (5,900000%)	1,01	4,72	3,49	6,78	7,54		
Var. IPCA p.p.	0,40	2,01	1,32	3,01	3,35		
NTN-B 150840 (5,720000%)	0,99	4,67	3,45	6,69	7,42		
Var. IPCA p.p.	0,38	1,95	1,27	2,92	3,23		
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,99	4,67	3,45	6,70	7,41		
Var. IPCA p.p.	0,38	1,95	1,28	2,92	3,23		
NTN-B 150535 (5,810000%)	1,00	4,69	3,47	6,74	7,50		
Var. IPCA p.p.	0,39	1,98	1,29	2,96	3,32		
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,84	4,19	3,08	6,37	13,15	19,36	21,81
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,04	-0,01	-0,08	-0,16	-0,34	-0,68
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,89	5,25	3,82	5,85	9,56	19,64	29,96
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,08	-0,05	-0,11	-0,11	-0,40	-0,78
BB PREV RF IDKA2	0,68	5,08	3,59	5,66	9,03	19,21	30,17
Var. IDKA 2 p.p.	-0,04	-0,38	-0,37	-0,27	-0,32	-0,27	-0,56
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,83	4,11	3,02	6,27	12,98	19,04	21,35
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,12	-0,08	-0,18	-0,33	-0,65	-1,13
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,89	5,25	3,83	5,83	9,44	19,39	29,70
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,07	-0,05	-0,14	-0,23	-0,65	-1,05
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,72	5,12	3,66	5,66	8,88	18,78	29,58
Var. IDKA 2 p.p.	0,00	-0,34	-0,30	-0,27	-0,47	-0,70	-1,15
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,84	4,08	2,94	6,25	13,24	21,42	23,43
% do CDI	91,47	97,28	96,52	97,01	98,97	100,10	97,59
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,89	4,15	3,00	6,36	13,29	21,41	23,59
% do CDI	96,79	98,84	98,57	98,65	99,39	100,06	98,25
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,89	4,13	2,98	6,35	13,31	21,31	23,49
% do CDI	96,70	98,28	98,11	98,51	99,52	99,60	97,86
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,88	5,22	3,81	5,81	9,28	18,96	28,64
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,03	-0,11	-0,07	-0,15	-0,40	-1,08	-2,11
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,90	4,13	2,97	6,46	13,74	22,51	25,39
% do CDI	97,64	98,39	97,66	100,26	102,74	105,21	105,78
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,89	4,09	2,93	6,33	13,37	21,75	24,49

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	96,61	97,37	96,39	98,26	99,98	101,66	102,03
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,27	1,51	0,70	2,94	10,12	16,76	20,35
% do CDI	29,27	35,89	23,16	45,69	75,69	78,34	84,77
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	1,22	4,75	4,09	5,41	11,05	15,74	21,55
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,03	-0,17	-0,11	-0,26	-0,55	-1,39	-0,98
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,99	5,72	5,27	1,64			
Var. S&P 500 p.p.	1,12	1,64	4,97	-0,79			
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO	0,94	4,57	3,38	6,21	11,32		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,03	0,20	0,02	-0,11	1,87		
CDI	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00
IBOVESPA	2,50	-4,83	-7,93	-10,00	-3,19	-12,16	29,72
INPC + 6,00%	0,95	4,36	3,35	6,51	10,04	31,15	49,50
IPCA + 6,00%	1,03	4,66	3,58	6,77	10,41	31,20	48,41

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF IDKA2	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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
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

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	0,86	4,23	3,10	6,45	13,31	19,69	22,48	30,57	39,29
IRF-M 1+	1,25	5,54	4,78	5,72	13,07	11,85	13,45	29,25	42,72
IRF-M TOTAL	1,10	5,03	4,16	5,88	12,91	14,29	16,50	30,13	42,22
IMA-B 5	0,90	5,33	3,87	5,96	9,67	20,04	30,74	42,08	56,20
IMA-B 5+	3,03	6,75	8,11	4,24	8,12	8,09	19,22	29,32	55,37
IMA-B TOTAL	2,02	6,08	6,08	5,03	8,78	13,88	24,89	36,05	57,25
IMA-GERAL TOTAL	1,25	4,92	4,19	5,67	11,60	17,13	22,53	32,91	46,34
IDKA 2	0,71	5,45	3,96	5,94	9,35	19,48	30,73	42,00	55,36
IDKA 20	5,47	7,81	12,99	2,04	6,65	-2,92	10,29	16,48	51,43
CDI	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00	30,46	38,73

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,50	-4,83	-7,93	-10,00	-3,19	-12,16	29,72	8,38	21,27
IBRX 100	1,93	-5,48	-8,69	-10,82	-4,80	-14,46	29,37	9,81	24,02
IBRX 50	1,64	-6,25	-9,32	-10,64	-4,09	-13,15	33,26	8,75	20,30
SMALL CAP	1,91	-7,78	-10,40	-20,60	-19,88	-36,55	-1,08	-5,63	4,75
Índice Consumo - ICON	0,89		-14,39	-28,45	-27,26	-49,56	-34,81	-34,15	-28,37
Índice Dividendos - IDIV	3,89	-0,36	-5,90	-1,19	2,52	6,38	45,77	35,30	60,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-0,13	4,08	0,30	2,43	2,58	-7,71	31,92	79,40	126,19

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	3,52	-0,31	1,31	-4,45	1,61	-0,10	9,78	13,94	22,29

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,32	3,70	-0,93	6,26	1,87	-13,63	23,38	58,18	84,61

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,61	2,72	2,18	3,78	4,18	16,82	24,72	27,71	34,02
INPC	0,53	2,42	1,95	3,52	3,83	16,78	25,64	28,73	35,27
IGPM	-0,95	-0,75	-0,96	-0,87	-2,17	12,18	48,09	57,99	71,65
SELIC	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00	30,46	38,74

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,89	4,02	3,12	5,78	8,34	26,32	40,21	49,34	62,93
IPCA + 5,00%	0,96	4,34	3,35	6,28	9,37	28,75	44,27	55,14	70,88
IPCA + 5,50%	1,00	4,50	3,46	6,53	9,89	29,97	46,33	58,11	74,98
IPCA + 5,89%	1,02	4,62	3,55	6,72	10,30	30,93	47,95	60,46	78,22
IPCA + 6,00%	1,03	4,66	3,58	6,77	10,41	31,20	48,41	61,12	79,14
INPC + 4,00%	0,81	3,72	2,89	5,52	7,97	26,27	41,24	50,53	64,44
INPC + 6,00%	0,95	4,36	3,35	6,51	10,04	31,15	49,50	62,41	80,81

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150535 (5,810000%)	42.721.629,93	5,810000	42.161.199,06	5,964000	-560.430,87
NTN-B 150535 (6,310000%)	15.772.079,15	6,310000	16.206.729,37	5,964000	434.650,22
NTN-B 150545 (5,730000%)	78.194.466,29	5,730000	75.624.168,09	6,015800	-2.570.298,20
NTN-B 150830 (5,900000%)	20.642.579,16	5,900000	20.783.882,23	5,769200	141.303,07
NTN-B 150840 (5,720000%)	54.202.525,40	5,720000	52.692.581,44	5,988800	-1.509.943,96

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
81	03/04/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.700,00	607,41560063	2,7987427360
82	06/04/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	66.266,76	23.641,78875695	2,8029503470
77	06/04/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	365.799,59	74.450,42680821	4,9133310000
73	06/04/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	111.626,30	22.719,06777703	4,9133310000
74	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	72.460,84	0,00	14.732,66999812	4,9183780000
78	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.170,38	0,00	2.879,79680601	4,9206180000
79	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.031,37	0,00	818,53915440	4,9250790000
83	17/04/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	176.973,25	0,00	62.956,45804423	2,8110420360
71	17/04/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.451.572,35	0,00	162.233,44785580	15,1113866000
80	17/04/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	761.524,34	154.554,28193007	4,9272290000
75	17/04/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	984.635,88	0,00	199.835,62363349	4,9272290000
84	18/04/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.039,93	3.925,42343388	2,8124176120
85	20/04/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.810,60	2.419,23459835	2,8151879130
76	27/04/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.898.225,82	125.191,69478435	15,1625539000
	Total		**3.703.844,07**	**3.222.993,34**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% — **Value-At-Risk (R$): 832.685,29** — **Value-At-Risk: 0,19%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO		0,19	0,19			435.066.135,30	100,00

Renda Fixa — **Value-At-Risk: 0,13%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,810000%)		0,14	0,01	0,15			42.721.629,93	9,82
NTN-B 150535 (6,310000%)		0,07	0,00	0,10			15.772.079,15	3,63
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,14	0,01	0,16			78.194.466,29	17,97
NTN-B 150830 (5,900000%)		0,16	0,00	0,17			20.642.579,16	4,74
NTN-B 150840 (5,720000%)		0,15	0,01	0,17			54.202.525,40	12,46
Sub-total	0,23	0,12	0,02		0,36	1,00	211.533.279,93	48,62

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI		0,01	0,00	0,01			9.918.108,05	2,28
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	-0,00	0,02			33.787.614,86	7,77
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,25	0,00	0,34			1.516.286,73	0,35
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,24	0,00	0,03			11.820.406,69	2,72
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,94	0,01	0,01			3.229.973,67	0,74
BB PREV RF IDKA2		1,06	0,00	0,14			2.303.062,43	0,53
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,16	0,00	0,16			1.803.174,26	0,41
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,94	0,01	0,02			4.368.739,62	1,00
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			10.839.610,19	2,49
Sub-total	0,26	0,17	0,02		-0,27	0,85	79.586.976,50	18,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		1,20	0,01	0,02			5.800.805,94	1,33
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			32.013.118,16	7,36
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		0,93	0,05	0,07			29.795.793,38	6,85
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			69.217.278,45	15,91
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,58	0,00	0,58			1.003.478,88	0,23
Sub-total	0,34	0,25	0,06		-0,06	0,90	137.830.474,81	31,68

Investimentos Estruturados — **Value-At-Risk: 7,33%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		7,33	0,08	12,19			6.115.404,06	1,41
Sub-total	7,92	7,33	0,08		0,01	0,99	6.115.404,06	1,41