



LDB
EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA -
JUNHO 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 30.06.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

98,49%

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%)	0,52	0,04	0,46	6,23	42.125.537,74	9,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,310000%)	3,01	0,02	0,50	6,48	15.545.755,35	3,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,55	-0,02	0,45	6,20	77.130.046,99	17,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,900000%)	3,01	0,02	0,47	6,28	20.949.090,57	4,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,720000%)	2,97	0,01	0,45	6,19	54.991.838,62	12,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,46	0,01	0,46	6,23	210.742.269,27	47,31

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 SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,05	1,08	6,48	10.139.599,62	2,28	39.378.624.159,13	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,06	1,13	6,55	34.355.425,68	7,71	14.603.622.203,04	0,24
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,37	0,06	1,15	6,57	1.550.870,22	0,35	307.873.930,44	0,50
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,40	0,22	1,03	0,98	3.901.316,44	0,88	1.469.266.924,84	0,27
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,07	1,16	6,49	12.091.462,52	2,71	6.781.214.720,11	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,39	0,22	1,03	7,00	3.283.869,25	0,74	8.254.253.931,25	0,04
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,60	0,17	1,02	6,56	2.335.587,93	0,52	6.483.473.627,64	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,17	1,04	6,60	1.828.553,09	0,41	5.947.143.642,03	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,41	0,23	1,03	6,99	4.440.742,91	1,00	5.638.426.224,35	0,08
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,05	1,07	6,41	11.077.796,68	2,49	5.492.803.682,31	0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,94	0,09	1,10	6,57	85.005.224,34	19,08		

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	2,54	0,37	1,76	8,45	8.778.173,52	1,97	180.310.422,35	4,87
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,09	6,44	32.872.241,72	7,38	14.982.085.274,92	0,22
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,42	0,23	1,03	6,94	33.295.771,73	7,48	963.196.862,82	3,46
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	1,13	6,53	66.955.669,41	15,03	8.773.662.957,45	0,76
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,35	0,13	1,49	4,61	1.034.152,99	0,23	409.971.559,82	0,25
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,19	0,11	1,14	6,81	142.936.009,37	32,09		
Renda Fixa			0,81	0,06	0,80	6,48	438.683.502,98	98,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,51%

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	15,55	0,93	6,03	16,39	6.733.019,58	1,51	45.784.533,44	14,71
Sub-total Artigo 10º I			15,55	0,93	6,03	16,39	6.733.019,58	1,51		
Investimentos Estruturados			12,82	0,93	6,03	16,39	6.733.019,58	1,51		
Total			0,86	0,07	0,88	6,62	445.416.522,56	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	210.742.269,27	47,31	0,00	43,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	85.005.224,34	19,08	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	142.936.009,37	32,09	0,00	26,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	438.683.502,98	98,49					100,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	6.733.019,58	1,51	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	6.733.019,58	1,51					15,00
Total		445.416.522,56	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	0,46 42,89	6,23 95,88	2,48 78,94	6,23 95,88		964.554,68	12.589.445,05
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,10 102,77	6,57 101,07	3,03 96,46	6,57 101,07	12,08 89,17	925.590,29	5.467.059,03
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,14 106,11	6,81 104,77	3,12 99,21	6,81 104,77	11,79 87,03	1.613.886,87	8.458.797,14
Artigo 10º I % do CDI	6,03 562,15	16,39 252,27	11,19 355,64	16,39 252,27	16,38 120,93	382.680,18	948.332,76
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						3.886.712,02	27.463.633,98

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%)	41.932.649,13	0,00	0,00	0,00	42.125.537,74	192.888,61	2.532.165,03
NTN-B 150535 (6,310000%)	15.468.438,52	0,00	0,00	0,00	15.545.755,35	77.316,83	970.268,29
NTN-B 150545 (5,730000%)	76.781.272,83	0,00	0,00	0,00	77.130.046,99	348.774,16	4.608.945,46
NTN-B 150830 (5,900000%)	20.851.621,97	0,00	0,00	0,00	20.949.090,57	97.468,60	1.247.467,12
NTN-B 150840 (5,720000%)	54.743.732,14	0,00	0,00	0,00	54.991.838,62	248.106,48	3.230.599,15
					210.742.269,27	964.554,68	

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	2.312.016,87	0,00	0,00	0,00	2.335.587,93	23.571,06	143.826,27
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.395.429,82	0,00	0,00	0,00	4.440.742,91	45.313,09	411.138,33
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.952.977,76	0,00	0,00	0,00	12.091.462,52	138.484,76	894.263,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.809.673,37	0,00	0,00	0,00	1.828.553,09	18.879,72	113.176,11
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.250.340,29	0,00	0,00	0,00	3.283.869,25	33.528,96	216.435,41

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	34.082.617,30	1.155.296,52	-1.264.814,59	0,00	34.355.425,68	382.326,45	1.984.029,21
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	10.031.181,88	0,00	0,00	0,00	10.139.599,62	108.417,74	511.002,47
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.861.360,48	0,00	0,00	0,00	3.901.316,44	39.955,96	131.820,34
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	1.533.240,93	0,00	0,00	0,00	1.550.870,22	17.629,29	122.267,65
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	10.960.313,42	0,00	0,00	0,00	11.077.796,68	117.483,26	667.721,76
					85.005.224,34	925.590,29	

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	32.448.722,60	176.973,25	-108.021,94	0,00	32.872.241,72	354.567,81	1.584.225,80
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	68.198.928,04	200.000,00	-2.214.757,36	0,00	66.955.669,41	771.498,73	3.992.969,32
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	32.956.003,09	0,00	0,00	0,00	33.295.771,73	339.768,64	2.250.743,49
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	5.902.149,03	2.743.106,22	0,00	0,00	8.778.173,52	132.918,27	583.555,19
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1.019.019,57	0,00	0,00	0,00	1.034.152,99	15.133,42	45.570,47
					142.936.009,37	1.613.886,87	

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	6.350.339,40	0,00	0,00	0,00	6.733.019,58	382.680,18	948.332,76
					6.733.019,58	382.680,18	

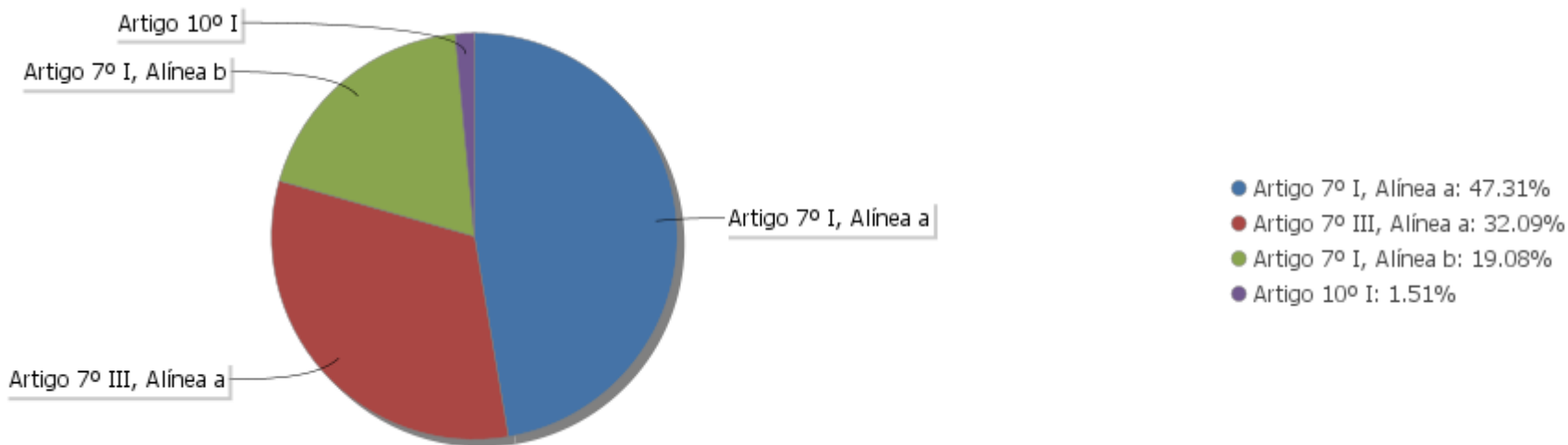
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

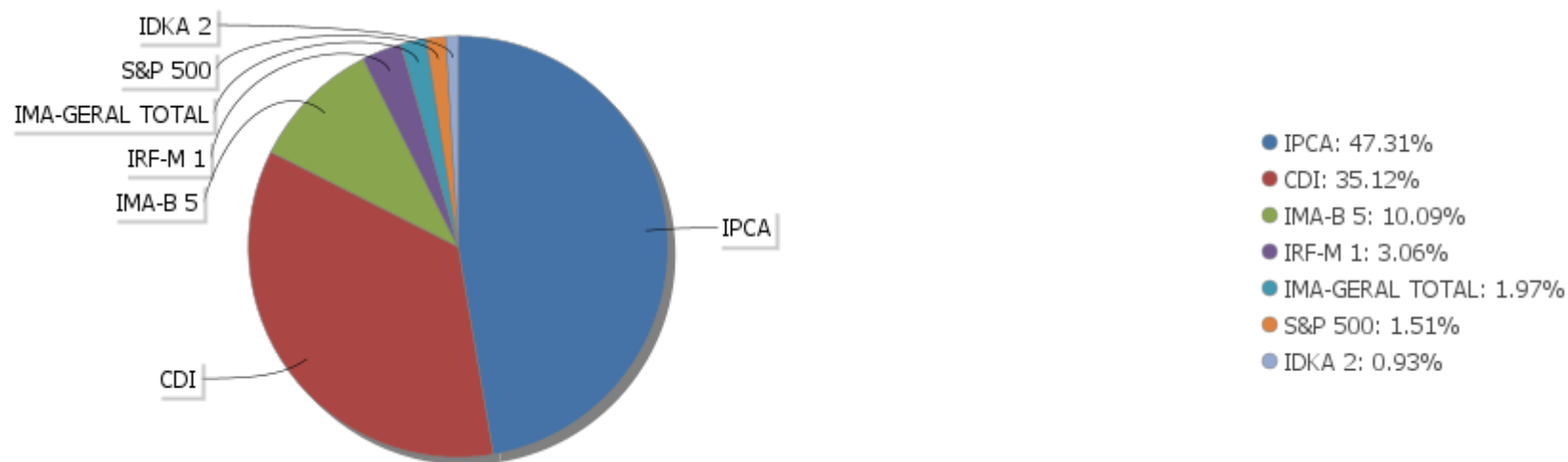
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	227.941.233,71	51,17	227.941.233,71	51,17	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	227.941.233,71	51,17	
acima de 365 dias	217.475.288,85	48,83	445.416.522,56	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

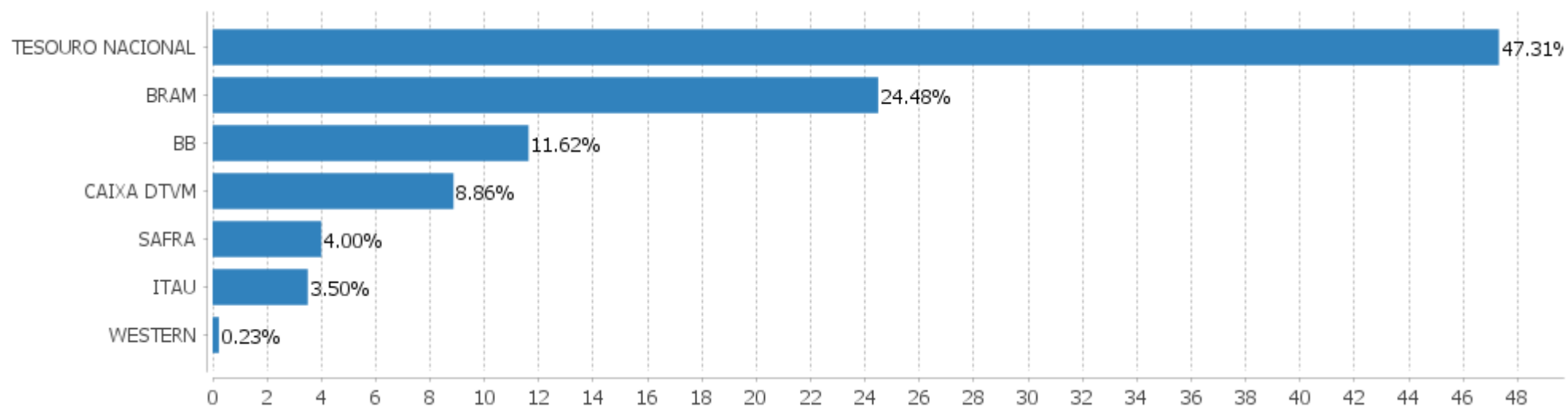


Alocação Por Estratégia



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	1,03	1,38	0,94	1,07	0,88							6,62
IPCA + 5,08%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,66	0,33							5,41
p.p. indexador	0,18	-0,17	0,21	-0,03	0,40	0,55							1,21
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

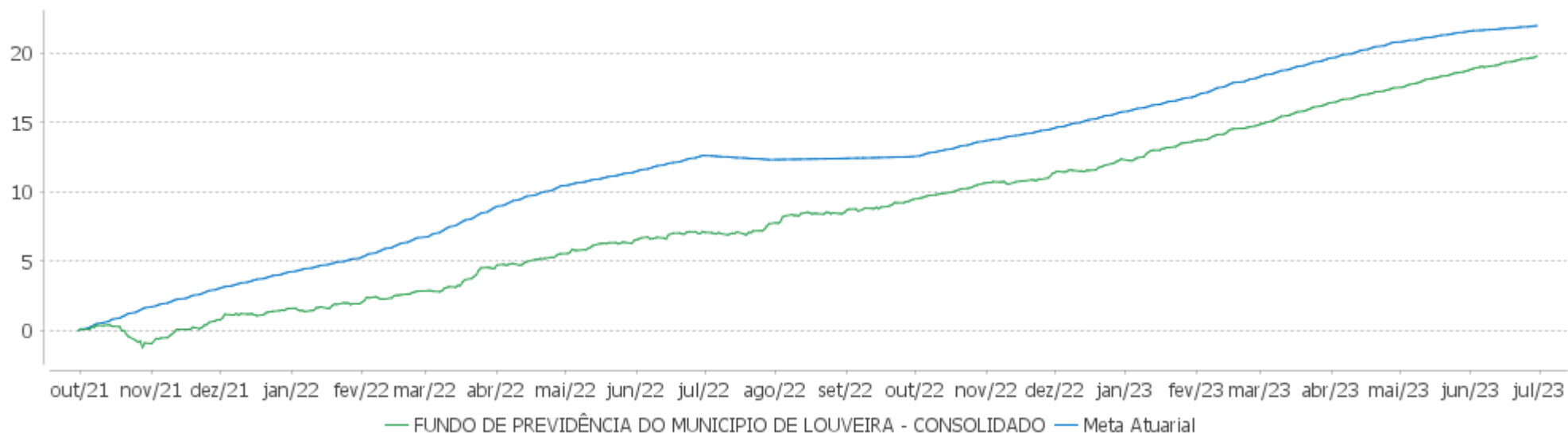
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	42,86	03 meses	2,92	1,98	0,94	0,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	57,14	06 meses	6,62	5,41	1,21	0,49
			12 meses	11,82	8,34	3,48	0,86
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11	Desde 30/09/2021	19,78	22,29	-2,51	1,26
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

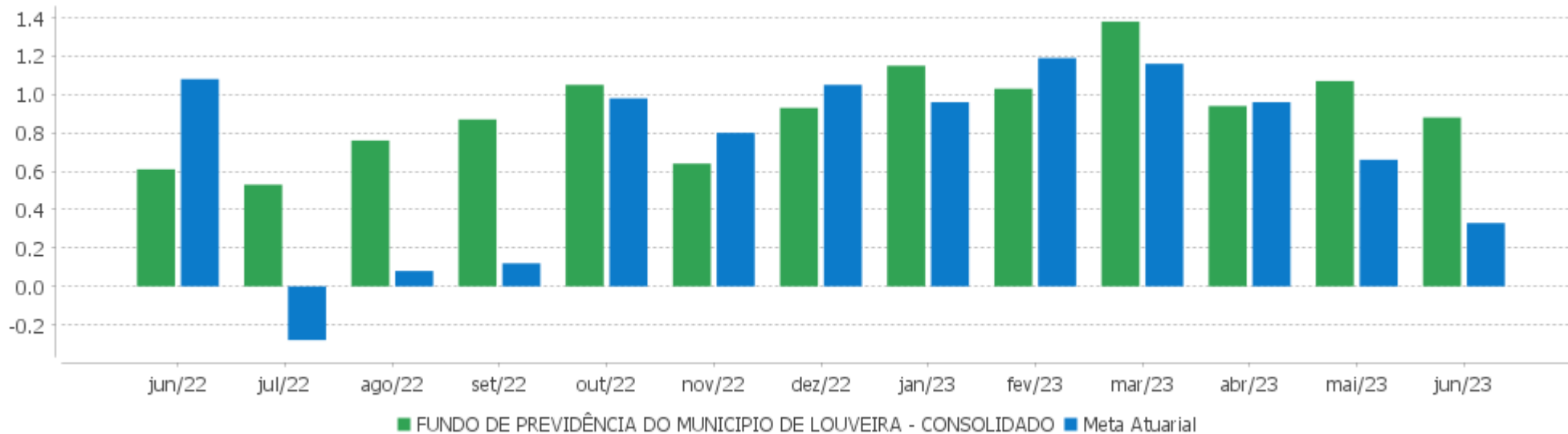


Patrimônio Líquido



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.	0,50 0,58	6,48 3,61	2,60 1,84	6,48 3,61	6,80 3,64		
NTN-B 150830 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,28 3,41	2,51 1,75	6,28 3,41	6,49 3,33	18,99 3,57	
NTN-B 150840 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,19 3,32	2,46 1,70	6,19 3,32	6,37 3,21	18,82 3,40	
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,20 3,32	2,47 1,70	6,20 3,32	9,40 6,24	22,23 6,81	
NTN-B 150535 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,23 3,36	2,48 1,72	6,23 3,36	9,55 6,39	22,38 6,95	
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,15 -0,04	6,57 -0,11	3,14 -0,08	6,57 -0,11	13,60 -0,22	21,58 -0,42	23,74 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	7,00 -0,04	2,57 0,02	7,00 -0,04	10,18 -0,05	21,01 -0,30	28,00 -0,68
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,94 -0,10	2,50 -0,04	6,94 -0,10	10,04 -0,19	20,89 -0,43	27,91 -0,77
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,02 0,05	6,56 -0,22	2,10 0,11	6,56 -0,22	9,43 0,15	20,20 -0,12	27,87 -0,96
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,49 -0,18	3,14 -0,08	6,49 -0,18	13,48 -0,34	21,33 -0,67	23,34 -1,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,99 -0,05	2,56 0,01	6,99 -0,05	10,05 -0,18	20,76 -0,56	27,74 -0,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,04 0,07	6,60 -0,19	2,14 0,15	6,60 -0,19	9,23 -0,05	19,78 -0,54	27,45 -1,38
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,13 105,24	6,55 100,75	3,23 102,54	6,55 100,75	13,52 99,84	23,55 100,78	25,75 98,41
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	1,08 100,82	6,48 99,65	3,14 99,87	6,48 99,65	13,47 99,46	23,38 100,02	25,80 98,61
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	1,07 99,99	6,41 98,70	3,10 98,70	6,41 98,70	13,44 99,24	23,26 99,52	25,67 98,10
BRANDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,94 -0,10	2,52 -0,02	6,94 -0,10	9,94 -0,29	20,35 -0,97	26,59 -2,09
BRANDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,13	6,53	3,22	6,53	13,87	24,53	27,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	105,64	100,53	102,48	100,53	102,45	104,96	105,26
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,09	6,44	3,16	6,44	13,54	23,74	26,65
% do CDI	101,92	99,04	100,55	99,04	99,98	101,59	101,82
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,49	4,61	3,33	4,61	11,11	19,58	22,25
% do CDI	138,54	70,93	105,98	70,93	82,07	83,80	85,02
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	1,76	8,45	4,79	8,45	13,60	18,69	23,11
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,02	-0,18	-0,04	-0,18	-0,41	-1,42	-1,25
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	6,03	16,39	11,19	16,39			
Var. S&P 500 p.p.	5,33	9,34	8,46	9,34			
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO	0,88	6,62	2,92	6,62	11,82		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,55	1,21	0,94	1,21	3,44		
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

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

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,810000%)	42.125.537,74	5,810000	44.175.834,67	5,229500	2.050.296,93
NTN-B 150535 (6,310000%)	15.545.755,35	6,310000	16.981.153,59	5,229500	1.435.398,24
NTN-B 150545 (5,730000%)	77.130.046,99	5,730000	79.699.424,78	5,459700	2.569.377,79
NTN-B 150830 (5,900000%)	20.949.090,57	5,900000	21.850.719,23	5,132700	901.628,66
NTN-B 150840 (5,720000%)	54.991.838,62	5,720000	57.010.557,91	5,371900	2.018.719,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
121	01/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.120,00	3.193,14493852	2,8561183960
122	01/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.416,12	1.896,32194785	2,8561183960
128	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	372.222,10	74.194,01519870	5,0168750000
111	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	109.845,80	21.895,26348574	5,0168750000
123	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	69.011,59	24.125,07033173	2,8605757020
129	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.170,38	0,00	2.820,28200073	5,0244550000
112	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.992,45	0,00	595,57703273	5,0244550000
113	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	77.284,26	0,00	15.374,79976859	5,0266840000
130	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.562,48	0,00	907,16946378	5,0293580000
105	15/06/2023	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2.706.518,30	0,00	516.510,12053373	5,2400102000
114	15/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.427,78	0,00	1.873,56667215	5,0319960000
124	15/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.834,30	2.381,74759207	2,8694476370
132	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	782.746,69	155.465,49475675	5,0348580000
106	16/06/2023	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	21.742,17	0,00	4.144,46956675	5,2460682000
115	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.011.837,25	0,00	200.966,39269668	5,0348580000
127	16/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	176.973,25	0,00	61.641,98201699	2,8709857180
116	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	35.021,92	0,00	6.952,12073715	5,0375880000
125	20/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.639,93	4.050,10296010	2,8739837270
107	22/06/2023	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	14.845,75	0,00	2.823,38914721	5,2581310000
126	26/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.000,00	2.083,42397457	2,8798747030
108	29/06/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	2.007.309,68	129.390,07220605	15,5136298000
110	30/06/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	200.000,00	0,00	12.886,60657350	15,5199896000
109	30/06/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	207.447,68	13.366,48318373	15,5199896000
Total			4.275.375,99	3.587.593,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 726.821,62

Value-At-Risk: 0,16%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO		0,16	0,16			445.416.522,56	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,810000%)		0,15	0,00	0,13			42.125.537,74	9,46
NTN-B 150535 (6,310000%)		0,14	0,00	0,12			15.545.755,35	3,49
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,15	0,01	0,14			77.130.046,99	17,32
NTN-B 150830 (5,900000%)		0,14	0,00	0,12			20.949.090,57	4,70
NTN-B 150840 (5,720000%)		0,15	0,01	0,13			54.991.838,62	12,35
Sub-total	0,38	0,14	0,03		-1,62	0,46	210.742.269,27	47,31

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			10.139.599,62	2,28
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	0,00	0,05			34.355.425,68	7,71
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,21	-0,00	0,30			1.550.870,22	0,35
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		0,90	0,01	0,01			3.901.316,44	0,88
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,21	0,00	0,01			12.091.462,52	2,71
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,91	0,01	0,03			3.283.869,25	0,74
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,00	0,15			2.335.587,93	0,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,98	0,00	0,15			1.828.553,09	0,41
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,92	0,01	0,03			4.440.742,91	1,00
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			11.077.796,68	2,49
Sub-total	0,38	0,20	0,03		0,08	1,10	85.005.224,34	19,08

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		0,84	0,01	0,07			8.778.173,52	1,97
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			32.872.241,72	7,38
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		0,80	0,05	0,13			33.295.771,73	7,48
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			66.955.669,41	15,03
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,59	0,00	0,59			1.034.152,99	0,23
Sub-total	0,53	0,23	0,06		0,12	1,14	142.936.009,37	32,09

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,45%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		5,45	0,05	9,01			6.733.019,58	1,51
Sub-total	8,35	5,45	0,05		0,59	6,03	6.733.019,58	1,51