



FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA -
MAIO 2022
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 31.05.2022.

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

RENTA FIXA

99,98%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,19	1,07	4,45	30.616.667,49	7,95	17.208.166.278,38	0,18
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,74	0,94	3,96	11.405.239,32	2,96	144.009.410,61	7,92
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,64	0,77	6,17	13.638.305,69	3,54	1.706.174.541,94	0,80
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	3,56	0,55	1,70	6.518.793,86	1,69	66.588.015,12	9,79
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,74	0,92	3,90	43.833.534,45	11,38	5.107.140.425,93	0,86
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	0,93	3,91	39.362.297,88	10,22	5.274.375.201,05	0,75
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,74	0,94	3,92	7.345.224,88	1,91	603.808.044,28	1,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,91	3,79	13.266.571,36	3,44	617.910.311,30	2,15
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,76	6,16	10.420.782,27	2,70	12.390.634.636,61	0,08
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,77	6,17	12.124.487,59	3,15	9.450.283.491,65	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,58	0,88	3,72	4.098.318,86	1,06	181.553.052,80	2,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,85	6,17	36.936.807,83	9,59	11.182.665.779,99	0,33
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,67	0,77	6,14	18.725.003,78	4,86	6.992.058.203,56	0,27
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,16	0,99	4,45	15.396.225,61	4,00	2.722.459.745,02	0,57
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,61	0,82	3,37	3.838.690,84	1,00	5.396.025.552,32	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,07	1,07	4,35	8.071.411,47	2,09	7.455.971.013,11	0,11
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,67	0,90	4,66	275.598.363,18	71,53		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,17	1,04	4,36	3.198.584,93	0,83	26.907.239.534,96	0,01
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,90	0,86	3,99	15.789.665,49	4,10	346.512.232,61	4,56
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,07	4,47	425.263,92	0,11	9.967.340.356,95	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,67	0,75	6,02	59.845.241,47	15,53	1.346.062.592,73	4,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	1,10	4,59	30.338.088,65	7,87	5.183.790.691,53	0,59
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,61	0,87	5,12	109.596.844,46	28,45		
Renda Fixa			1,69	0,89	4,80	385.195.207,64	99,98		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,02%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,30	0,92	4,85	92.832,63	0,02	2.642.815.913,12	0,00
Sub-total Artigo 10º I			3,30	0,92	4,85	92.832,63	0,02		
Investimentos Estruturados			2,98	0,92	4,85	92.832,63	0,02		
Total			1,69	0,89	4,80	385.288.040,27	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	275.598.363,18	71,53	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	109.596.844,46	28,45	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	385.195.207,64	99,98					100,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	92.832,63	0,02	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	92.832,63	0,02					15,00

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 b % do CDI	0,90 87,11	4,66 107,22	3,38 119,99	5,52 107,44		2.451.673,70	12.286.161,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,87 84,27	5,12 117,77	3,94 140,13			940.795,88	5.262.981,82
Artigo 10º I % do CDI	0,92 89,13	4,85 111,69	2,67 94,93			845,34	4.295,63
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						3.393.314,92	17.553.438,45

RESULTADO POR ATIVO

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 FIC FI	3.807.559,15	0,00	0,00	0,00	3.838.690,84	31.131,69	125.228,88
BB PREV RF IDKA2	12.031.245,74	0,00	0,00	0,00	12.124.487,59	93.241,85	705.058,10
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.062.440,93	0,00	0,00	0,00	4.098.318,86	35.877,93	146.948,59
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	18.581.943,85	0,00	0,00	0,00	18.725.003,78	143.059,93	1.082.434,03
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	43.433.256,20	0,00	0,00	0,00	43.833.534,45	400.278,25	1.644.841,37
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	7.277.011,93	0,00	0,00	0,00	7.345.224,88	68.212,95	276.852,53
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	36.624.337,72	0,00	0,00	0,00	36.936.807,83	312.470,11	2.148.049,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.386.970,30	909.249,27	-954.658,49	0,00	10.420.782,27	79.221,19	557.649,02
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.146.773,06	0,00	0,00	0,00	13.266.571,36	119.798,30	484.186,42
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.000.341,36	0,00	0,00	0,00	39.362.297,88	361.956,52	1.481.379,21
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.291.420,61	0,00	0,00	0,00	30.616.667,49	325.246,88	1.304.275,59
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	7.986.354,65	0,00	0,00	0,00	8.071.411,47	85.056,82	336.233,81
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	15.245.555,00	0,00	0,00	0,00	15.396.225,61	150.670,61	656.624,78
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	13.534.545,56	0,00	0,00	0,00	13.638.305,69	103.760,13	792.944,15
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	6.483.005,35	0,00	0,00	0,00	6.518.793,86	35.788,51	108.979,77
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	11.299.337,29	0,00	0,00	0,00	11.405.239,32	105.902,03	434.474,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					275.598.363,18	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\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	329.862,84	150.358,14	-58.008,68	0,00	425.263,92	3.051,62	7.254,36
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	31.048.813,98	351.071,45	-1.402.709,07	0,00	30.338.088,65	340.912,29	1.271.535,93
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	57.678.356,76	1.737.502,08	0,00	0,00	59.845.241,47	429.382,63	3.245.404,48
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	15.655.116,54	0,00	0,00	0,00	15.789.665,49	134.548,95	605.265,90
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	3.165.684,54	0,00	0,00	0,00	3.198.584,93	32.900,39	133.521,15
					109.596.844,46	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	91.987,29	0,00	0,00	0,00	92.832,63	845,34	4.295,63
					92.832,63	0,00	0,00

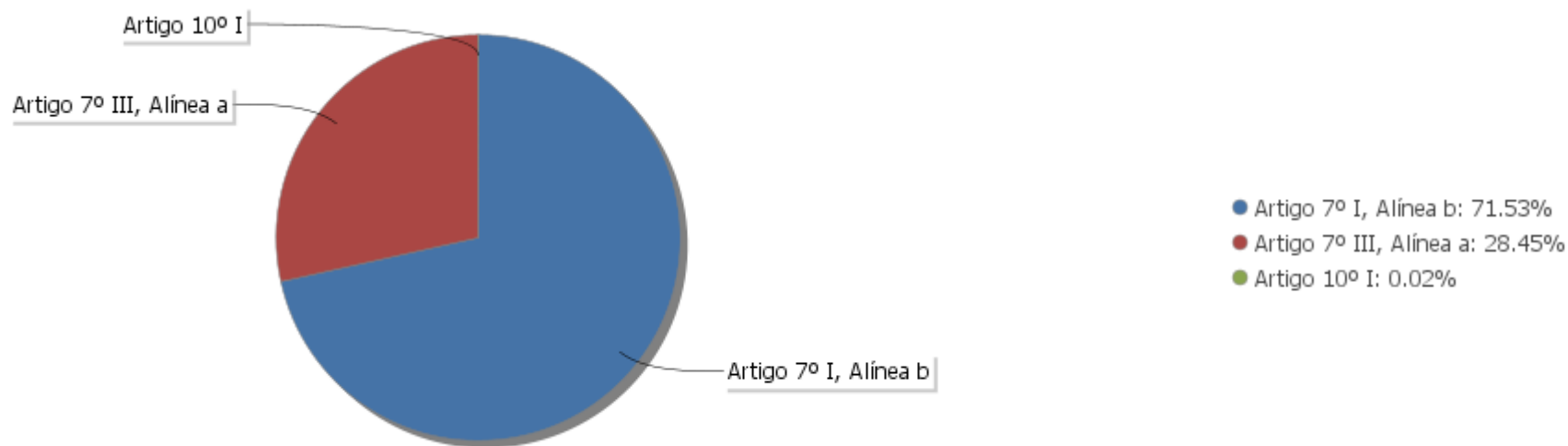
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

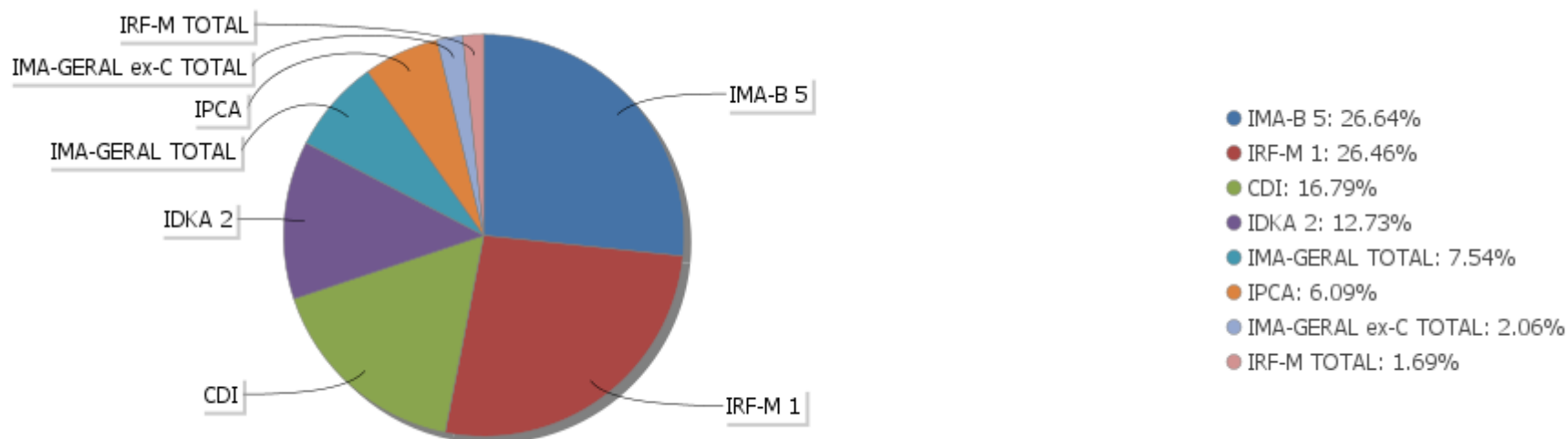
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	385.288.040,27	100,00	385.288.040,27	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	385.288.040,27	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	385.288.040,27	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

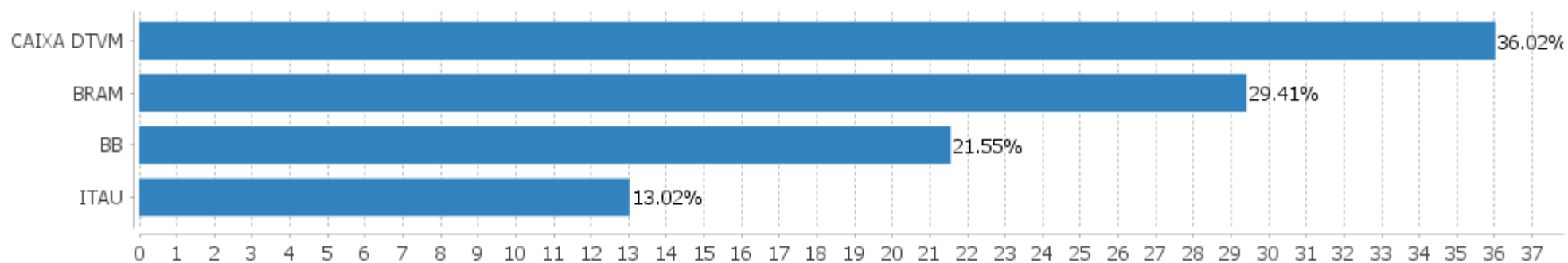


Alocação Por Estratégia



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
2022	0,33	0,89	1,61	1,00	0,89								4,80
IPCA + 5,00%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90								6,90
p.p. indexador	-0,62	-0,49	-0,45	-0,43	-0,01								-2,09
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

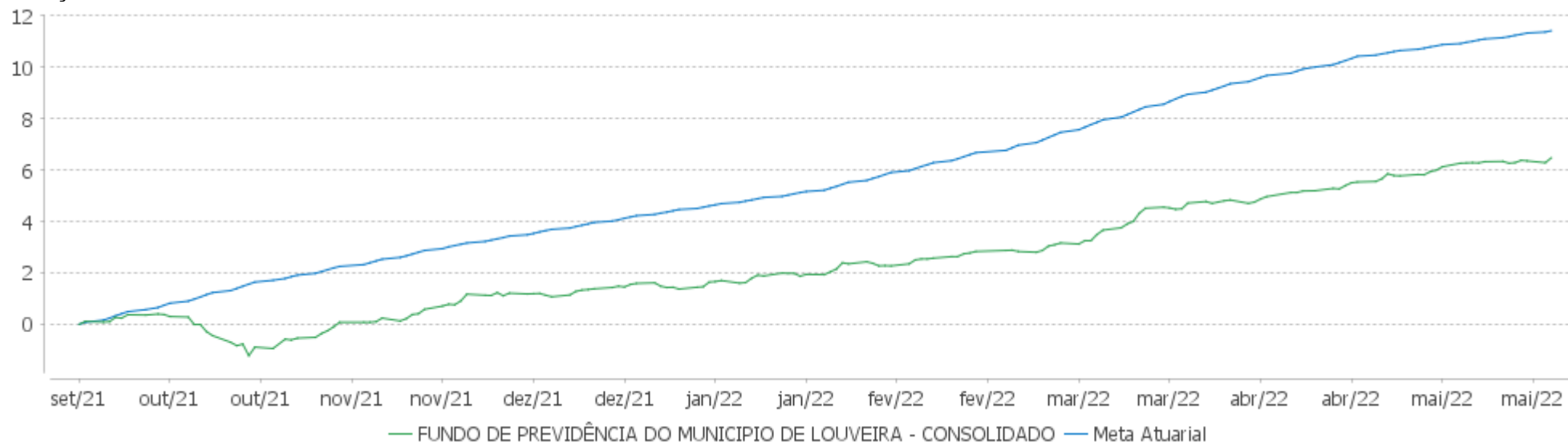
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

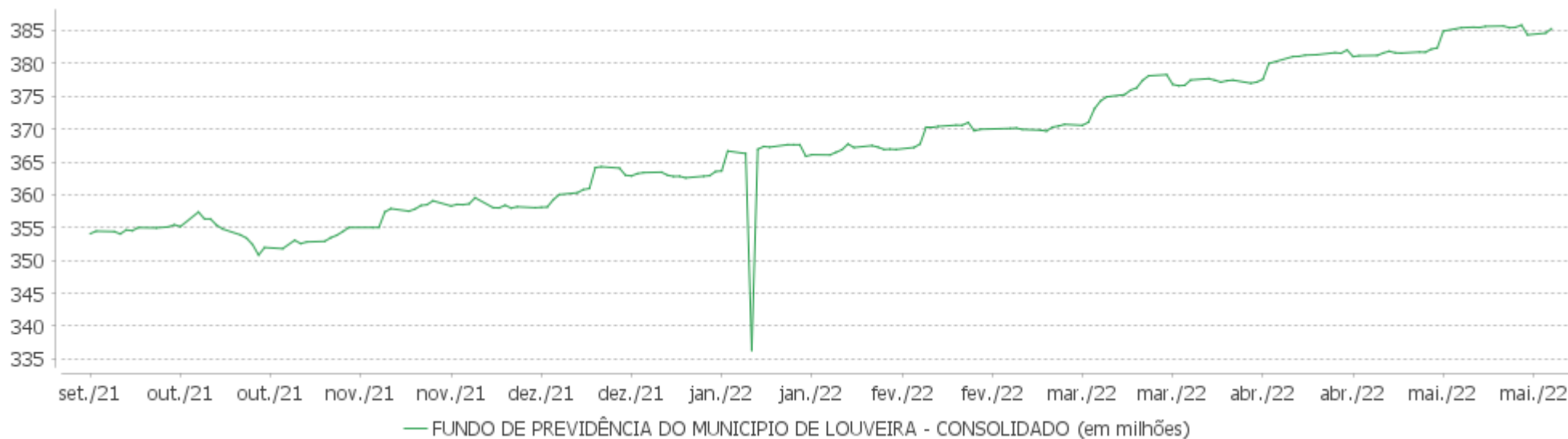
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	1	12,50	03 meses	3,54	4,45	-0,91	1,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	7	87,50	06 meses	5,65	8,25	-2,60	1,32
			12 meses				
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11	Desde 30/09/2021	6,47	11,67	-5,20	1,69
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

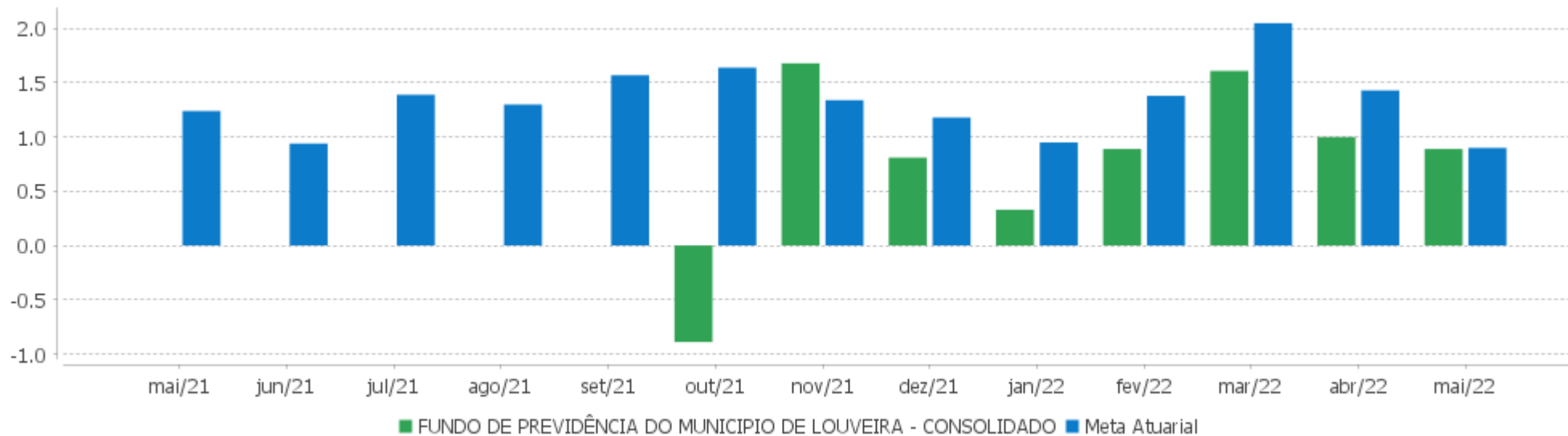


Patrimônio Líquido



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
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,94 -0,01	3,96 -0,06	2,52 -0,08	4,83 -0,10	6,27 -0,15	8,23 -0,44	14,81 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	6,16 -0,10	4,96 -0,06	6,97 -0,12	9,31 -0,24	17,06 -0,59	27,78 -1,00
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	6,17 -0,08	4,97 -0,05	6,99 -0,10	9,35 -0,21	17,11 -0,54	28,01 -0,76
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,03	3,90 -0,12	2,51 -0,10	4,78 -0,16	6,14 -0,29	7,98 -0,69	14,50 -1,04
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,01	6,14 -0,12	4,95 -0,07	6,94 -0,15	9,18 -0,37	16,95 -0,70	27,79 -0,99
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,07 104,14	4,45 102,43	2,73 96,84	5,26 102,34	8,07 102,22	9,89 96,56	15,30 97,91
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,91 -0,00	3,79 -0,25	3,01 -0,05	4,76 -0,18	4,92 -0,34	8,40 -1,29	16,17 -1,83
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,99 0,52	4,45 -0,33	2,96 -0,22	5,35 -0,20	8,41 -3,32	10,30 -10,43	18,95 -4,05
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,77 -0,08	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,92 -0,30	9,45 0,21	17,95 -0,54	27,46 -1,73
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,55 -0,03	1,70 -0,12	1,22 -0,09	3,57 -0,17	1,34 -0,26	1,85 -0,48	13,11 -0,79
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,94 -0,01	3,92 -0,10	2,51 -0,10	4,80 -0,13	6,24 -0,19	8,04 -0,63	14,54 -1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,82	3,37	2,70	4,32	3,78	7,35	15,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,07 0,60	4,35 -0,44	2,83 -0,35	5,21 -0,34	3,49 -8,24	7,06 -13,67	19,89 -3,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,85 0,00	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,94 -0,29	9,11 -0,13	17,79 -0,70	27,49 -1,70
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 -0,02	3,91 -0,11	2,54 -0,07	4,79 -0,14	6,18 -0,25	8,19 -0,48	14,80 -0,74
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,88	3,72	2,95	4,67	4,81	8,00	15,67
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,75	6,02	4,85	6,84	9,01	16,08	27,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,04	-0,23	-0,17	-0,25	-0,54	-1,57	-1,74
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,10 106,28	4,59 105,56	2,93 104,02	5,43 105,69	8,57 108,59	11,10 108,36	15,66 100,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,07 103,41	4,47 102,93	2,84 100,83	5,31 103,21	8,23 104,30	10,70 104,45	15,42 98,68
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	1,04 100,80	4,36 100,28	2,74 97,49	5,14 100,08	7,97 100,92	9,97 97,34	15,15 96,93
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,86 -0,06	3,99 -0,05	3,07 0,02	4,80 -0,14	4,48 -0,78	9,14 -0,55	17,54 -0,47
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	0,92 89,13	4,85 111,69	2,67 94,93	6,36 123,63	2,97 37,67	12,65 123,47	20,97 134,20
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,89 -0,01	4,80 -2,09	3,54 -0,91	5,65 -2,50			
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA 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 IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	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 CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA 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 INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
76	04/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	58.008,68	23.271,94623900	2,4926441220
74	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	306.299,31	85.921,49680466	3,5648740000
72	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	90.664,30	25.432,68008911	3,5648740000
69	13/05/2022	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	351.071,45	0,00	26.191,40073177	13,4040731000
71	13/05/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1.737.502,08	0,00	770.256,25452871	2,2557455000
70	27/05/2022	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.402.709,07	104.133,10585095	13,4703470000
77	30/05/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	150.358,14	0,00	59.793,72496400	2,5146140350
75	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	557.694,88	156.411,97671832	3,5655510000
73	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	909.249,27	0,00	255.009,46978461	3,5655510000
Total			3.148.180,94	2.415.376,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.425.479,18

Value-At-Risk: 0,63%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO		0,63	0,63			385.288.040,27	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,63%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	0,00	0,05			30.616.667,49	7,95
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,30	0,00	0,38			11.405.239,32	2,96
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,09	0,04	0,00			13.638.305,69	3,54
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI		1,57	0,02	0,01			6.518.793,86	1,69
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,31	0,02	0,01			43.833.534,45	11,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,02	0,01			39.362.297,88	10,22
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,31	0,00	0,01			7.345.224,88	1,91
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,03	0,07			13.266.571,36	3,44
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,08	0,03	0,02			10.420.782,27	2,70
BB PREV RF IDKA2		1,26	0,04	0,25			12.124.487,59	3,15
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,01	0,01	1,01			4.098.318,86	1,06
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,13	0,33			36.936.807,83	9,59
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,05	0,03			18.725.003,78	4,86
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		0,29	0,01	0,30			15.396.225,61	4,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,01	0,01	1,01			3.838.690,84	1,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,54	0,01	0,55			8.071.411,47	2,09
Sub-total	1,07	0,59	0,42		-0,12	0,90	275.598.363,18	71,53

Artigo 7º III, Alínea a

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO
DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI		0,03	0,00	0,02			3.198.584,93	0,83
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		1,06	0,04	0,07			15.789.665,49	4,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			425.263,92	0,11
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,12	0,17	0,05			59.845.241,47	15,53
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,04	0,00	0,02			30.338.088,65	7,87
Sub-total	1,45	0,74	0,21		-0,11	0,87	109.596.844,46	28,45

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,57%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,57	0,00	1,57			92.832,63	0,02
Sub-total	3,28	1,57	0,00		-0,03	0,92	92.832,63	0,02