



LDB
EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA -
OUTUBRO 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 31.10.2022.

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

RENDA FIXA

98,51%

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%)	4,04	0,07	0,46	0,46	41.186.693,75	10,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	3,98	0,01	0,51	0,51	75.376.510,15	18,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,720000%)	4,08	0,03	0,50	0,50	52.256.301,21	12,94
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,27	0,03	0,54	0,54	168.819.505,11	41,82

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				
XP	BNY MELLON	TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,12	0,00	0,87	0,87	0,00	0,00	3.882.587.764,22	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,13	0,05	1,01	10,13	22.571.294,43	5,59	18.643.982.158,94	0,12
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,51	0,05	1,00	9,56	2.868.643,28	0,71	165.400.002,25	1,73
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,44	0,38	1,90	8,97	3.781.494,92	0,94	1.288.130.355,76	0,29
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51	0,06	0,98	9,45	20.764.909,66	5,14	6.033.726.634,06	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	0,06	0,99	9,45	3.787.403,35	0,94	5.646.338.902,14	0,07
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,51		0,84	9,33	0,00	0,00	545.734.533,05	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,41	0,30	1,07	8,67	3.044.064,51	0,75	520.384.913,07	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,43	0,38	1,88	9,05	4.411.810,51	1,09	8.449.071.998,91	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	0,37	1,85	8,72	2.179.617,72	0,54	7.996.820.457,76	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,31	0,29	1,06	8,63	4.292.196,51	1,06	165.254.104,28	2,60
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,37	1,83	8,48	1.706.503,99	0,42	8.108.886.938,29	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,45	0,38	1,89	8,92	8.980.862,01	2,22	6.120.033.935,05	0,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,80	0,39	0,88	9,36	786.024,91	0,19	2.434.245.468,97	0,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,23	0,29	1,01	7,77	4.002.165,20	0,99	4.560.818.666,19	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,59	0,13	0,99	9,36	714.271,85	0,18	5.839.461.409,01	0,01
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,12	0,05	1,02	4,53	10.192.568,23	2,52	3.431.042.897,91	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,26	0,16	1,19	9,08	94.083.831,08	23,31		

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				
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,12	0,05	1,03	10,02	3.372.098,63	0,84	29.823.149.034,12	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,50	0,30	0,99	8,62	10.386.057,44	2,57	221.384.019,07	4,69
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,12	0,05	1,04	10,21	7.010.456,12	1,74	12.427.649.222,70	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,46	0,38	1,84	8,68	37.847.925,35	9,38	1.078.455.317,88	3,51
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,12	0,05	1,07	10,52	43.483.469,11	10,77	7.181.883.753,28	0,61
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,94	0,00	0,00	0,00	32.660.896,12	8,09	763.174.985,26	4,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,55	0,20	1,32	9,05	134.760.902,77	33,38		
Renda Fixa			1,31	0,11	1,05	8,87	397.664.238,96	98,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,49%

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	3,45	0,34	0,28	0,28	6.016.588,26	1,49	40.912.800,18	14,71
Sub-total Artigo 10º I			3,45	0,34	0,28	8,17	6.016.588,26	1,49		
Investimentos Estruturados			2,84	0,34	0,28	8,17	6.016.588,26	1,49		
Total			1,31	0,11	1,05	8,87	403.680.827,22	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	168.819.505,11	41,82	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	94.083.831,08	23,31	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	134.760.902,77	33,38	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	397.664.238,96	98,51					100,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	6.016.588,26	1,49	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	6.016.588,26	1,49					15,00
Total		403.680.827,22	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	0,54 70,73	0,54 70,73				827.693,68	827.693,68
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,19 116,54	9,08 90,74	2,96 89,72	5,16 79,23	11,81 102,72	1.835.290,33	21.186.685,58
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,32 129,46	9,05 90,49	2,78 84,31	4,64 71,35		1.442.288,77	10.344.613,93
Artigo 10º I % do CDI	0,28 27,09	8,17 81,68	2,76 83,84	4,11 63,17		16.588,26	23.557,07
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						4.121.861,04	32.382.550,26

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%)	0,00	40.997.404,53	0,00	0,00	41.186.693,75	189.289,22	189.289,22
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,00	74.996.734,20	0,00	0,00	75.376.510,15	379.775,95	379.775,95
NTN-B 150840 (5,720000%)	0,00	51.997.672,70	0,00	0,00	52.256.301,21	258.628,51	258.628,51
					168.819.505,11	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 FIC FI	3.961.990,73	0,00	0,00	0,00	4.002.165,20	40.174,47	288.703,24
BB PREV RF IDKA2	2.139.938,28	0,00	0,00	0,00	2.179.617,72	39.679,44	760.188,23
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.247.197,35	0,00	0,00	0,00	4.292.196,51	44.999,16	340.826,24
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	8.814.278,84	0,00	0,00	0,00	8.980.862,01	166.583,17	1.338.292,26
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	20.562.612,50	0,00	0,00	0,00	20.764.909,66	202.297,16	3.576.216,58
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	1.584.659,71	0,00	-1.598.022,34	0,00	0,00	13.362,63	502.050,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.675.835,36	0,00	0,00	0,00	1.706.503,99	30.668,63	2.148.721,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.759.149,60	0,00	-428.879,14	0,00	4.411.810,51	81.540,05	719.323,04
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.655.976,53	0,00	-646.352,75	0,00	3.044.064,51	34.440,73	908.034,59
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.750.461,16	0,00	0,00	0,00	3.787.403,35	36.942,19	2.971.252,04
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.381.281,16	968.582,94	0,00	0,00	22.571.294,43	221.430,33	2.981.104,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	707.298,43	0,00	0,00	0,00	714.271,85	6.973,42	589.417,60
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	779.172,68	0,00	0,00	0,00	786.024,91	6.852,23	1.046.424,08
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.711.054,85	0,00	0,00	0,00	3.781.494,92	70.440,07	936.133,38
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	2.840.307,73	0,00	0,00	0,00	2.868.643,28	28.335,55	897.878,79
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	16.034.704,67	0,00	-6.000.000,00	0,00	10.192.568,23	157.863,56	192.568,23
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	200.000.000,00	-200.652.707,54	0,00	0,00	652.707,54	652.707,54
					94.083.831,08	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	206.746.682,97	150.358,14	-200.060.072,61	0,00	7.010.456,12	173.487,62	1.282.829,42
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	40.694.329,33	2.588.406,52	-248.363,60	0,00	43.483.469,11	449.096,86	3.305.003,45
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	37.164.402,10	0,00	0,00	0,00	37.847.925,35	683.523,25	4.248.088,36
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	10.284.272,46	0,00	0,00	0,00	10.386.057,44	101.784,98	1.201.657,85
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	3.337.702,57	0,00	0,00	0,00	3.372.098,63	34.396,06	307.034,85
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,00	32.660.896,12	0,00	0,00	32.660.896,12	0,00	0,00
					134.760.902,77	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	0,00	6.000.000,00	0,00	0,00	6.016.588,26	16.588,26	16.588,26
					6.016.588,26	0,00	0,00

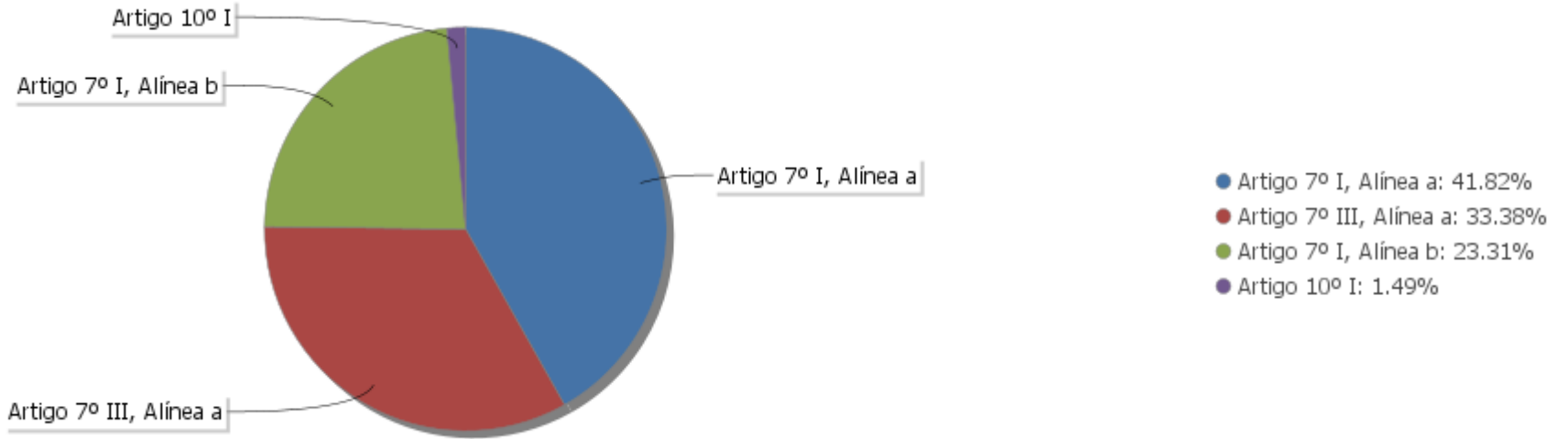
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

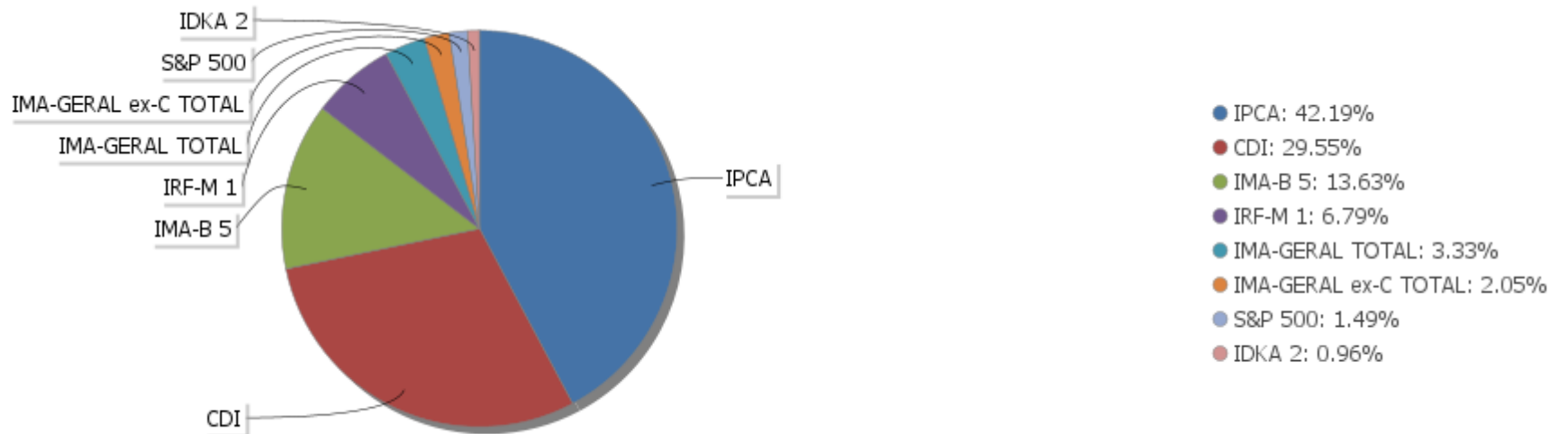
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	228.844.733,85	56,69	228.844.733,85	56,69
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	228.844.733,85	56,69
acima de 365 dias	174.836.093,37	43,31	403.680.827,22	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

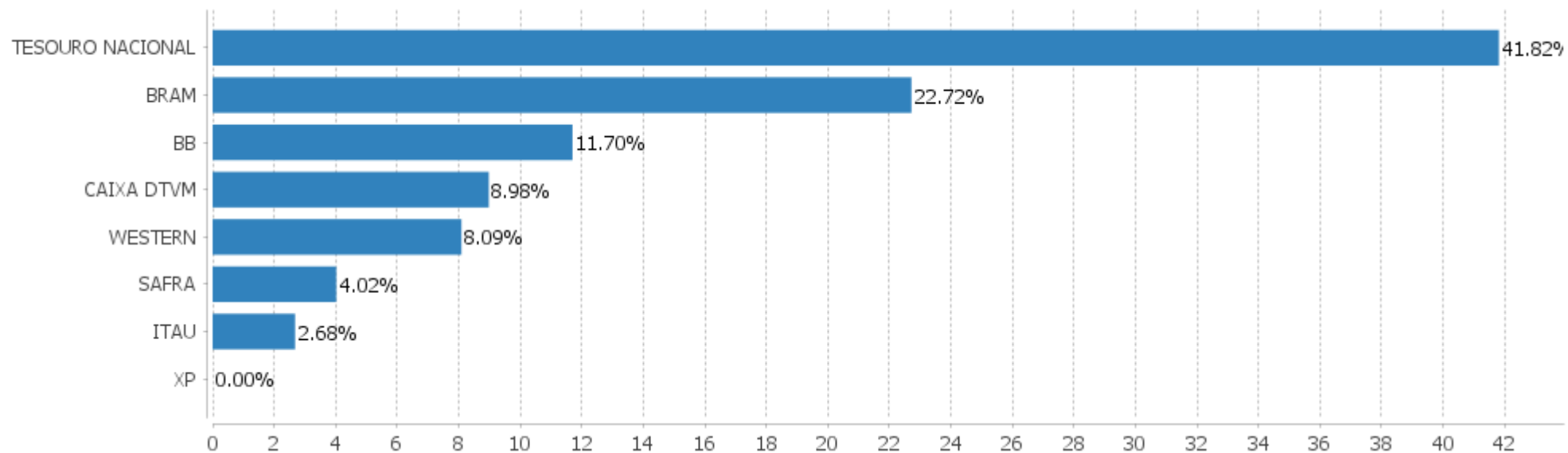


Alocação Por Estratégia



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	0,61	0,53	0,76	0,87	1,05			8,87	
IPCA + 5,00%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98			9,03	
p.p. indexador	-0,62	-0,49	-0,45	-0,43	-0,01	-0,47	0,81	0,68	0,75	0,07			-0,15	
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

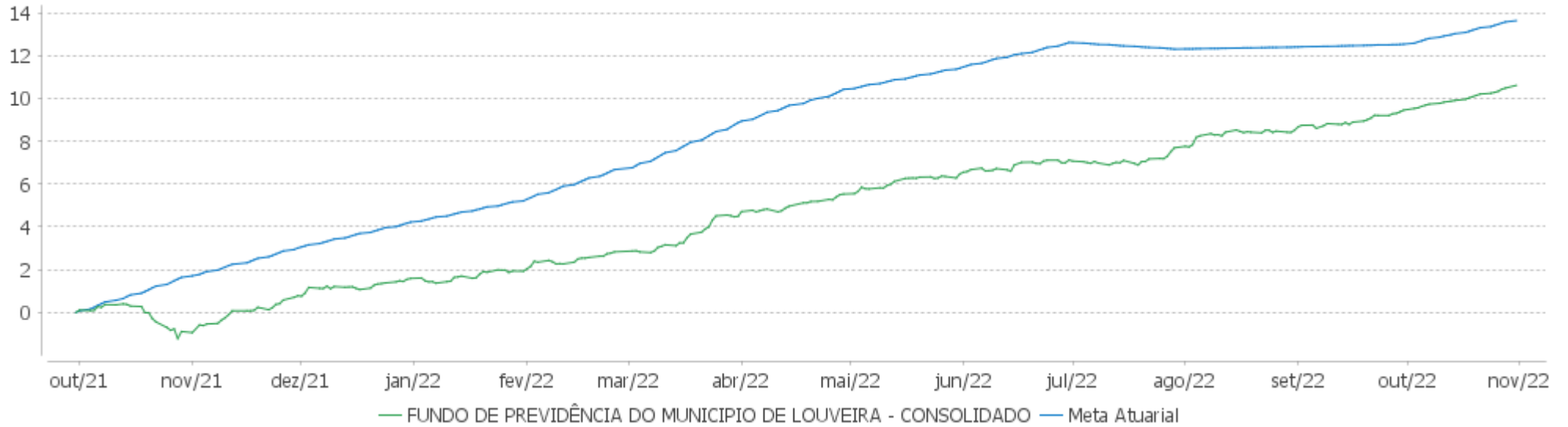
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

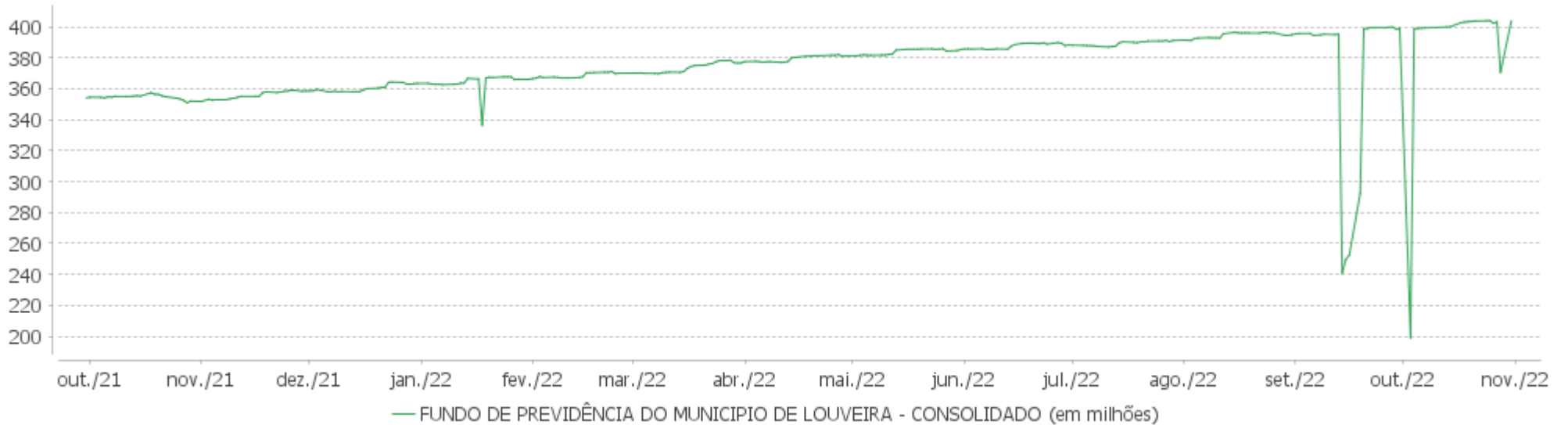
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	38,46	03 meses	2,71	1,18	1,53	1,08
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	61,54	06 meses	4,81	2,91	1,90	1,20
			12 meses	11,60	11,97	-0,37	1,31
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11	Desde 30/09/2021	10,61	13,90	-3,29	1,52
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

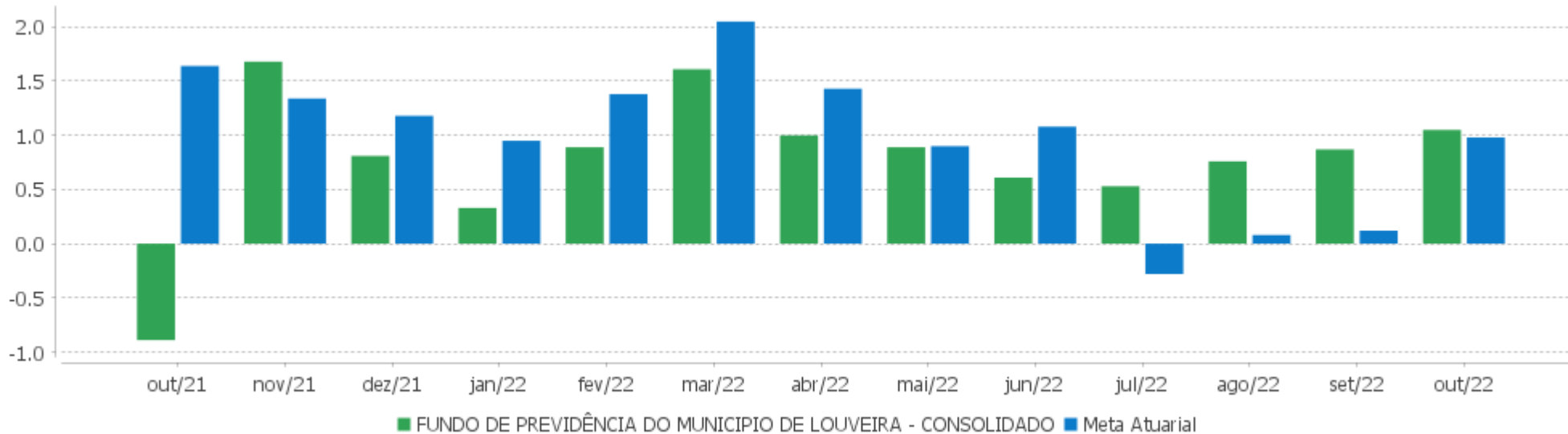


Patrimônio Líquido



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 150840 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	3,66 -1,05	-2,20 -2,13	0,68 0,28	6,76 0,29		
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,50 -0,09	6,61 1,91	0,58 0,65	0,67 0,27	6,76 0,29		
NTN-B 150535 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,57 -0,02	6,69 1,99	0,66 0,73	0,72 0,33	6,80 0,33		
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,00 -0,01	9,56 -0,12	3,38 -0,00	6,37 -0,07	11,43 -0,09	13,21 -0,28	17,31 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,88 -0,04	9,05 -0,08	2,36 0,01	3,51 0,00	12,60 -0,14	17,31 -0,41	23,62 -0,83
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,90 -0,02	8,97 -0,15	2,31 -0,04	3,42 -0,08	12,54 -0,19	17,26 -0,46	23,74 -0,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,98 -0,02	9,45 -0,23	3,31 -0,08	6,32 -0,13	11,23 -0,29	12,92 -0,58	17,06 -1,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,89 -0,03	8,92 -0,20	2,30 -0,04	3,42 -0,09	12,47 -0,26	17,14 -0,58	23,49 -0,96
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,01 99,25	10,13 101,30	3,32 100,62	6,57 100,97	11,65 101,35	15,31 100,74	18,56 98,16
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,07 0,06	8,67 -0,21	3,84 0,12	5,65 0,04	11,72 -0,08	12,12 -0,86	14,47 -1,52
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	1,02 100,15	9,96 99,59	3,31 100,39	6,55 100,55	11,42 99,38	15,07 99,19	18,39 97,25
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,88 0,29	9,36 4,65	3,05 3,11	5,73 5,33	12,11 5,64	14,66 -3,17	18,40 -4,05
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,85 0,07	8,72 -0,13	2,35 0,30	3,19 -0,03	12,14 -0,36	17,05 -0,64	24,45 -1,17
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,01	7,77	3,50	5,11	10,65	10,83	12,82
BRANCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	1,00 -0,00	9,50 -0,18	3,34 -0,04	6,36 -0,08	11,29 -0,22	13,00 -0,50	17,14 -0,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,99 0,40	9,36 4,65	3,75 3,81	5,92 5,53	11,26 4,79	11,59 -6,24	16,62 -5,83
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,83	8,48	2,24	3,04	11,90	16,82	24,01

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.	0,05	-0,37	0,19	-0,18	-0,60	-0,88	-1,60
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,99 -0,02	9,45 -0,23	3,32 -0,07	6,31 -0,13	11,24 -0,27	12,97 -0,52	17,33 -0,78
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,06	8,63	3,82	5,66	11,60	11,95	13,99
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	1,02 100,19	10,03 100,26	3,30 100,07	6,54 100,40	11,50 100,03	15,23 100,21	18,47 97,65
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,84 -0,08	8,68 -0,44	2,24 -0,11	3,28 -0,23	12,23 -0,50	16,16 -1,57	22,53 -1,91
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,07 105,22	10,52 105,23	3,44 104,29	6,84 105,03	12,13 105,57	16,28 107,15	19,29 102,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,04 101,81	10,21 102,09	3,35 101,70	6,62 101,68	11,79 102,61	15,78 103,83	18,90 99,93
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI % do CDI	0,96 94,16	10,06 100,54	3,57 108,19	6,97 107,11	11,72 101,99	14,96 98,43	18,72 99,00
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	1,03 100,97	10,02 100,15	3,30 100,12	6,52 100,17	11,51 100,12	15,17 99,83	18,49 97,80
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,99 -0,02	8,62 -0,27	3,65 -0,07	5,35 -0,26	11,64 -0,16	11,91 -1,06	15,19 -0,81
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	0,28 0,48	0,28 0,48					
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,05 0,07	8,87 -0,15	2,71 1,53	4,81 1,90	11,60 -0,19		
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

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 DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO 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
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES			D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

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	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
209	03/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	200.000.000,00	76.099.368,72168200	2,6281426950
191	04/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	53.132,68	20.206,41488400	2,6294956480
197	04/10/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	333.745,87	92.504,21157139	3,6078991900
195	04/10/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	95.133,27	26.368,05104302	3,6078991900
203	04/10/2022	TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	200.000.000,00	0,00	139.077.666,53905594	1,4380454100
200	07/10/2022	NTN-B 150545 (5,730000%)	74.996.734,20	0,00	17.942,00000000	4.179,9539740000
204	07/10/2022	TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	74.996.734,20	52.072.737,39484581	1,4402303000
202	11/10/2022	NTN-B 150840 (5,720000%)	51.997.672,70	0,00	12.654,00000000	4.109,1886120000
205	11/10/2022	TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	51.997.672,70	36.066.639,99789195	1,4417110300
201	13/10/2022	NTN-B 150535 (5,810000%)	40.997.404,53	0,00	9.961,00000000	4.115,7920420000
206	13/10/2022	TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	40.997.404,53	28.422.024,01373545	1,4424519700
192	14/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.939,93	2.629,69112400	2,6390665950
198	17/10/2022	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	646.352,75	200.321,67491973	3,2265742100
186	17/10/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.227.992,14	0,00	157.203,71009120	14,1726435000
196	17/10/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	968.582,94	0,00	209.162,79705700	4,6307610800
193	18/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	126.434,26	0,00	47.858,46361900	2,6418370010
194	19/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.923,88	0,00	9.051,03524900	2,6432202880
187	26/10/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	248.363,60	17.459,26032465	14,2253220000
199	26/10/2022	BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	1.598.022,34	552.796,36155767	2,8907975000
188	27/10/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	360.414,38	0,00	25.322,83161618	14,2327835000
185	27/10/2022	SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	6.000.000,00	0,00	60.000,00000000	100,0000000000
184	27/10/2022	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,00	6.000.000,00	10.928,83255351	549,0064900000
207	28/10/2022	TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	32.660.896,11	22.516.265,13199205	1,4505467900
208	31/10/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	32.660.896,12	0,00	2.083,86804673	15.673,2074141000
Total			410.360.055,15	409.634.397,98		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 1.107.499,85 Value-At-Risk: 0,27%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO		0,27	0,27			403.680.827,22	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,27%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,810000%)		0,18	0,00	0,19			41.186.693,75	10,20
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,18	0,00	0,19			75.376.510,15	18,67
NTN-B 150840 (5,720000%)		0,31	0,00	0,33			52.256.301,21	12,94
Sub-total	0,27	0,17	0,01		-0,84	0,54	168.819.505,11	41,82

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	-0,00	0,02			22.571.294,43	5,59
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,17	-0,00	0,24			2.868.643,28	0,71
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,17	0,01	0,01			3.781.494,92	0,94
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,17	0,01	0,01			20.764.909,66	5,14
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,00	0,00			3.787.403,35	0,94
BRANCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,15	0,01	0,05			3.044.064,51	0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,16	0,01	0,03			4.411.810,51	1,09
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,01	0,45			2.179.617,72	0,54
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,09	0,01	1,09			4.292.196,51	1,06
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,01	0,49			1.706.503,99	0,42
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,17	0,03	0,02			8.980.862,01	2,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI		1,49	0,00	1,50			786.024,91	0,19
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,01	1,11			4.002.165,20	0,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,01	0,00	1,02			714.271,85	0,18
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			10.192.568,23	2,52
Sub-total	0,45	0,43	0,10		0,37	1,19	94.083.831,08	23,31

Artigo 7º III, Alínea a

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			3.372.098,63	0,84
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		1,19	0,03	0,09			10.386.057,44	2,57
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			7.010.456,12	1,74
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,17	0,11	0,05			37.847.925,35	9,38
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			43.483.469,11	10,77
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,41	0,03	0,41			32.660.896,12	8,09
Sub-total	0,70	0,49	0,16		0,43	1,32	134.760.902,77	33,38

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,84%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,84	0,01	12,43			6.016.588,26	1,49
Sub-total	1,24	0,84	0,01		-0,60	0,28	6.016.588,26	1,49