



LDB
EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA -
SETEMBRO 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 30.09.2022.

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

100,00%

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	0,05	1,09	9,03	21.381.281,16	5,36	17.792.135.878,61	0,12
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,72	0,05	1,12	8,47	2.840.307,73	0,71	158.144.148,14	1,80
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,69	0,12	0,41	6,94	3.711.054,85	0,93	1.288.891.540,11	0,29
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	3,71		0,50	5,82	0,00	0,00	69.514.252,30	0,00
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,73	0,05	1,09	8,39	20.562.612,50	5,16	6.071.749.354,31	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	0,05	1,09	8,39	3.750.461,16	0,94	5.416.816.231,94	0,07
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,73	0,05	1,10	8,42	1.584.659,71	0,40	538.088.084,67	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	0,26	1,28	7,52	3.655.976,53	0,92	523.329.450,42	0,70
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	0,12	0,43	7,04	4.759.149,60	1,19	8.885.835.879,64	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,83	0,11	0,53	6,74	2.139.938,28	0,54	8.749.817.040,89	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,59	0,25	1,28	7,49	4.247.197,35	1,06	161.303.921,26	2,63
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,11	0,51	6,53	1.675.835,36	0,42	8.482.726.221,67	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,71	0,12	0,40	6,90	8.814.278,84	2,21	6.260.416.458,58	0,14
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,84	0,37	1,53	8,40	779.172,68	0,20	2.451.788.610,47	0,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,54	0,24	1,24	6,69	3.961.990,73	0,99	4.594.008.809,74	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,69	0,16	1,24	8,29	707.298,43	0,18	5.850.800.339,33	0,01
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,14	0,05	1,08	3,47	16.034.704,67	4,02	3.324.230.225,24	0,48
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,54	0,10	0,91	7,79	100.605.919,58	25,23		

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	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,14	0,05	1,07	8,90	3.337.702,57	0,84	28.919.876.622,20	0,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	2,83	0,25	1,21	7,55	10.284.272,46	2,58	219.512.384,08	4,69
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,14	0,05	1,09	9,08	206.746.682,97	51,84	11.863.594.899,56	1,74
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,72	0,12	0,41	6,72	37.164.402,10	9,32	1.080.164.977,54	3,44
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,14	0,05	1,12	9,35	40.694.329,33	10,20	7.044.059.635,23	0,58
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,61	0,07	0,82	7,63	298.227.389,43	74,77		
Renda Fixa			1,57	0,07	0,87	7,74	398.833.309,01	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,00%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,20		0,26	7,87	0,00	0,00	2.178.950.672,02	0,00
Sub-total Artigo 10º I			3,20	0,00	0,26	7,87	0,00	0,00		
Investimentos Estruturados			2,96	0,00	0,26	7,87	0,00	0,00		
Total			1,57	0,07	0,87	7,74	398.833.309,01	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	100.605.919,58	25,23	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	298.227.389,43	74,77	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	398.833.309,01	100,00					100,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	0,00	0,00	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	0,00	0,00					15,00
Total		398.833.309,01	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 b % do CDI	0,91 84,78	7,79 87,66	2,34 70,83	4,90 77,59	9,38 86,12	1.410.188,00	19.351.395,25
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 76,87	7,63 85,81	1,84 55,71	4,48 70,89		1.877.761,13	8.902.325,16
Artigo 10º I % do CDI	0,26 24,37	7,87 88,53	3,71 111,99	3,65 57,85		248,82	6.968,81
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						3.288.197,95	28.260.689,22

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	3.913.547,05	0,00	0,00	0,00	3.961.990,73	48.443,68	248.528,77
BB PREV RF IDKA2	12.124.493,06	0,00	-10.000.000,00	0,00	2.139.938,28	15.445,22	720.508,79
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.193.513,61	0,00	0,00	0,00	4.247.197,35	53.683,74	295.827,08
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	18.785.074,01	0,00	-10.000.000,00	0,00	8.814.278,84	29.204,83	1.171.709,09
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	45.235.245,35	0,00	-25.000.000,00	0,00	20.562.612,50	327.367,15	3.373.919,42
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	3.046.736,65	0,00	-1.494.687,04	0,00	1.584.659,71	32.610,10	488.688,14
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.426.366,74	0,00	-26.793.667,22	0,00	1.675.835,36	43.135,84	2.118.052,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.069.043,45	0,00	-6.339.186,63	0,00	4.759.149,60	29.292,78	637.782,99
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.569.791,96	0,00	-10.000.002,27	0,00	3.655.976,53	86.186,84	873.593,86
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.614.582,30	0,00	-37.063.257,20	0,00	3.750.461,16	199.136,06	2.934.309,85
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	39.370.969,20	1.339.920,90	-19.648.393,45	0,00	21.381.281,16	318.784,51	2.759.674,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	8.273.675,99	0,00	-7.610.323,41	0,00	707.298,43	43.945,85	582.444,18
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	15.737.005,49	0,00	-15.000.000,00	0,00	779.172,68	42.167,19	1.039.571,85
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	13.681.093,28	0,00	-10.000.000,00	0,00	3.711.054,85	29.961,57	865.693,31
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	5.717.975,11	0,00	-5.746.656,67	0,00	0,00	28.681,56	336.842,58
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	11.769.203,31	0,00	-9.000.000,00	0,00	2.840.307,73	71.104,42	869.543,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	1.023.668,01	15.000.000,00	0,00	0,00	16.034.704,67	11.036,66	34.704,67
					100.605.919,58	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	713.361,45	220.007.359,77	-15.058.475,13	0,00	206.746.682,97	1.084.436,88	1.109.341,80
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	38.038.912,80	2.219.530,10	0,00	0,00	40.694.329,33	435.886,43	2.855.906,59
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	59.991.458,10	0,00	-23.000.000,00	0,00	37.164.402,10	172.944,00	3.564.565,11
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	16.135.237,97	0,00	-6.000.000,00	0,00	10.284.272,46	149.034,49	1.099.872,87
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	3.302.243,24	0,00	0,00	0,00	3.337.702,57	35.459,33	272.638,79
					298.227.389,43	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	95.256,99	0,00	-95.505,81	0,00	0,00	248,82	6.968,81
					0,00	0,00	0,00

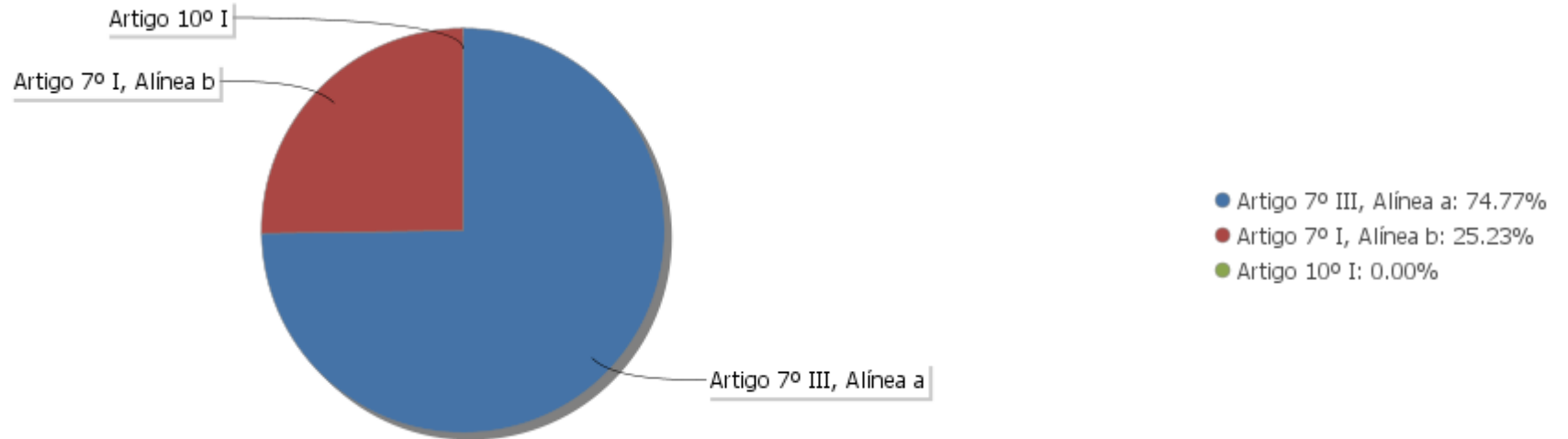
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

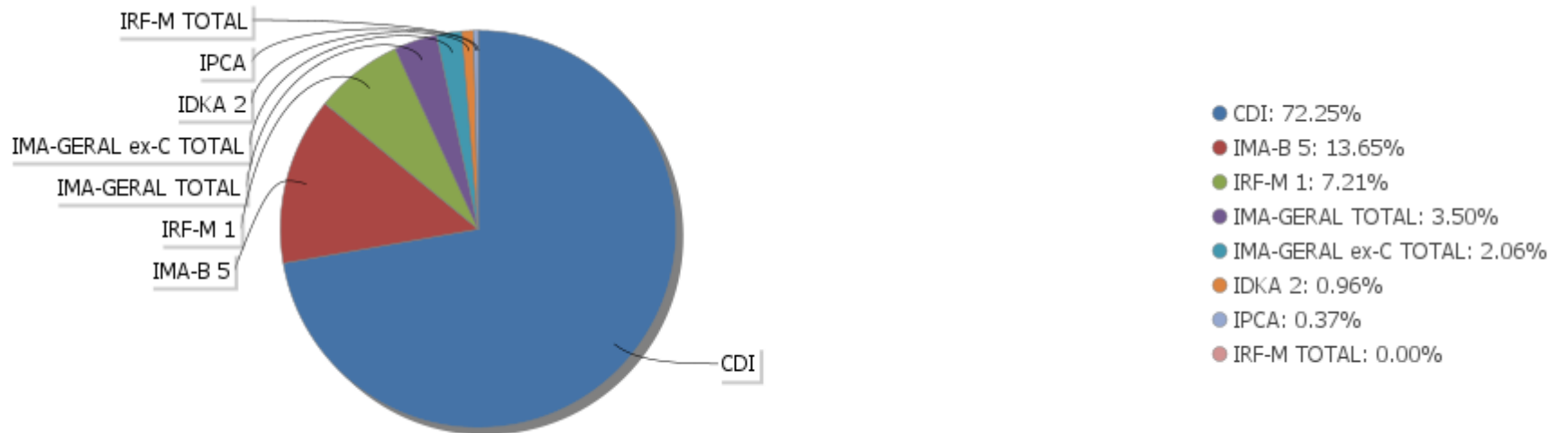
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	398.833.309,01	100,00	398.833.309,01	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	398.833.309,01	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	398.833.309,01	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

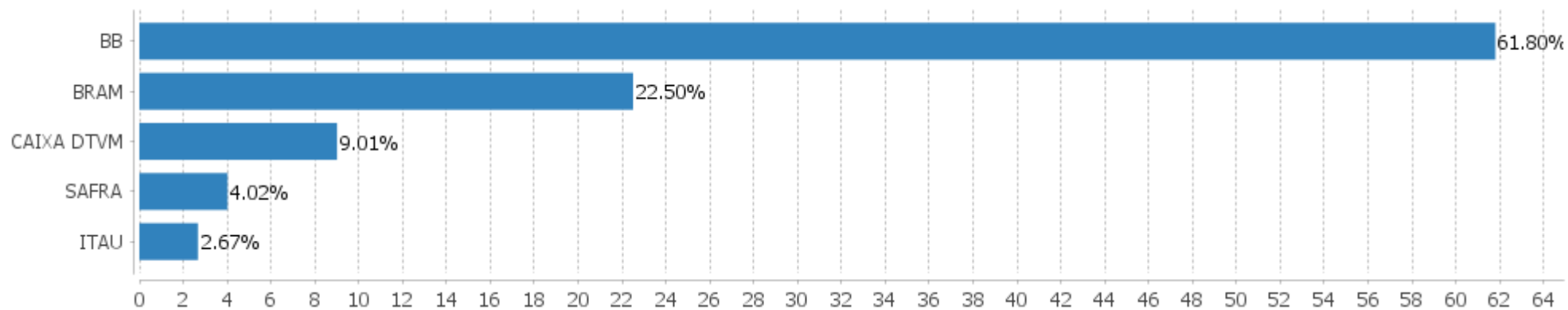


Alocação Por Estratégia



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				7,74
IPCA + 5,00%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12				7,97
p.p. indexador	-0,62	-0,49	-0,45	-0,43	-0,01	-0,47	0,81	0,68	0,75				-0,23
2021													
IPCA + 6,00%										-0,89	1,68	0,81	1,59
p.p. indexador										1,72	1,42	1,27	4,47
										-2,61	0,26	-0,46	-2,88

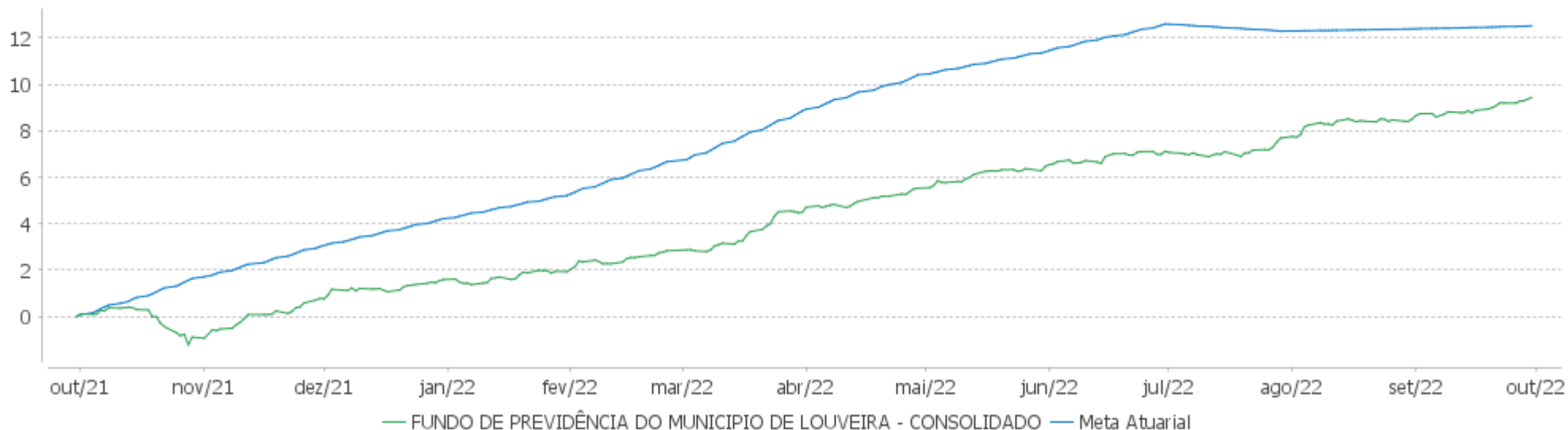
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

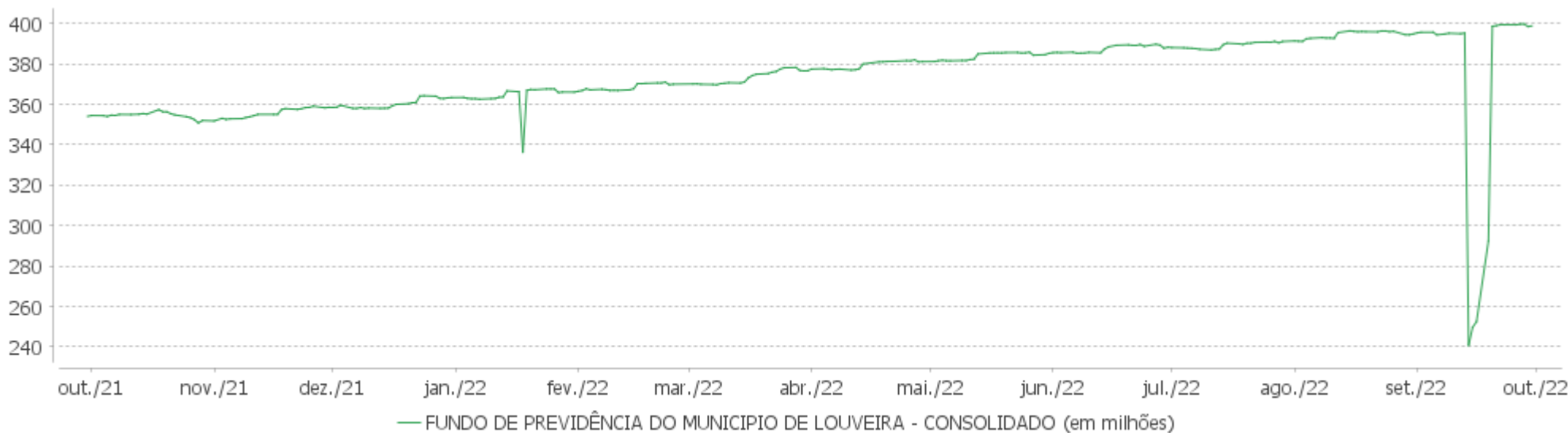
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	33,33	03 meses	2,18	-0,07	2,26	1,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	66,67	06 meses	4,75	3,37	1,38	1,28
			12 meses	9,45	12,79	-3,34	1,57
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11	Desde 30/09/2021	9,45	12,79	-3,34	1,57
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

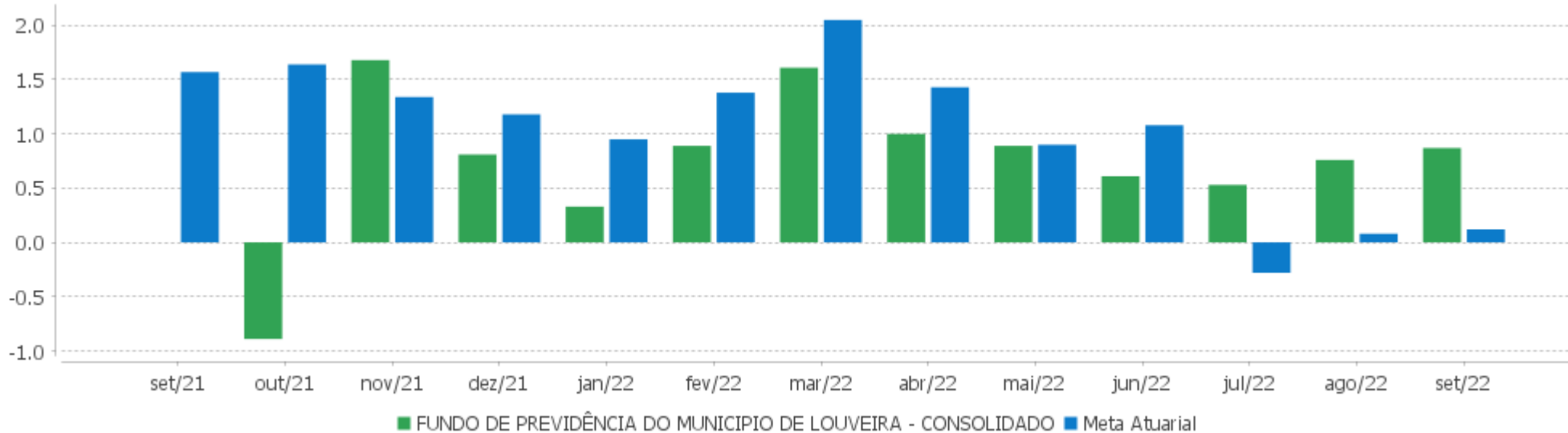


Patrimônio Líquido



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.	1,12 0,00	8,47 -0,12	3,38 -0,05	6,08 -0,09	9,65 -0,17	12,23 -0,33	16,91 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,43 0,00	7,04 -0,03	0,50 0,06	3,16 0,02	9,15 -0,10	15,36 -0,39	23,34 -0,79
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,41 -0,01	6,94 -0,13	0,40 -0,03	3,06 -0,08	9,06 -0,18	15,28 -0,46	23,42 -0,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,03	8,39 -0,21	3,37 -0,06	6,02 -0,16	9,57 -0,24	11,94 -0,61	16,61 -1,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,40 -0,02	6,90 -0,17	0,40 -0,03	3,05 -0,09	8,97 -0,27	15,18 -0,56	23,19 -0,94
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,09 101,96	9,03 101,54	3,33 100,46	6,29 99,66	11,10 101,90	14,29 100,52	17,96 98,25
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,28 0,02	7,52 -0,28	3,19 0,02	5,08 -0,05	8,95 -0,29	10,96 -0,98	15,18 -1,63
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	1,08 100,58	8,85 99,53	3,32 100,25	6,22 98,60	10,87 99,73	14,06 98,93	17,74 97,06
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,53 1,82	8,40 4,31	2,97 4,30	5,62 4,76	10,74 3,57	13,75 -4,40	17,95 -3,91
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,53 -0,09	6,74 -0,20	0,26 0,18	2,81 -0,13	8,72 -0,19	15,30 -0,38	23,69 -1,24
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,37 -0,03	6,74 -0,22	4,59 -0,08	5,37 -0,16	7,70 -0,31	6,38 -0,54	13,12 -0,81
BRANDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	1,10 -0,02	8,42 -0,17	3,38 -0,05	6,03 -0,15	9,59 -0,22	12,05 -0,51	16,68 -0,98
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,24	6,69	2,87	4,60	7,75	9,64	13,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,24 1,53	8,29 4,20	3,54 4,86	5,84 4,98	9,44 2,28	10,38 -7,77	17,45 -4,40
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,51 -0,11	6,53 -0,41	0,11 0,02	2,60 -0,34	8,47 -0,45	14,89 -0,79	23,34 -1,60
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,02	8,39 -0,20	3,37 -0,07	6,04 -0,13	9,57 -0,25	12,03 -0,52	16,89 -0,78
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,28	7,49	3,21	5,05	8,89	10,80	14,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.							
BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,41 -0,01	6,72 -0,35	0,38 -0,05	2,94 -0,20	8,79 -0,46	14,20 -1,54	22,35 -1,78
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,12 104,02	9,35 105,17	3,44 103,94	6,62 104,79	11,58 106,31	15,22 107,12	18,56 101,56
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,93	9,08 102,10	3,35 101,16	6,35 100,55	11,18 102,63	14,77 103,93	18,19 99,53
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	1,07 100,17	8,90 100,05	3,29 99,45	6,25 98,94	10,92 100,22	14,13 99,42	17,83 97,59
BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,21 -0,05	7,55 -0,24	3,07 -0,10	4,90 -0,23	8,81 -0,43	10,90 -1,04	16,11 -0,70
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	1,41 131,95	9,11 102,49	4,90 148,03	4,84 76,73	10,03 92,10	15,37 108,16	18,89 103,38
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,87 0,75	7,74 -0,23	2,18 2,26	4,75 1,38	9,45 -3,07		
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

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 ALOCACAO 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 ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI			D+0	D+0		0,10

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	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
Índice Consumo - ICON	-1,18		15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
156	06/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	58.475,13	22.458,09814138	2,6037436310
172	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	192.664,30	72.597,22681995	2,6538796100
167	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	339.185,89	94.587,87772700	3,5859340300
171	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	63.246,94	21.939,85486630	2,8827419500
164	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	100.994,64	38.055,47155170	2,6538796100
149	09/09/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	10.000.000,00	3.111.630,40059827	3,2137492930
150	09/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.000.000,00	0,00	3.836.677,20623381	2,6064220320
173	12/09/2022	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,00	95.505,81	25.098,54930590	3,8052322800
168	13/09/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	351.417,15	0,00	76.788,49888014	4,5764294800
148	14/09/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	25.000.000,00	8.300.359,73649533	3,0119176510
165	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	26.500.008,28	9.952.483,43377727	2,6626528400
157	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	6.000.000,74	1.668.759,54706800	3,5954854913
158	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.000.002,27	3.137.800,23779814	3,1869467500
163	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.000.010,26	12.803.880,11582262	2,8897498200
159	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	13.000.000,00	2.839.324,36480200	4,5785540254
180	14/09/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	7.610.323,41	4.681.657,70442093	1,6255616900
119	14/09/2022	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	5.000.000,00	247.646,02546950	20,1901080000
118	14/09/2022	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	0,00	10.000.000,00	256.118,01262360	39,0445010000
115	14/09/2022	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,00	9.000.000,00	240.651,56250113	37,3984690000
175	14/09/2022	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	0,00	5.746.656,67	171.393,88025554	33,5289490000
176	15/09/2022	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	10.000.000,00	436.548,20422014	22,9069777480
177	15/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	35.000.000,00	0,00	13.401.677,25161258	2,6116134080
178	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	6.000.000,00	1.309.761,60876900	4,5809863100
179	15/09/2022	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	10.000.000,00	496.456,96043332	20,1427330000
169	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	648.393,45	141.471,00339100	4,5832250700
152	16/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.000.000,00	0,00	11.098.590,92251377	2,6129443100
146	16/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	150.358,14	0,00	57.543,56854242	2,6129443100
125	16/09/2022	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.219.530,10	0,00	158.268,62899896	14,0238158000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
124	16/09/2022	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	0,00	323.823,51	67.917,71537702	4,7678799000
123	16/09/2022	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	0,00	796.308,76	167.015,27234358	4,7678799000
122	16/09/2022	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	0,00	4.879.867,73	1.023.487,97208587	4,7678799000
161	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	978.762,50	0,00	213.553,22617835	4,5832250700
140	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	510.852,33	225.822,72541830	2,2621830000
132	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	1.142.368,74	504.985,11367300	2,2621830000
144	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	580.757,10	256.724,19074849	2,2621830000
131	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	1.158.738,41	512.221,34257260	2,2621830000
139	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	946.771,19	418.521,04426340	2,2621830000
138	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	469.190,58	207.406,11278350	2,2621830000
142	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	2.073.797,27	916.723,92133000	2,2621830000
129	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	576.713,50	254.936,71218390	2,2621830000
137	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	999.544,06	441.849,33576730	2,2621830000
141	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	910.684,09	402.568,70842520	2,2621830000
128	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	208.973,14	92.376,76320360	2,2621830000
136	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	519.085,97	229.462,41473760	2,2621830000
135	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	1.191.575,22	526.736,88191300	2,2621830000
134	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	557.051,39	246.245,06129410	2,2621830000
133	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	1.112.643,54	491.845,06409300	2,2621830000
183	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	1.037.676,69	458.705,89946810	2,2621830000
182	16/09/2022	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	9.003.576,78	3.980.039,09565870	2,2621830000
153	19/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	39.746.656,61	0,00	15.203.467,37448745	2,6143152500
154	20/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	106.110.345,02	0,00	40.567.002,41121549	2,6156811870
127	29/09/2022	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	408.190,36	142.470,65303989	2,8650838000
126	29/09/2022	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	1.086.496,68	379.219,86086410	2,8650838000
155	30/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000.000,00	5.710.369,86893645	2,6268000750
162	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.741,25	0,00	2.114,35989393	4,6071863300
121	30/09/2022	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	15.000.000,00	0,00	27.573,59758546	543,9986550000
Total			238.566.810,77	237.850.154,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 960.510,07

Value-At-Risk: 0,24%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO		0,24	0,24			398.833.309,01	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,24%

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		0,02	-0,00	0,02			21.381.281,16	5,36
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,18	-0,00	0,26			2.840.307,73	0,71
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,17	0,01	0,01			3.711.054,85	0,93
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,18	0,01	0,01			20.562.612,50	5,16
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,00	0,01			3.750.461,16	0,94
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS		0,18	0,00	0,01			1.584.659,71	0,40
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,14	0,01	0,05			3.655.976,53	0,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,14	0,01	0,04			4.759.149,60	1,19
BB PREV RF IDKA2		1,42	0,01	0,32			2.139.938,28	0,54
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,10	0,01	1,10			4.247.197,35	1,06
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,54	0,01	0,42			1.675.835,36	0,42
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,15	0,02	0,03			8.814.278,84	2,21
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI		1,42	0,00	1,43			779.172,68	0,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,01	0,01	1,01			3.961.990,73	0,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,25	0,00	1,27			707.298,43	0,18
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			16.034.704,67	4,02
Sub-total	1,24	0,41	0,10		-0,13	0,91	100.605.919,58	25,23

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI		0,01	-0,00	0,01			3.337.702,57	0,84
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		1,19	0,03	0,11			10.284.272,46	2,58
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			206.746.682,97	51,84
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,18	0,11	0,04			37.164.402,10	9,32
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			40.694.329,33	10,20
Sub-total	1,14	0,18	0,14		-0,22	0,82	298.227.389,43	74,77

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: NaN%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	1,95	NaN	0,00		-0,42	0,26	0,00	0,00