



LDB
EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA -
4º TRIMESTRE 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 30.12.2022.

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 98,60%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,810000%)	2,91	0,07	0,86	2,42	40.806.209,20	9,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,310000%)	4,24	0,04	0,29	0,29	15.041.700,38	3,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	2,87	0,01	0,85	2,46	74.705.692,66	18,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,900000%)	4,19	0,04	0,87	1,47	20.289.707,93	4,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,720000%)	4,11	0,03	0,85	2,45	53.269.166,72	12,93
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,59	0,03	0,85	2,47	204.112.476,89	49,55

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	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,27	0,05	1,22	1,22	4.031.994,60	0,98	6.757.838.619,84	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,05	1,09	3,12	24.131.604,37	5,86	16.549.368.546,86	0,15
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,47	0,05	1,16	3,11	2.928.602,57	0,71	184.221.130,31	1,59
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,61	0,04	0,92	2,49	3.803.274,93	0,92	1.261.404.429,16	0,30
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,48	0,05	1,16	3,09	21.197.199,11	5,15	6.516.931.621,39	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,15	3,09	3.866.441,39	0,94	6.557.713.378,25	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,63	0,05	0,78	1,77	3.065.251,30	0,74	495.727.244,82	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	0,04	0,92	2,46	3.154.692,61	0,77	7.960.289.495,76	0,04
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,82	0,04	1,22	2,42	2.191.761,66	0,53	7.489.389.892,90	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,47	0,05	0,84	1,90	4.327.690,38	1,05	164.124.316,76	2,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,04	1,23	2,36	1.715.376,98	0,42	6.893.208.496,34	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,62	0,04	0,91	2,44	9.029.604,58	2,19	5.613.586.065,55	0,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,08	0,05	-0,37	-0,53	775.048,99	0,19	2.189.575.950,42	0,04
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,43	0,00	-0,39	0,54	0,00	0,00	0,00	
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	1,14	2,23	723.039,09	0,18	5.292.657.963,96	0,01
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,09	0,05	1,12	3,18	10.410.074,92	2,53	3.484.971.718,10	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,21	0,05	1,04	2,76	95.351.657,48	23,15		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,08	0,05	1,10	3,17	3.443.572,68	0,84	27.822.942.011,94	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,61	0,05	0,76	1,63	10.451.512,11	2,54	201.487.904,45	5,19
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	1,12	3,22	7.218.241,87	1,75	12.858.761.791,29	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,63	0,04	0,93	2,41	38.060.750,82	9,24	926.201.488,19	4,11
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,17	3,34	46.554.687,12	11,30	7.627.582.136,16	0,61
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,26	0,05	0,47	0,47	988.582,52	0,24	682.174.181,77	0,14
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,56	0,05	1,05	2,77	106.717.347,12	25,90		
Renda Fixa			1,20	0,04	0,95	2,72	406.181.481,49	98,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,40%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
SAFRA	SAFRA	SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	19,56	3,90	-0,26	-3,59	5.784.686,82	1,40	39.335.870,49	14,71
Sub-total Artigo 10º I			19,56	3,90	-0,26	-3,59	5.784.686,82	1,40		
Investimentos Estruturados			8,63	3,90	-0,26	-3,59	5.784.686,82	1,40		
Total			1,22	0,09	0,93	2,64	411.966.168,31	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	204.112.476,89	49,55	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	95.351.657,48	23,15	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	106.717.347,12	25,90	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	406.181.481,49	98,60					100,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	5.784.686,82	1,40	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	5.784.686,82	1,40					15,00
Total		411.966.168,31	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,85 75,44	2,47 84,10				1.646.217,71	4.399.050,91
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,04 92,96	2,76 86,26	2,76 86,26	5,17 78,14	10,77 87,02	984.568,50	3.291.576,93
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 93,34	2,77 86,46	2,77 86,46	4,66 70,46	10,60 85,71	1.144.546,49	2.993.659,81
Artigo 10º I % do CDI	-0,26 -22,90	-3,59 -112,21	-3,59 -112,21	-0,01 -0,22	4,00 32,33	-14.918,40	-215.313,18
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						3.760.414,30	10.468.974,47

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,810000%)	40.458.722,43	0,00	0,00	0,00	40.806.209,20	347.486,77	977.493,84
NTN-B 150535 (6,310000%)	0,00	14.998.933,47	0,00	0,00	15.041.700,38	42.766,91	42.766,91
NTN-B 150545 (5,730000%)	74.074.004,77	0,00	0,00	0,00	74.705.692,66	631.687,89	1.814.030,34
NTN-B 150830 (5,900000%)	20.115.363,28	0,00	0,00	0,00	20.289.707,93	174.344,65	293.265,80
NTN-B 150840 (5,720000%)	52.819.235,23	0,00	0,00	0,00	53.269.166,72	449.931,49	1.271.494,02
					204.112.476,89	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 Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3.998.784,69	0,00	-3.983.349,11	0,00	0,00	-15.435,58	21.358,38
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	3.983.349,11	0,00	0,00	4.031.994,60	48.645,49	48.645,49
BB PREV RF IDKA2	2.165.374,04	0,00	0,00	0,00	2.191.761,66	26.387,62	51.823,38
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.291.771,08	0,00	0,00	0,00	4.327.690,38	35.919,30	80.493,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	8.947.842,89	0,00	0,00	0,00	9.029.604,58	81.761,69	215.325,74
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	20.954.736,15	0,00	0,00	0,00	21.197.199,11	242.462,96	634.586,61
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.694.468,21	0,00	0,00	0,00	1.715.376,98	20.908,77	39.541,62
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.755.752,09	0,00	-629.714,76	0,00	3.154.692,61	28.655,28	93.003,81
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.041.671,04	0,00	0,00	0,00	3.065.251,30	23.580,26	55.627,52
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.822.309,97	0,00	0,00	0,00	3.866.441,39	44.131,42	115.980,23
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	23.348.140,58	2.346.317,30	-1.821.139,63	0,00	24.131.604,37	258.286,12	701.618,81
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	714.894,50	0,00	0,00	0,00	723.039,09	8.144,59	15.740,66
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	777.925,64	0,00	0,00	0,00	775.048,99	-2.876,65	-4.123,69
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.768.430,55	0,00	0,00	0,00	3.803.274,93	34.844,38	92.220,08
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	2.895.111,02	0,00	0,00	0,00	2.928.602,57	33.491,55	88.294,84
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	10.294.413,62	0,00	0,00	0,00	10.410.074,92	115.661,30	375.370,25
					95.351.657,48	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	3.406.001,15	0,00	0,00	0,00	3.443.572,68	37.571,53	105.870,11
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.168.761,95	150.358,14	-181.013,31	0,00	7.218.241,87	80.135,09	325.558,13
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	44.681.791,83	4.564.735,40	-3.217.767,19	0,00	46.554.687,12	525.927,08	1.449.342,24
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	37.711.042,57	0,00	0,00	0,00	38.060.750,82	349.708,25	896.348,72
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	10.372.541,22	0,00	0,00	0,00	10.451.512,11	78.970,89	167.239,65
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	15.915.282,34	983.986,66	-15.982.920,13	0,00	988.582,52	72.233,65	49.300,96
					106.717.347,12	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI	5.799.605,22	0,00	0,00	0,00	5.784.686,82	-14.918,40	-215.313,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
MULTIMERCADO					5.784.686,82	0,00	0,00

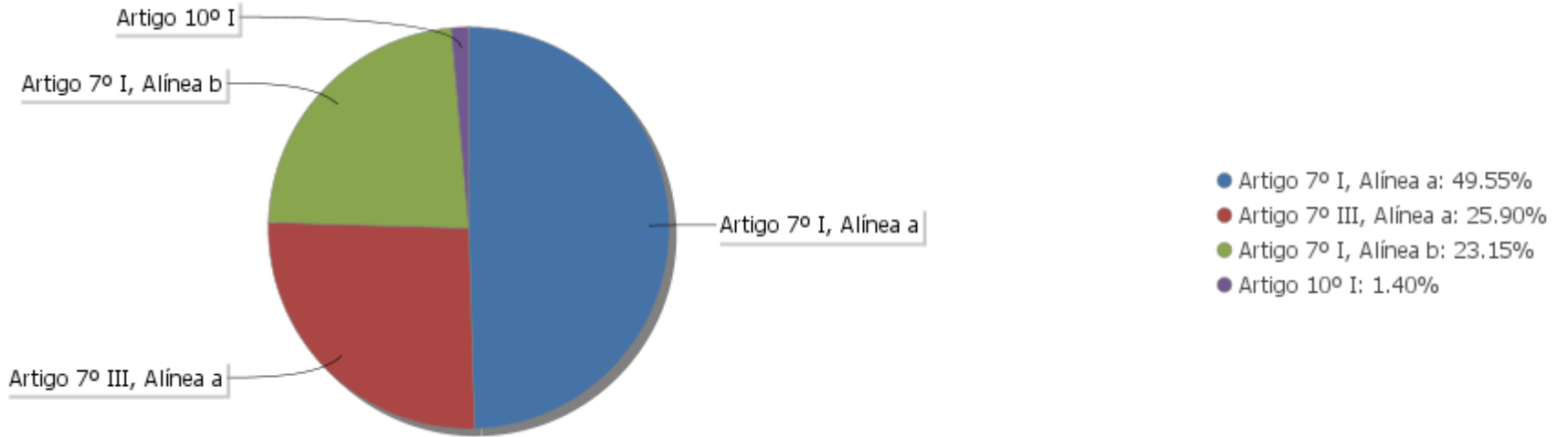
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

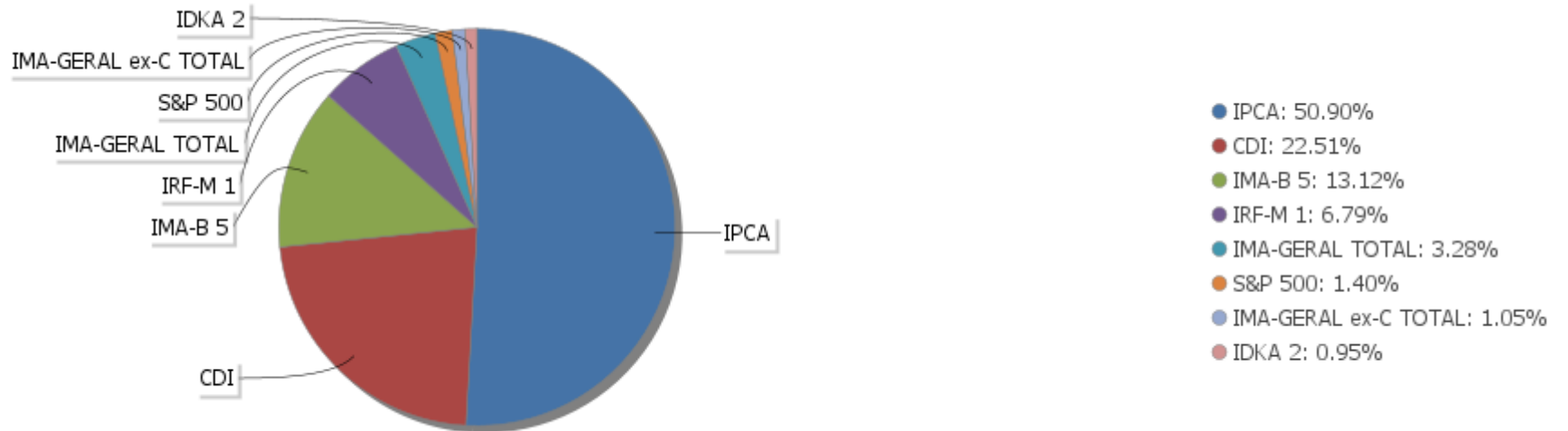
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	202.069.004,60	49,05	202.069.004,60	49,05	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	202.069.004,60	49,05	
acima de 365 dias	209.897.163,71	50,95	411.966.168,31	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

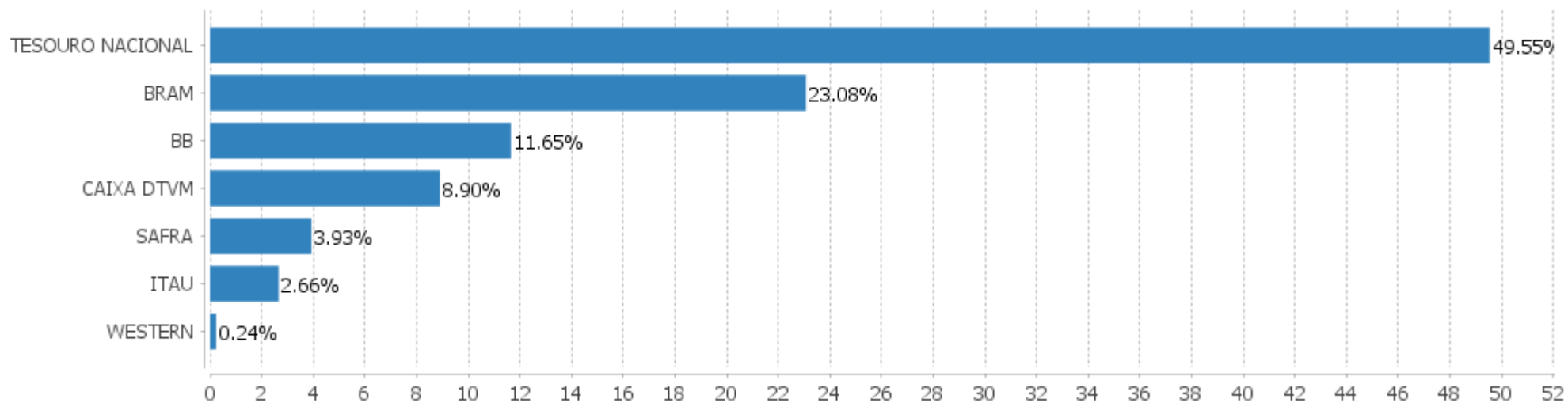


Alocação Por Estratégia



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	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

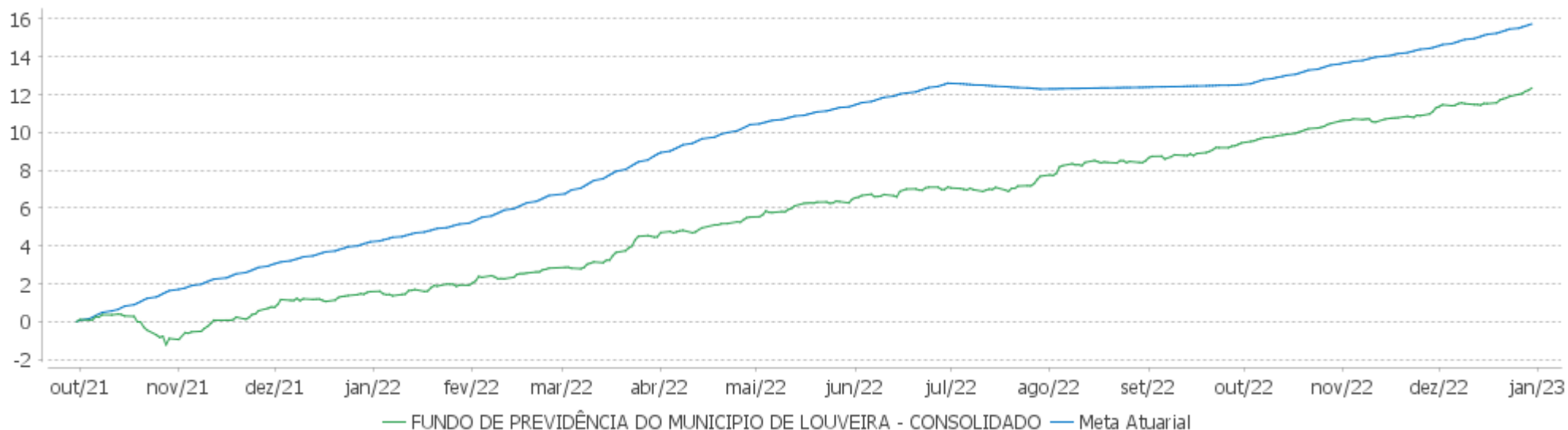
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

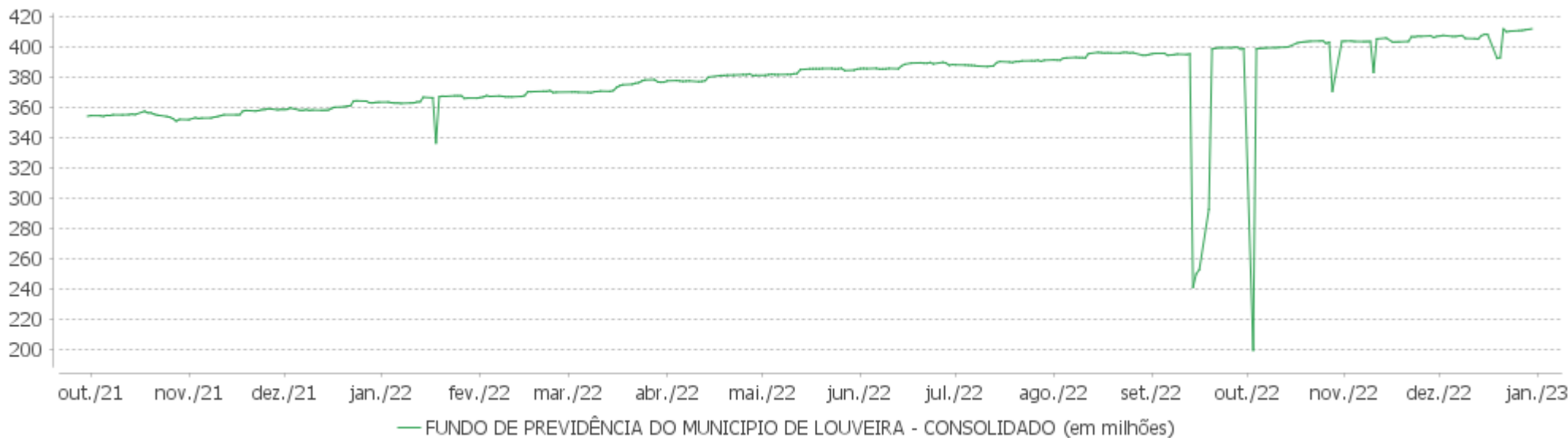
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	33,33	03 meses	2,64	2,86	-0,21	0,82
Meses abaixo - Meta Atuarial	10	66,67	06 meses	4,88	2,78	2,10	1,10
			12 meses	10,59	11,05	-0,47	1,22
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11	Desde 30/09/2021	12,35	16,02	-3,67	1,46
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

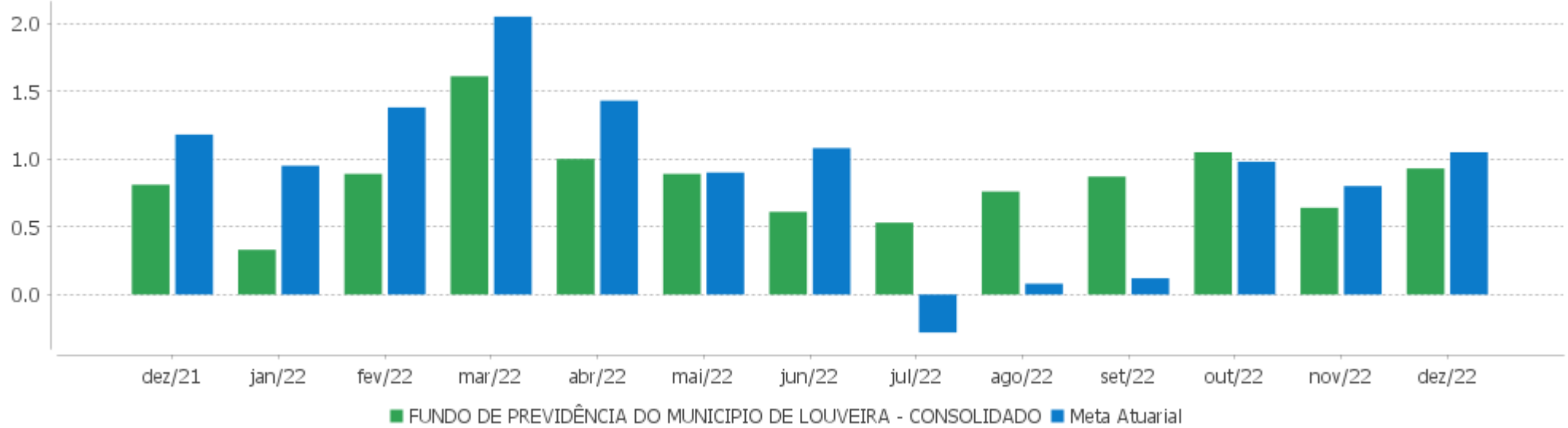


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (6,310000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,28	-0,39 -2,02	-0,39 -2,02	0,30 0,02	5,92 0,13		
NTN-B 150830 (5,900000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,53 0,90	2,53 0,90	0,20 -0,09	5,71 -0,08		
NTN-B 150840 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,23	2,48 0,85	2,48 0,85	0,17 -0,11	5,67 -0,12		
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,23	2,45 0,82	2,45 0,82	3,02 2,73	8,68 2,90		
NTN-B 150535 (5,810000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	2,54 0,91	2,54 0,91	3,12 2,84	8,78 2,99		
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,02	3,11 -0,05	3,11 -0,05	6,60 -0,10	11,85 -0,17	14,97 -0,33	18,97 -0,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	2,46 -0,07	2,46 -0,07	2,96 -0,01	9,67 -0,11	14,40 -0,40	23,26 -0,76
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	2,49 -0,05	2,49 -0,05	2,90 -0,08	9,60 -0,18	14,37 -0,43	23,32 -0,71
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,02	3,09 -0,07	3,09 -0,07	6,56 -0,14	11,73 -0,29	14,68 -0,62	18,66 -1,07
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,91 -0,03	2,44 -0,09	2,44 -0,09	2,86 -0,12	9,51 -0,27	14,19 -0,61	23,07 -0,95
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,78 0,00	1,77 0,04	1,77 0,04	5,01 0,06	9,42 -0,24	9,80 -0,91	15,10 -1,53
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,09 97,41	3,12 97,45	3,12 97,45	6,55 98,96	12,43 100,42	17,30 99,95	20,18 98,18
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	1,12 100,02	3,18 99,37	3,18 99,37	6,60 99,81	12,31 99,47	17,14 98,99	20,04 97,49
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	-0,37 -0,99	-0,53 -2,16	-0,53 -2,16	2,43 2,14	7,83 2,04	12,71 -3,72	15,94 -5,75
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,02	2,42 0,17	2,42 0,17	2,69 0,36	9,32 -0,02	14,40 -0,38	23,46 -1,22
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,39	0,54	0,54	3,43	7,27	6,84	12,28
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,14	2,23	2,23	5,84	10,70	10,58	17,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,52	0,60	0,60	5,56	4,91	-5,85	-3,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,23 -0,01	2,36 0,11	2,36 0,11	2,47 0,13	9,04 -0,30	14,12 -0,66	23,29 -1,38
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,77 0,15	1,67 0,04	1,67 0,04	4,80 4,51	9,30 3,52	9,89 -6,54	
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,15 -0,02	3,09 -0,06	3,09 -0,06	6,56 -0,13	11,74 -0,28	14,76 -0,54	18,92 -0,80
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,84	1,90	1,90	5,17	9,52	9,78	14,74
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,93 -0,01	2,41 -0,12	2,41 -0,12	2,80 -0,17	9,29 -0,49	13,30 -1,49	22,20 -1,82
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,17 103,79	3,34 104,31	3,34 104,31	6,89 104,19	13,00 105,05	18,58 107,34	21,11 102,67
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,12 99,92	3,22 100,61	3,22 100,61	6,67 100,91	12,59 101,73	17,79 102,78	20,62 100,29
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI % do CDI	1,09 97,28	2,39 74,75	2,39 74,75	6,22 94,01	11,61 93,87	14,42 83,32	20,06 97,57
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	1,10 98,20	3,17 99,18	3,17 99,18	6,57 99,31	12,35 99,81	17,22 99,47	20,13 97,89
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,76 -0,01	1,63 -0,10	1,63 -0,10	4,74 -0,21	9,30 -0,36	9,39 -1,32	15,78 -0,84
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-0,26 7,00	-3,59 -1,80					
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,93 -0,12	2,64 -0,21	2,64 -0,21	4,88 2,10	10,59 -0,47		
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL 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 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 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
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

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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,18	3,16	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	1,10	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	1,74	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	2,53	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	-1,72	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	0,23	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	1,73	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	2,25	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-5,66	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	-0,39	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	0,38	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-7,61	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	3,15	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-7,26	3,34	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	-4,14	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	5,58	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	1,63	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	1,55	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	-1,09	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	2,61	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	2,86	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	2,98	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	3,07	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	2,53	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

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
218	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	96.037,55	20.604,95449802	4,6608960000
221	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	332.287,48	71.292,61841500	4,6608960000
210	04/11/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	53.060,68	19.958,98388841	2,6584860380
223	10/11/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,00	19.996.442,13	1.281,16030592	15.608,0718686000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
213	11/11/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.270.179,84	0,00	158.639,80179115	14,3102791000
225	11/11/2022	NTN-B 150830 (5,900000%)	19.996.442,13	0,00	4.935,00000000	4.051,9639574000
219	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	971.340,58	0,00	207.709,80690189	4,6764310000
222	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	638.866,90	175.048,33326940	3,6496600000
211	16/11/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	150.358,14	0,00	56.360,87429905	2,6677751520
224	22/11/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	3.273.761,04	0,00	209,50070700	15.626,4916089000
212	23/11/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.927,05	4.085,75080712	2,6744288910
214	29/11/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.546.175,42	107.426,96177521	14,3928060000
220	29/11/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.928,24	0,00	2.539,72228415	4,6966710000
230	05/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	56.652,90	21.097,39297100	2,6853033490
246	05/12/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	334.534,02	91.321,62068800	3,6632510000
239	05/12/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	98.117,39	26.784,23911300	3,6632510000
236	09/12/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.657.403,30	114.676,80400000	14,4528208000
229	12/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.039,93	4.100,90981500	2,6920684670
233	12/12/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3.983.349,11	0,00	3.440.405,44823200	1,1578138600
255	12/12/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	3.983.349,11	2.440.233,52987900	1,6323638960
231	13/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	54.775,81	20.336,99685000	2,6934070160
245	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	156.761,84	42.951,70874400	3,6497230000
238	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	40.301,51	11.042,34765000	3,6497230000
234	14/12/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.294.721,29	0,00	158.525,00100000	14,4754536000
228	15/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	150.358,14	0,00	55.768,13087100	2,6961301670
250	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	648.492,90	137.251,99670800	4,7248340000
244	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.064.833,30	0,00	225.369,46271500	4,7248340000
227	19/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.200,00	444,64041800	2,6988099840
252	19/12/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,00	15.982.920,13	1.012,20844781	15.790,1469493000
249	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	740.399,29	156.403,46271000	4,7339060000
235	21/12/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.270.014,11	0,00	156.412,66600000	14,5129814000
243	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.189.915,15	0,00	251.360,11361400	4,7339060000
251	21/12/2022	WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	983.986,66	0,00	62,19400213	15.821,2468451000
254	21/12/2022	NTN-B 150535 (6,310000%)	14.998.933,47	0,00	3.829,00000000	3.917,1933850000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
226	22/12/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	57.344,67	21.215,51203000	2,7029595100
248	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	334.683,16	70.662,18244300	4,7363830000
237	22/12/2022	BRAPRESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.560.363,89	107.458,69300000	14,5205925000
242	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	97.564,28	20.598,90010600	4,7363830000
247	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.443,24	0,00	2.625,92062600	4,7386200000
241	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	77.922,85	0,00	16.444,20738500	4,7386200000
240	28/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.202,76	0,00	253,42887300	4,7459470000
Total			464.061.745,20	458.124.099,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.498.279,64

Value-At-Risk: 0,36%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO		0,36	0,36			411.966.168,31	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,28%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,810000%)		0,20	0,00	0,18			40.806.209,20	9,91
NTN-B 150535 (6,310000%)		0,24	0,00	0,27			15.041.700,38	3,65
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,20	-0,00	0,19			74.705.692,66	18,13
NTN-B 150830 (5,900000%)		0,25	0,00	0,26			20.289.707,93	4,93
NTN-B 150840 (5,720000%)		0,24	0,01	0,25			53.269.166,72	12,93
Sub-total	0,55	0,14	0,01		-0,51	0,85	204.112.476,89	49,55

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		1,31	0,01	1,32			4.031.994,60	0,98
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	0,00	0,02			24.131.604,37	5,86
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,12	-0,00	0,17			2.928.602,57	0,71
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI		1,43	0,01	0,01			3.803.274,93	0,92
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,12	0,00	0,01			21.197.199,11	5,15
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,11	0,00	0,01			3.866.441,39	0,94
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,30	0,01	0,07			3.065.251,30	0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,41	0,01	0,03			3.154.692,61	0,77
BB PREV RF IDKA2		1,48	0,01	0,39			2.191.761,66	0,53
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,23	0,01	1,23			4.327.690,38	1,05
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,52	0,01	0,40			1.715.376,98	0,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,43	0,03	0,02			9.029.604,58	2,19
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,94	0,00	1,96			775.048,99	0,19
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,62	0,00	0,64			723.039,09	0,18
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	0,00	0,01			10.410.074,92	2,53
Sub-total	0,86	0,48	0,10		-0,09	1,04	95.351.657,48	23,15

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			3.443.572,68	0,84
BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL		1,29	0,03	0,06			10.451.512,11	2,54
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			7.218.241,87	1,75
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,43	0,12	0,05			38.060.750,82	9,24
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			46.554.687,12	11,30
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI		0,57	0,00	0,57			988.582,52	0,24
Sub-total	1,15	0,63	0,15		-0,06	1,05	106.717.347,12	25,90

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,69%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		10,69	0,11	18,04			5.784.686,82	1,40
Sub-total	24,56	10,69	0,11		-0,06	-0,26	5.784.686,82	1,40