



LDB
EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA -
2º TRIMESTRE 2023
CONSOLIDADO



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.06.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

98,49%

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

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| | | | Dia | Mês | Trim. | | |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (5,810000%) | 0,52 | 0,04 | 0,46 | 2,48 | 42.125.537,74 | 9,46 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (6,310000%) | 3,01 | 0,02 | 0,50 | 2,60 | 15.545.755,35 | 3,49 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,730000%) | 0,55 | -0,02 | 0,45 | 2,47 | 77.130.046,99 | 17,32 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (5,900000%) | 3,01 | 0,02 | 0,47 | 2,51 | 20.949.090,57 | 4,70 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,720000%) | 2,97 | 0,01 | 0,45 | 2,46 | 54.991.838,62 | 12,35 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 0,46 | 0,01 | 0,46 | 2,48 | 210.742.269,27 | 47,31 |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------|--------|---|---------------------|-------------------|------|-------|---------------|------------|-------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| ITAU | ITAU | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 0,02 | 0,05 | 1,08 | 3,14 | 10.139.599,62 | 2,28 | 39.378.624.159,13 | 0,03 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,07 | 0,06 | 1,13 | 3,23 | 34.355.425,68 | 7,71 | 14.603.622.203,04 | 0,24 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | 0,37 | 0,06 | 1,15 | 3,14 | 1.550.870,22 | 0,35 | 307.873.930,44 | 0,50 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI | 2,40 | 0,22 | 1,03 | 0,98 | 3.901.316,44 | 0,88 | 1.469.266.924,84 | 0,27 |
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,38 | 0,07 | 1,16 | 3,14 | 12.091.462,52 | 2,71 | 6.781.214.720,11 | 0,18 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,39 | 0,22 | 1,03 | 2,57 | 3.283.869,25 | 0,74 | 8.254.253.931,25 | 0,04 |
| BB | BB | BB PREV RF IDKA2 | 2,60 | 0,17 | 1,02 | 2,10 | 2.335.587,93 | 0,52 | 6.483.473.627,64 | 0,04 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,70 | 0,17 | 1,04 | 2,14 | 1.828.553,09 | 0,41 | 5.947.143.642,03 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 2,41 | 0,23 | 1,03 | 2,56 | 4.440.742,91 | 1,00 | 5.638.426.224,35 | 0,08 |
| SAFRA | SAFRA | SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI | 0,02 | 0,05 | 1,07 | 3,10 | 11.077.796,68 | 2,49 | 5.492.803.682,31 | 0,20 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|-------|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|-------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 0,94 | 0,09 | 1,10 | 3,03 | 85.005.224,34 | 19,08 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|----------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | 2,54 | 0,37 | 1,76 | 4,79 | 8.778.173,52 | 1,97 | 180.310.422,35 | 4,87 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,08 | 0,05 | 1,09 | 3,16 | 32.872.241,72 | 7,38 | 14.982.085.274,92 | 0,22 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 2,42 | 0,23 | 1,03 | 2,52 | 33.295.771,73 | 7,48 | 963.196.862,82 | 3,46 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,05 | 0,04 | 1,13 | 3,22 | 66.955.669,41 | 15,03 | 8.773.662.957,45 | 0,76 |
| WESTERN | WESTERN | WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI | 1,35 | 0,13 | 1,49 | 3,33 | 1.034.152,99 | 0,23 | 409.971.559,82 | 0,25 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 1,19 | 0,11 | 1,14 | 3,12 | 142.936.009,37 | 32,09 | | |
| Renda Fixa | | | 0,81 | 0,06 | 0,80 | 2,80 | 438.683.502,98 | 98,49 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,51%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|--------|---|------------------------|-------------------|-------------|--------------|---------------------|-------------|---------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| SAFRA | SAFRA | SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 15,55 | 0,93 | 6,03 | 11,19 | 6.733.019,58 | 1,51 | 45.784.533,44 | 14,71 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 15,55 | 0,93 | 6,03 | 11,19 | 6.733.019,58 | 1,51 | | |
| Investimentos Estruturados | | | 12,82 | 0,93 | 6,03 | 11,19 | 6.733.019,58 | 1,51 | | |
| Total | | | 0,86 | 0,07 | 0,88 | 2,92 | 445.416.522,56 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | | |
|-----------------------------------|---|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 210.742.269,27 | 47,31 | 0,00 | 43,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 85.005.224,34 | 19,08 | 0,00 | 20,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 142.936.009,37 | 32,09 | 0,00 | 26,00 | 60,00 | 0,00 | 60,00 |
| | Total Renda Fixa | 438.683.502,98 | 98,49 | | | | | 100,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 6.733.019,58 | 1,51 | 0,00 | 3,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 6.733.019,58 | 1,51 | | | | | 15,00 |
| Total | | 445.416.522,56 | 100,00 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Trimestre (R\$) |
|--|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|---------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 0,46 42,89 | 2,48 78,94 | 2,48 78,94 | 6,23 95,88 | | 964.554,68 | 5.165.213,80 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,10 102,77 | 3,03 96,46 | 3,03 96,46 | 6,57 101,07 | 12,08 89,17 | 925.590,29 | 2.449.002,05 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 1,14 106,11 | 3,12 99,21 | 3,12 99,21 | 6,81 104,77 | 11,79 87,03 | 1.613.886,87 | 4.307.138,75 |
| Artigo 10º I % do CDI | 6,03 562,15 | 11,19 355,64 | 11,19 355,64 | 16,39 252,27 | 16,38 120,93 | 382.680,18 | 677.464,50 |
| FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total) | | | | | | 3.886.712,02 | 12.598.819,10 |

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%) | 41.932.649,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 42.125.537,74 | 192.888,61 | 1.039.446,42 |
| NTN-B 150535 (6,310000%) | 15.468.438,52 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.545.755,35 | 77.316,83 | 401.533,13 |
| NTN-B 150545 (5,730000%) | 76.781.272,83 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 77.130.046,99 | 348.774,16 | 1.889.776,30 |
| NTN-B 150830 (5,900000%) | 20.851.621,97 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.949.090,57 | 97.468,60 | 512.118,80 |
| NTN-B 150840 (5,720000%) | 54.743.732,14 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 54.991.838,62 | 248.106,48 | 1.322.339,15 |
| | | | | | 210.742.269,27 | 964.554,68 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BB PREV RF IDKA2 | 2.312.016,87 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.335.587,93 | 23.571,06 | 48.020,12 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 4.395.429,82 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.440.742,91 | 45.313,09 | 110.713,44 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 11.952.977,76 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.091.462,52 | 138.484,76 | 368.181,73 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1.809.673,37 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.828.553,09 | 18.879,72 | 38.235,98 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|---|----------------|--------------|---------------|-------------|---------------|--------------------------------|--|
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3.250.340,29 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.283.869,25 | 33.528,96 | 82.237,54 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 34.082.617,30 | 1.155.296,52 | -1.264.814,59 | 0,00 | 34.355.425,68 | 382.326,45 | 1.074.266,40 |
| ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 10.031.181,88 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.139.599,62 | 108.417,74 | 308.852,35 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI | 3.861.360,48 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.901.316,44 | 39.955,96 | 37.675,50 |
| ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | 1.533.240,93 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.550.870,22 | 17.629,29 | 47.239,43 |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI | 10.960.313,42 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.077.796,68 | 117.483,26 | 333.579,56 |
| | | | | | 85.005.224,34 | 925.590,29 | |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|--------------|---------------|-------------|----------------|--------------------------------|--|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 32.448.722,60 | 176.973,25 | -108.021,94 | 0,00 | 32.872.241,72 | 354.567,81 | 1.003.911,52 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 68.198.928,04 | 200.000,00 | -2.214.757,36 | 0,00 | 66.955.669,41 | 771.498,73 | 2.191.595,71 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 32.956.003,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 33.295.771,73 | 339.768,64 | 774.293,95 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | 5.902.149,03 | 2.743.106,22 | 0,00 | 0,00 | 8.778.173,52 | 132.918,27 | 303.973,54 |
| WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI | 1.019.019,57 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.034.152,99 | 15.133,42 | 33.364,03 |
| | | | | | 142.936.009,37 | 1.613.886,87 | |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|--------------|--------------------------------|--|
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 6.350.339,40 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.733.019,58 | 382.680,18 | 677.464,50 |
| | | | | | 6.733.019,58 | 382.680,18 | |

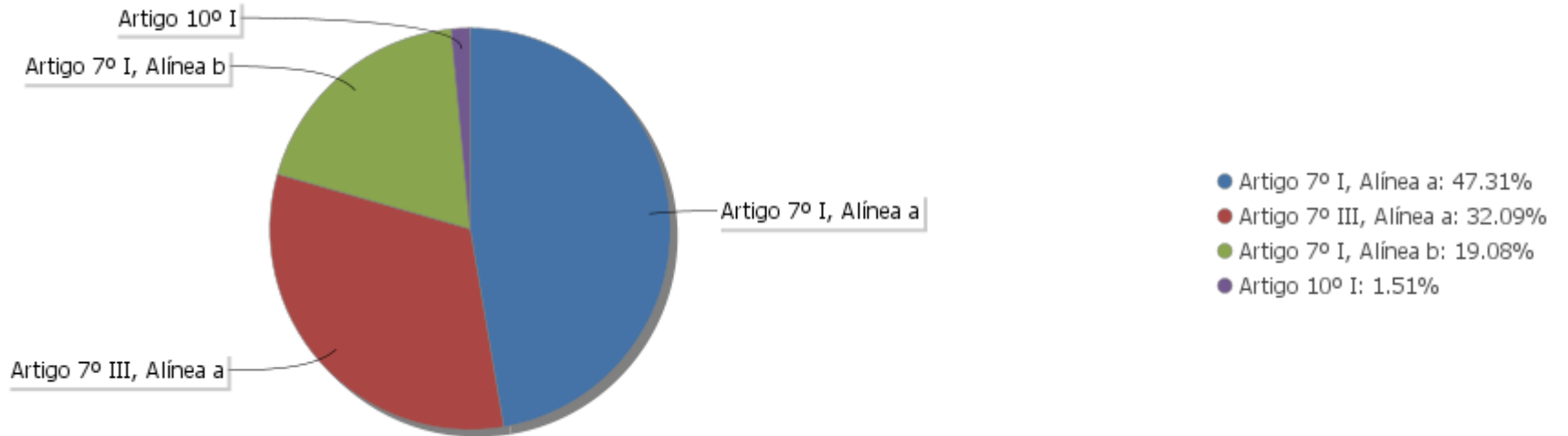
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

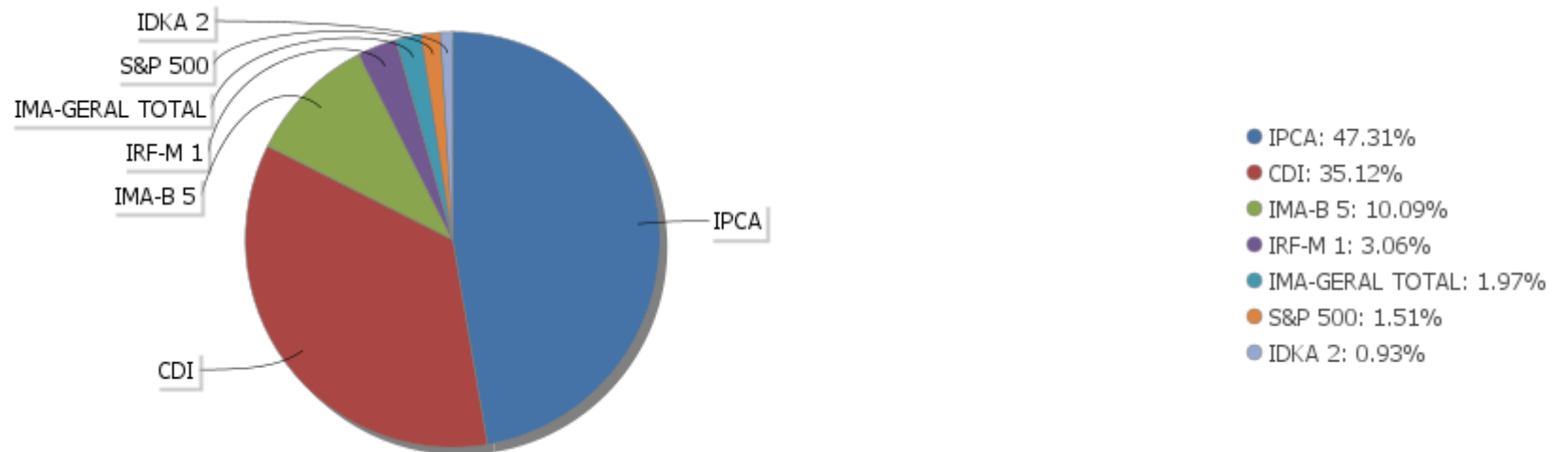
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo |
|-----------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|-------------------|
| de 0 a 30 dias | 227.941.233,71 | 51,17 | 227.941.233,71 | 51,17 | |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00 | 0,00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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

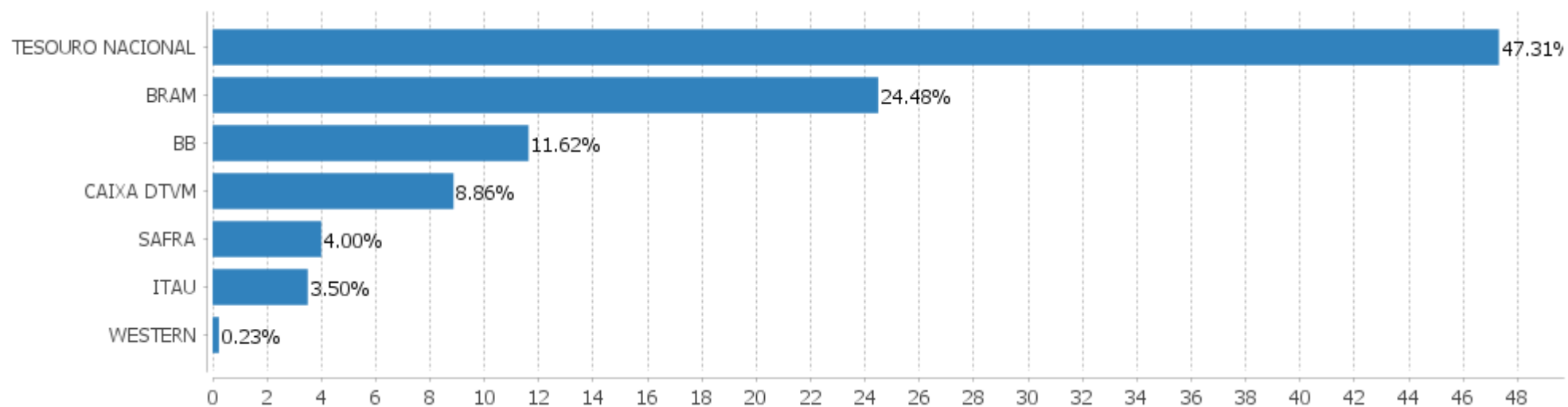


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|------|-------|-------|-------|-----------|
| 2023 | 1,15 | 1,03 | 1,38 | 0,94 | 1,07 | 0,88 | | | | | | | 6,62 |
| IPCA + 5,08% | 0,97 | 1,20 | 1,17 | 0,97 | 0,66 | 0,33 | | | | | | | 5,41 |
| p.p. indexador | 0,18 | -0,17 | 0,21 | -0,03 | 0,40 | 0,55 | | | | | | | 1,21 |
| 2022 | 0,33 | 0,89 | 1,61 | 1,00 | 0,89 | 0,61 | 0,53 | 0,76 | 0,87 | 1,05 | 0,64 | 0,93 | 10,59 |
| IPCA + 5,00% | 0,95 | 1,38 | 2,05 | 1,43 | 0,90 | 1,08 | -0,28 | 0,08 | 0,12 | 0,98 | 0,80 | 1,05 | 11,05 |
| p.p. indexador | -0,62 | -0,49 | -0,45 | -0,43 | -0,01 | -0,47 | 0,81 | 0,68 | 0,75 | 0,07 | -0,16 | -0,12 | -0,47 |
| 2021 | | | | | | | | | | -0,89 | 1,68 | 0,81 | 1,59 |
| IPCA + 6,00% | | | | | | | | | | 1,72 | 1,42 | 1,27 | 4,47 |
| p.p. indexador | | | | | | | | | | -2,61 | 0,26 | -0,46 | -2,88 |

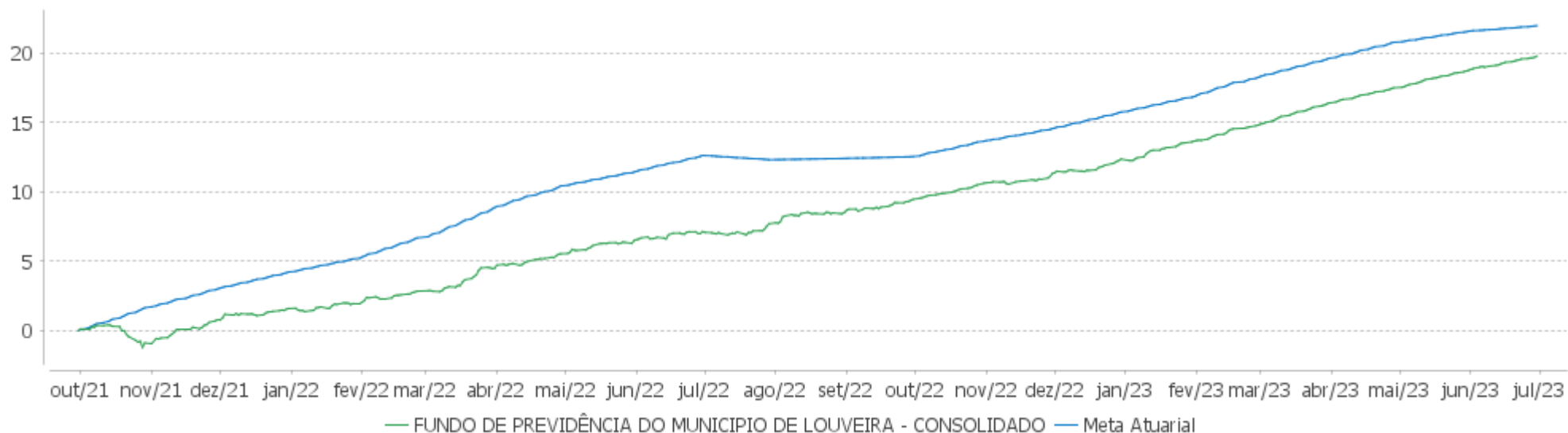
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

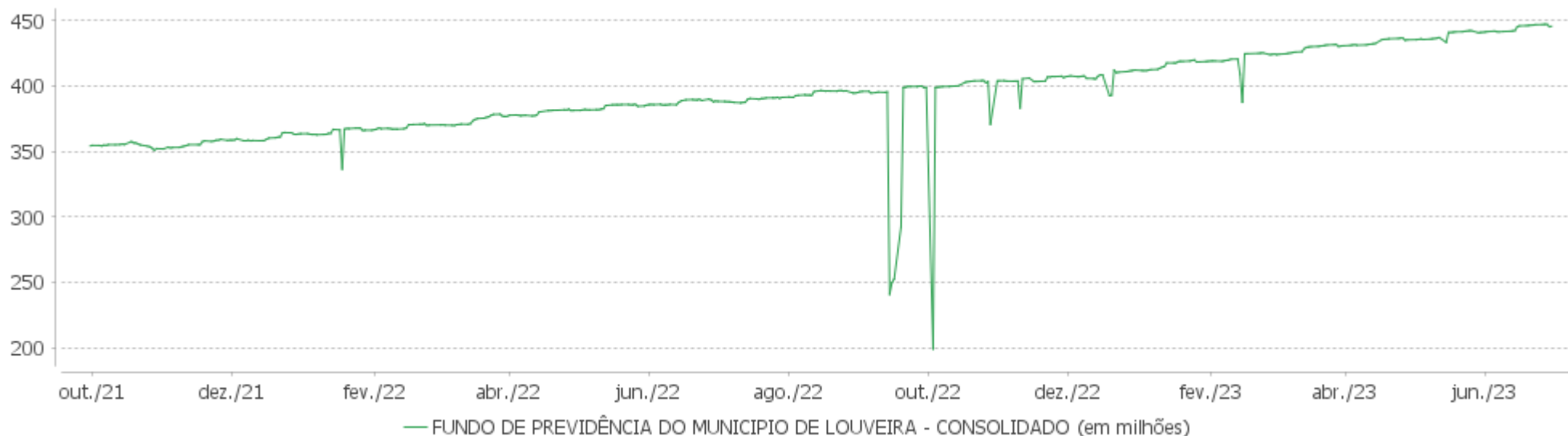
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 9 | 42,86 | 03 meses | 2,92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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

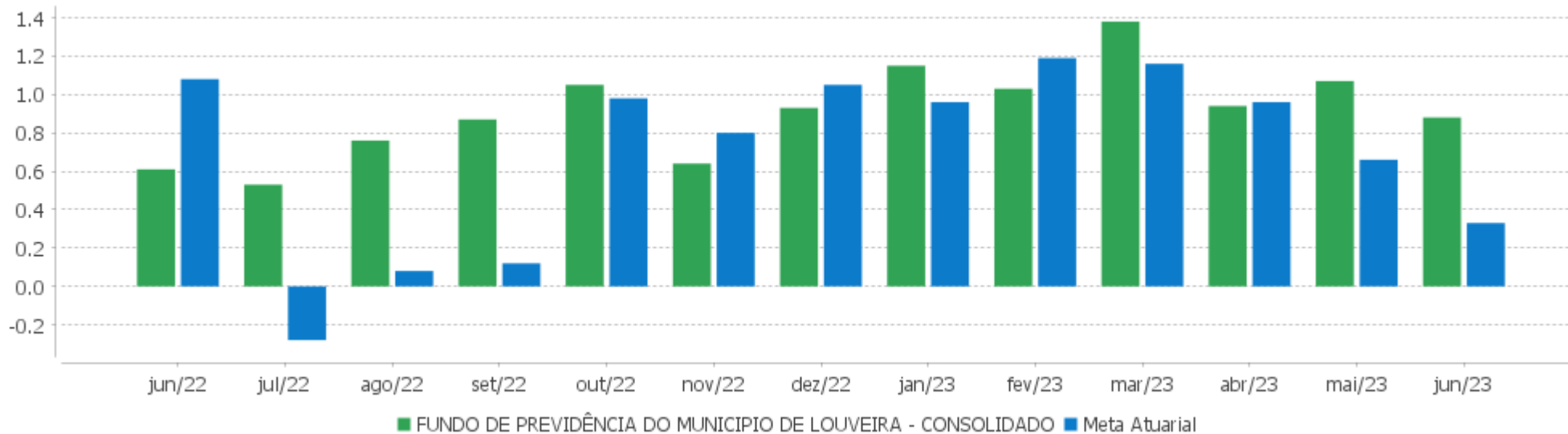


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|----------------|
| NTN-B 150535 (6,310000%) Var. IPCA p.p. | 0,50 0,58 | 2,60 1,84 | 2,60 1,84 | 6,48 3,61 | 6,80 3,64 | | |
| NTN-B 150830 (5,900000%) Var. IPCA p.p. | 0,47 0,55 | 2,51 1,75 | 2,51 1,75 | 6,28 3,41 | 6,49 3,33 | 18,99 3,57 | |
| NTN-B 150840 (5,720000%) Var. IPCA p.p. | 0,45 0,53 | 2,46 1,70 | 2,46 1,70 | 6,19 3,32 | 6,37 3,21 | 18,82 3,40 | |
| NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p. | 0,45 0,53 | 2,47 1,70 | 2,47 1,70 | 6,20 3,32 | 9,40 6,24 | 22,23 6,81 | |
| NTN-B 150535 (5,810000%) Var. IPCA p.p. | 0,46 0,54 | 2,48 1,72 | 2,48 1,72 | 6,23 3,36 | 9,55 6,39 | 22,38 6,95 | |
| ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p. | 1,15 -0,04 | 3,14 -0,08 | 3,14 -0,08 | 6,57 -0,11 | 13,60 -0,22 | 21,58 -0,42 | 23,74 -0,74 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 1,03 -0,02 | 2,57 0,02 | 2,57 0,02 | 7,00 -0,04 | 10,18 -0,05 | 21,01 -0,30 | 28,00 -0,68 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 1,03 -0,02 | 2,50 -0,04 | 2,50 -0,04 | 6,94 -0,10 | 10,04 -0,19 | 20,89 -0,43 | 27,91 -0,77 |
| BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p. | 1,02 0,05 | 2,10 0,11 | 2,10 0,11 | 6,56 -0,22 | 9,43 0,15 | 20,20 -0,12 | 27,87 -0,96 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p. | 1,16 -0,03 | 3,14 -0,08 | 3,14 -0,08 | 6,49 -0,18 | 13,48 -0,34 | 21,33 -0,67 | 23,34 -1,15 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 1,03 -0,02 | 2,56 0,01 | 2,56 0,01 | 6,99 -0,05 | 10,05 -0,18 | 20,76 -0,56 | 27,74 -0,94 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 1,04 0,07 | 2,14 0,15 | 2,14 0,15 | 6,60 -0,19 | 9,23 -0,05 | 19,78 -0,54 | 27,45 -1,38 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI | 1,13 105,24 | 3,23 102,54 | 3,23 102,54 | 6,55 100,75 | 13,52 99,84 | 23,55 100,78 | 25,75 98,41 |
| ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI | 1,08 100,82 | 3,14 99,87 | 3,14 99,87 | 6,48 99,65 | 13,47 99,46 | 23,38 100,02 | 25,80 98,61 |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI | 1,07 99,99 | 3,10 98,70 | 3,10 98,70 | 6,41 98,70 | 13,44 99,24 | 23,26 99,52 | 25,67 98,10 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p. | 1,03 -0,02 | 2,52 -0,02 | 2,52 -0,02 | 6,94 -0,10 | 9,94 -0,29 | 20,35 -0,97 | 26,59 -2,09 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 1,13 | 3,22 | 3,22 | 6,53 | 13,87 | 24,53 | 27,55 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|-----------|------------|-----------|------------|-------------|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| BB PREV RF IDKA2 | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,10 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,20 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | D+0 | D+0 | D+1 du | D+1 du | | 0,25 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,15 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,18 |
| ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,18 |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | D+0 | D+0 | D+1 | D+2 | | |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI | | | D+0 | D+0 | | 0,10 |
| WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 0,40 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 1,19 | 3,22 | 3,22 | 6,68 | 13,82 | 22,00 | 24,49 | 31,97 | 41,51 |
| IRF-M 1+ | 2,65 | 6,89 | 6,89 | 11,41 | 18,80 | 17,59 | 16,30 | 30,02 | 54,96 |
| IRF-M TOTAL | 2,12 | 5,52 | 5,52 | 9,62 | 16,74 | 18,79 | 18,96 | 30,63 | 51,17 |
| IMA-B 5 | 1,05 | 2,55 | 2,55 | 7,04 | 10,23 | 21,32 | 28,68 | 40,02 | 60,53 |
| IMA-B 5+ | 3,37 | 10,90 | 10,90 | 14,91 | 16,34 | 13,82 | 23,52 | 25,96 | 77,32 |
| IMA-B TOTAL | 2,39 | 7,10 | 7,10 | 11,37 | 13,52 | 17,81 | 26,56 | 32,82 | 71,02 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,74 | 4,83 | 4,83 | 8,64 | 14,01 | 20,10 | 24,37 | 32,47 | 53,53 |
| IDKA 2 | 0,97 | 1,99 | 1,99 | 6,79 | 9,28 | 20,32 | 28,82 | 40,12 | 58,67 |
| IDKA 20 | 5,91 | 19,68 | 19,68 | 22,33 | 23,20 | 6,46 | 19,60 | 13,99 | 89,13 |
| CDI | 1,07 | 3,15 | 3,15 | 6,50 | 13,54 | 23,37 | 26,17 | 32,00 | 40,34 |

Renda Variável

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

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 | 0,69 | 2,73 | 2,73 | 7,06 | 8,17 | -0,23 | 26,33 | 90,25 | 104,62 |

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-----|------------|--|--------------|--------------|--------------------|---------------|
| 81 | 03/04/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.700,00 | 607,41560063 | 2,7987427360 |
| 82 | 06/04/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 66.266,76 | 23.641,78875695 | 2,8029503470 |
| 77 | 06/04/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 365.799,59 | 74.450,42680821 | 4,9133310000 |
| 73 | 06/04/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 111.626,30 | 22.719,06777703 | 4,9133310000 |
| 74 | 11/04/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 72.460,84 | 0,00 | 14.732,66999812 | 4,9183780000 |
| 78 | 12/04/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 14.170,38 | 0,00 | 2.879,79680601 | 4,9206180000 |
| 79 | 14/04/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4.031,37 | 0,00 | 818,53915440 | 4,9250790000 |
| 83 | 17/04/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 176.973,25 | 0,00 | 62.956,45804423 | 2,8110420360 |
| 71 | 17/04/2023 | BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 2.451.572,35 | 0,00 | 162.233,44785580 | 15,1113866000 |
| 80 | 17/04/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 761.524,34 | 154.554,28193007 | 4,9272290000 |
| 75 | 17/04/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 984.635,88 | 0,00 | 199.835,62363349 | 4,9272290000 |
| 84 | 18/04/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 11.039,93 | 3.925,42343388 | 2,8124176120 |
| 85 | 20/04/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 6.810,60 | 2.419,23459835 | 2,8151879130 |
| 76 | 27/04/2023 | BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,00 | 1.898.225,82 | 125.191,69478435 | 15,1625539000 |
| 97 | 05/05/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 82.365,88 | 29.125,74097490 | 2,8279411010 |
| 93 | 05/05/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 413.204,20 | 83.368,34553044 | 4,9563680000 |
| 88 | 05/05/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 120.412,40 | 24.294,48337977 | 4,9563680000 |
| 94 | 09/05/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 14.170,38 | 0,00 | 2.856,05045218 | 4,9615300000 |
| 89 | 09/05/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2.992,45 | 0,00 | 603,13048596 | 4,9615300000 |
| 98 | 10/05/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 18.469,13 | 6.520,71765774 | 2,8323768900 |
| 90 | 11/05/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 78.037,78 | 0,00 | 15.708,29328484 | 4,9679350000 |
| 95 | 11/05/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4.562,48 | 0,00 | 918,38560690 | 4,9679350000 |
| 99 | 15/05/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 2.450,00 | 863,59108765 | 2,8369908340 |
| 104 | 16/05/2023 | ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI | 3.863.640,94 | 0,00 | 90.931,15471788 | 42,4897380000 |
| 100 | 16/05/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 176.973,25 | 0,00 | 62.349,67869203 | 2,8383987490 |
| 87 | 16/05/2023 | BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 2.984.277,42 | 0,00 | 1.212.325,64638391 | 2,4616137000 |
| 91 | 16/05/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 986.758,36 | 0,00 | 198.289,42233611 | 4,9763540000 |
| 96 | 16/05/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 668.811,49 | 134.397,89251327 | 4,9763540000 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|--|----------------------|---------------------|------------------|---------------|
| 92 | 22/05/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 61,00 | 12,23571606 | 4,9854050000 |
| 101 | 24/05/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 6.594,56 | 2.316,24962452 | 2,8470851890 |
| 86 | 29/05/2023 | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,00 | 1.819.871,85 | 118.720,13900785 | 15,3290913000 |
| 103 | 31/05/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 14.536,12 | 5.092,09737159 | 2,8546429770 |
| 102 | 31/05/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 14.536,12 | 0,00 | 5.092,09737159 | 2,8546429770 |
| 121 | 01/06/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 9.120,00 | 3.193,14493852 | 2,8561183960 |
| 122 | 01/06/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 5.416,12 | 1.896,32194785 | 2,8561183960 |
| 128 | 06/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 372.222,10 | 74.194,01519870 | 5,0168750000 |
| 111 | 06/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 109.845,80 | 21.895,26348574 | 5,0168750000 |
| 123 | 06/06/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 69.011,59 | 24.125,07033173 | 2,8605757020 |
| 129 | 12/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 14.170,38 | 0,00 | 2.820,28200073 | 5,0244550000 |
| 112 | 12/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2.992,45 | 0,00 | 595,57703273 | 5,0244550000 |
| 113 | 13/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 77.284,26 | 0,00 | 15.374,79976859 | 5,0266840000 |
| 130 | 14/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4.562,48 | 0,00 | 907,16946378 | 5,0293580000 |
| 105 | 15/06/2023 | BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | 2.706.518,30 | 0,00 | 516.510,12053373 | 5,2400102000 |
| 114 | 15/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 9.427,78 | 0,00 | 1.873,56667215 | 5,0319960000 |
| 124 | 15/06/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 6.834,30 | 2.381,74759207 | 2,8694476370 |
| 132 | 16/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 782.746,69 | 155.465,49475675 | 5,0348580000 |
| 106 | 16/06/2023 | BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | 21.742,17 | 0,00 | 4.144,46956675 | 5,2460682000 |
| 115 | 16/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1.011.837,25 | 0,00 | 200.966,39269668 | 5,0348580000 |
| 127 | 16/06/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 176.973,25 | 0,00 | 61.641,98201699 | 2,8709857180 |
| 116 | 19/06/2023 | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 35.021,92 | 0,00 | 6.952,12073715 | 5,0375880000 |
| 125 | 20/06/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 11.639,93 | 4.050,10296010 | 2,8739837270 |
| 107 | 22/06/2023 | BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | 14.845,75 | 0,00 | 2.823,38914721 | 5,2581310000 |
| 126 | 26/06/2023 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 6.000,00 | 2.083,42397457 | 2,8798747030 |
| 108 | 29/06/2023 | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,00 | 2.007.309,68 | 129.390,07220605 | 15,5136298000 |
| 110 | 30/06/2023 | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 200.000,00 | 0,00 | 12.886,60657350 | 15,5199896000 |
| 109 | 30/06/2023 | BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,00 | 207.447,68 | 13.366,48318373 | 15,5199896000 |
| Total | | | 16.105.169,24 | 9.957.363,86 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

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

Value-At-Risk: 0,16%

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

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

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

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | | 0,01 | -0,00 | 0,01 | | | 10.139.599,62 | 2,28 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 0,05 | 0,00 | 0,05 | | | 34.355.425,68 | 7,71 |
| ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | | 0,21 | -0,00 | 0,30 | | | 1.550.870,22 | 0,35 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI | | 0,90 | 0,01 | 0,01 | | | 3.901.316,44 | 0,88 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | | 0,21 | 0,00 | 0,01 | | | 12.091.462,52 | 2,71 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 0,91 | 0,01 | 0,03 | | | 3.283.869,25 | 0,74 |
| BB PREV RF IDKA2 | | 0,99 | 0,00 | 0,15 | | | 2.335.587,93 | 0,52 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 0,98 | 0,00 | 0,15 | | | 1.828.553,09 | 0,41 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | | 0,92 | 0,01 | 0,03 | | | 4.440.742,91 | 1,00 |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI | | 0,01 | -0,00 | 0,01 | | | 11.077.796,68 | 2,49 |
| Sub-total | 0,38 | 0,20 | 0,03 | | 0,08 | 1,10 | 85.005.224,34 | 19,08 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL | | 0,84 | 0,01 | 0,07 | | | 8.778.173,52 | 1,97 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | | 0,02 | 0,00 | 0,02 | | | 32.872.241,72 | 7,38 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | | 0,80 | 0,05 | 0,13 | | | 33.295.771,73 | 7,48 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | | 0,03 | -0,00 | 0,03 | | | 66.955.669,41 | 15,03 |
| WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI | | 0,59 | 0,00 | 0,59 | | | 1.034.152,99 | 0,23 |
| Sub-total | 0,53 | 0,23 | 0,06 | | 0,12 | 1,14 | 142.936.009,37 | 32,09 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,45%

Artigo 10º I

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