www.louveira.sp.gov.br

DIÁRIO OFICIAL

MUNICÍPIO DE LOUVEIRA

SUMÁRIO

Secretaria de Saúde 2
Vigilância Sanitária 2
Laudas 2

Secretaria de Administração 3
Atos Oficiais 3
Decretos 3
Outros Atos 5

EXPEDIENTE

O Diário Oficial do Município de Louveira, veiculado exclusivamente na forma eletrônica, é uma publicação das entidades da Administração Direta e Indireta deste Município, sendo referidas entidades inteiramente responsáveis pelo conteúdo aqui publicado.

ACERVO

As edições do Diário Oficial Eletrônico de Louveira poderão ser consultadas através da internet, por meio do seguinte endereço eletrônico: www.louveira.sp.gov.br
Para pesquisa por qualquer termo e utilização de filtros, acesse www.imprensaoficialmunicipal.com.br/louveira
As consultas e pesquisas são de acesso gratuito e independente de qualquer cadastro.

ENTIDADES

Prefeitura Municipal de Louveira
CNPJ 46.363.933/0001-44
Rua Catharina Calssavara Caldana, 451
Telefone: (19) 3878-9700
Site: www.louveira.sp.gov.br
Diário: www.imprensaoficialmunicipal.com.br/louveira

Câmara Municipal de Louveira
CNPJ 49.597.552/0001-18
Rua Wagner Luiz Bevilacqua, 35
Telefone: (19) 3878-9420
Site: www.louveira.sp.leg.br

Diário Oficial instituído conforme Decreto Municipal nº 5.194, de 13 de Março de 2019 e assinado Eletronicamente com Certificado Padrão ICPBrasil, em conformidade com a MP nº 2.200-2, de 2001

O Município de Louveira garante a autenticidade deste documento, desde que visualizado através do site www.louveira.sp.gov.br

Compilado e também disponível em www.imprensaoficialmunicipal.com.br/louveira

SECRETARIA DE SAÚDE

Vigilância Sanitária

Laudas

PREFEITURA MUNICIPAL DE LOUVEIRA
SECRETARIA DA SAÚDE
ATOS DA VIGILÂNCIA SANITÁRIA

1. Comunicado de DEFERIMENTO

Referente à licença protocolo: 4295/2019-11 Data de Protocolo: 06/01/2023

CEVS: 352730601-493-000045-1-0 Data de Validade: 17/04/2024

Razão Social: UNIDOCK´S ASSESSORIA E LOGÍSTICA DE MATERIAIS LTDA

CNPJ/CPF: 00.233.065/0012-30

Endereço: Estrada da Cruz Grande, 1700 setor 02 Santo Antônio Município: Louveira

CEP: 13290-000 UF: SP

Resp. Legal: EDUARDO BARBOSA NOGUEIRA CPF: 03589189606

Resp. Técnico: LUANA GALLANI PACHECO CPF: 35077510890

CBO: 223405 Conselho Prof.: CRF No. Inscr.:83590 UF:SP

O Diretor da VIGILÂNCIA SANITÁRIA DE LOUVEIRA.

Defere a Renovação de Licença Sanitária do Estabelecimento.

O(s) responsável(s) assume(m) cumprir a legislação vigente e observar as boas práticas referentes às atividades prestadas, respondendo civil e criminalmente pelo não cumprimento de tais exigências, ficando inclusive sujeito(s) ao cancelamento deste documento

2. Comunicado de DEFERIMENTO

Referente à licença protocolo: 1964/2022-1 Data de Protocolo: 17/04/2023

CEVS: 352730601-931-000050-1-0 Data de Validade: 18/04/2024

Razão Social: LOUISE ABREU STUDIO PERSONAL E REABILITAÇÃO LTDA

CNPJ/CPF: 05.283.165/0001-31

Endereço: Rua Frederico Zanella, 90 sala 3 Vila Nova Município: Louveira Cep: 13290-000 UF: SP

Resp. Legal: LOUISE CRISTINA DE ABREU CPF: 21495545857

Resp. Técnico: LOUISE CRISTINA DE ABREU CPF: 21495545857

CBO: Conselho Prof.: CREF No. Inscr.:040320-p/sp UF:SP

Resp. Técnico: SANDRA POLOZZI PEDROSO CPF: 19551619846

CBO: Conselho Prof.: CREFITO No. Inscr.:226865-f UF:SP

O Diretor da VIGILÂNCIA SANITÁRIA DE LOUVEIRA.

Defere a Renovação de Licença Sanitária do Estabelecimento.

O(s) responsável(s) assume(m) cumprir a legislação vigente e observar as boas práticas referentes às atividades prestadas, respondendo civil e criminalmente pelo não cumprimento de tais exigências, ficando inclusive sujeito(s) ao cancelamento deste documento

3. Comunicado de DEFERIMENTO

Referente à licença protocolo: 3596/2014-5 Data de Protocolo: 10/04/2023

CEVS: 352730601-931-000047-1-5 Data de Validade: 18/04/2024

Razão Social: RONERIO ALMEIDA BATISTA ACADEMIA CNPJ/CPF: 17.848.386/0001-99 Endereço: Rua João Verardo, 105 Sala 3 Santo Antônio Município: Louveira CEP: 13290-000 UF: SP

Resp. Legal: RONERIO DE ALMEIDA BATISTA CPF: 00362065551

Resp. Técnico: RONERIO DE ALMEIDA BATISTA CPF: 00362065551

CBO: Conselho Prof.: CREF No. Inscr.:157554-G UF:SP

O Diretor da VIGILÂNCIA SANITÁRIA DE LOUVEIRA.

Defere a Renovação de Licença Sanitária do Estabelecimento.

O(s) responsável(s) assume(m) cumprir a legislação vigente e observar as boas práticas referentes às atividades prestadas, respondendo civil e criminalmente pelo não cumprimento de tais exigências, ficando inclusive sujeito(s) ao cancelamento deste documento

4. Comunicado de DEFERIMENTO

Referente à licença protocolo: 2400/2008-16 Data de Protocolo: 03/03/2023

CEVS: 352730601-863-000072-1-8 Data de Validade: 20/04/2024

Razão Social: UNIMED JUNDIAÍ COOPERATIVA DE TRABALHO MÉDICO

CNPJ/CPF: 56.727.134/0011-35

Endereço: Rua Armando Steck, 317 Vila Bossi Município: Louveira CEP: 13290-000 UF: SP

Resp. Legal: NILTON JESUS FERNANDES CPF: 01703524802

Resp. Técnico: VALÉRIO DELAMANHA CPF: 77487176800

CBO: 06149 Conselho Prof.: CRM No. Inscr.:31.458 UF:SP

O Diretor da VIGILÂNCIA SANITÁRIA DE LOUVEIRA.

Defere a Renovação de Licença Sanitária do Estabelecimento.

O(s) responsável(s) assume(m) cumprir a legislação vigente e observar as boas práticas referentes às atividades prestadas, respondendo civil e criminalmente pelo não cumprimento de tais exigências, ficando inclusive sujeito(s) ao cancelamento deste documento

.....

SECRETARIA DE ADMINISTRAÇÃO

Atos Oficiais

Decretos

Prefeitura Municipal de Louveira
Secretaria de Negócios Jurídicos

DECRETO Nº 6.251, DE 10 DE MARÇO DE 2023.

Dispõe sobre a abertura de crédito adicional suplementar

ESTANISLAU STECK, Prefeito Municipal de Louveira, usando de suas atribuições legais e nos Termos do inciso II do Artigo 4º da Lei Municipal 02829, de 08 de dezembro de 2022,

D E C R E T A:

Art. 1º Fica aberto no orçamento do Fundo de Previdência do Município de Louveira um crédito adicional suplementar no valor de R$ 135.000,00 (cento e trinta e cinco mil reais), destinado à cobertura de despesas das dotações conforme tabela I a este anexada que faz parte integrante deste Decreto.

Art. 2º O crédito aberto no artigo anterior, será coberto com os recursos a que alude o inciso I, do parágrafo 1º do artigo 43 da Lei Federal Nº 4.320/64.

Art. 3º Este decreto entrará em vigor na data de sua publicação.

Art. 4º Revogam-se as disposições em contrário.

Louveira, 10 de março de 2023.

ESTANISLAU STECK
Prefeito Municipal de Louveira

DANIEL ANTONIO ANHOLON PEDRO
Secretário de Negócios Jurídicos

ANDERSON RICARDO FINAMORE
Gestor do Fundo de Previdência

Tabela I

Suplementações

Ficha: 01223

Órgão:	03	FUNDO DE PREVIDÊNCIA
Unidade:	030100	FUNDO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA
SubUnidade:	030101	Fundo de Previdência do Município de Louveira
Função:	4	Administração
SubFunção:	122	Administração Geral
Programa:	72	ADMINISTRACAO DO RPPS
Proj. Atividade:	2387	MANUTENÇÃO DAS ATIVIDADES ADMINISTRATIVAS DO FUNDO
Categoria:	3	DESPESAS CORRENTES
Grupo:	1	PESSOAL E ENCARGOS SOCIAIS
Modalidade:	90	APLICAÇÕES DIRETAS
Elemento:	11	VENCIMENTOS E VANTAGENS FIXAS - PESSOAL CIVIL
Fonte de Recurso:	03	Recursos Próprios de Fundos Especiais de Despesa - Vinculados
Código de Aplicação:	11000	Geral

Valor: R$ 85.000,00

Ficha: 01370

Órgão:	03	FUNDO DE PREVIDÊNCIA
Unidade:	030100	FUNDO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA
SubUnidade:	030101	Fundo de Previdência do Município de Louveira
Função:	4	Administração
SubFunção:	122	Administração Geral
Programa:	72	ADMINISTRACAO DO RPPS
Proj. Atividade:	2387	MANUTENÇÃO DAS ATIVIDADES ADMINISTRATIVAS DO FUNDO
Categoria:	3	DESPESAS CORRENTES
Grupo:	3	OUTRAS DESPESAS CORRENTES
Modalidade:	90	APLICAÇÕES DIRETAS
Elemento:	36	OUTROS SERVIÇOS DE TERCEIROS - PESSOA FÍSICA
Fonte de Recurso:	03	Recursos Próprios de Fundos Especiais de Despesa - Vinculados
Código de Aplicação:	11000	Geral

Valor: R$ 50.000,00

Total Suplementações: **R$ 135.000,00**

Outros Atos


LDB
EMPRESAS
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA -
DEZEMBRO 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.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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 (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira
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 (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
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	12,43	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	11,85	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	9,60	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	11,73	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	11,74	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	9,42	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	9,67	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	9,32	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	9,52	4.327.690,38	1,05	164.124.316,76	2,64

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,04	1,23	9,04	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	9,51	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	7,83	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	7,27	0,00	0,00	0,00	
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	1,14	10,70	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	6,76	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**	**10,77**	**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	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,08	0,05	1,10	12,35	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	9,30	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	12,59	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	9,29	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	13,00	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**	**10,60**	**106.717.347,12**	**25,90**		
		Renda Fixa	**1,20**	**0,04**	**0,95**	**10,67**	**406.181.481,49**	**98,60**		

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 1,40%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
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**	**4,00**	**5.784.686,82**	**1,40**		
		Investimentos Estruturados	**8,63**	**3,90**	**-0,26**	**4,00**	**5.784.686,82**	**1,40**		
		Total	**1,22**	**0,09**	**0,93**	**10,59**	**411.966.168,31**	**100,00**		

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea 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**					

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,85 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	10,77 87,02	2,76 86,26	5,17 78,14	10,77 87,02	984.568,50	22.642.972,18
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 93,34	10,60 85,71	2,77 86,46	4,66 70,46	10,60 85,71	1.144.546,49	11.895.984,97
Artigo 10º I % do CDI	-0,26 -22,90	4,00 32,33	-3,59 -112,21	-0,01 -0,22	4,00 32,33	-14.918,40	-208.344,37
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						**3.760.414,30**	**38.729.663,69**

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150535 (5,810000%)	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$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3.998.784,69	0,00	-3.983.349,11	0,00	0,00	-15.435,58	269.887,15
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	772.332,17
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	376.320,11
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	1.387.034,83

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
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	4.008.506,03
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	2.157.594,52
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	730.786,80
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	929.221,38
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	3.050.290,08
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	3.461.293,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	714.894,50	0,00	0,00	0,00	723.039,09	8.144,59	598.184,84
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	777.925,64	0,00	0,00	0,00	775.048,99	-2.876,65	1.035.448,16
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	957.913,39
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	2.895.111,02	0,00	0,00	0,00	2.928.602,57	33.491,55	957.838,08
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	410.074,92
					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$)	Resultado Financ. Ano (R$)
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	3.406.001,15	0,00	0,00	0,00	3.443.572,68	37.571,53	378.508,90
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	1.434.899,93
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	4.305.248,83
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	4.460.913,83
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	10.372.541,22	0,00	0,00	0,00	10.451.512,11	78.970,89	1.267.112,52
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$)	Resultado Financ. Ano (R$)
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	5.799.605,22	0,00	0,00	0,00	5.784.686,82	-14.918,40	-215.313,18
					5.784.686,82	0,00	0,00

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
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	

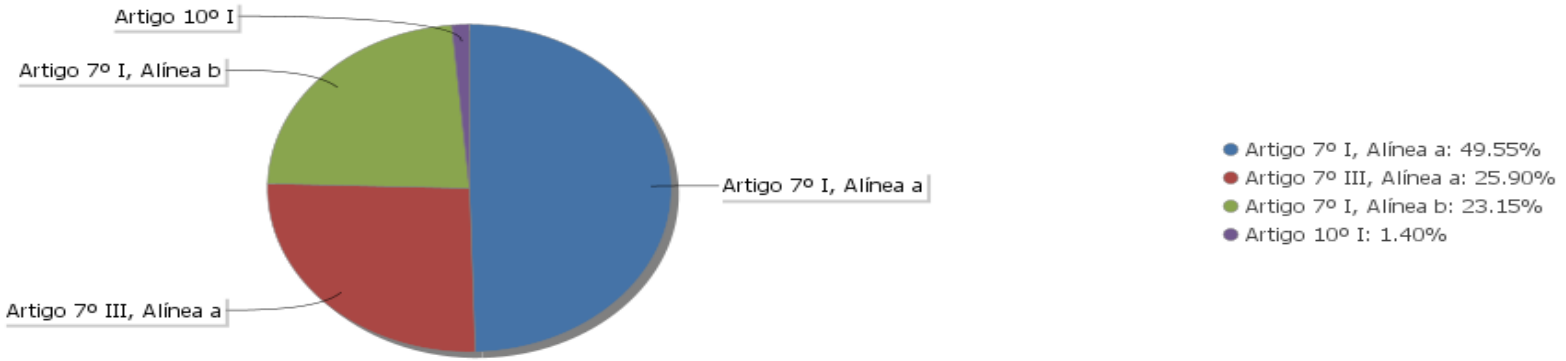
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

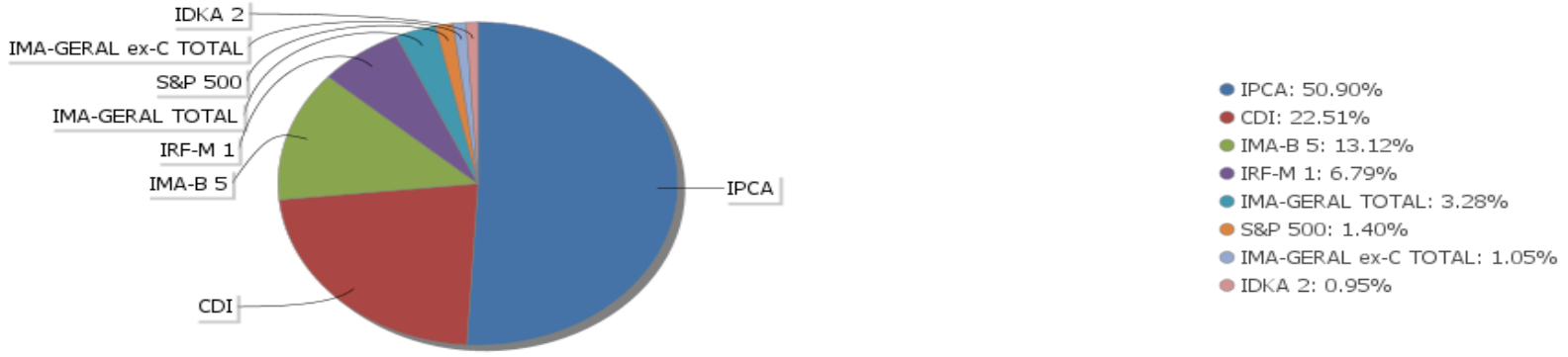
Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



8 de 22

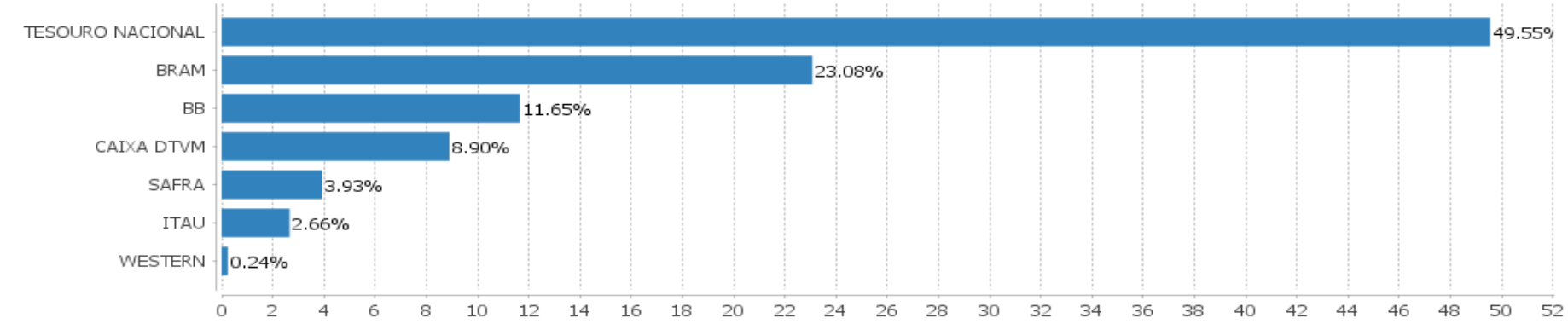
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	5	33,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	10	66,67

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,64	2,86	-0,21	0,82
06 meses	4,88	2,78	2,10	1,10
12 meses	10,59	11,05	-0,47	1,22
24 meses				
Desde 30/09/2021	12,35	16,02	-3,67	1,46

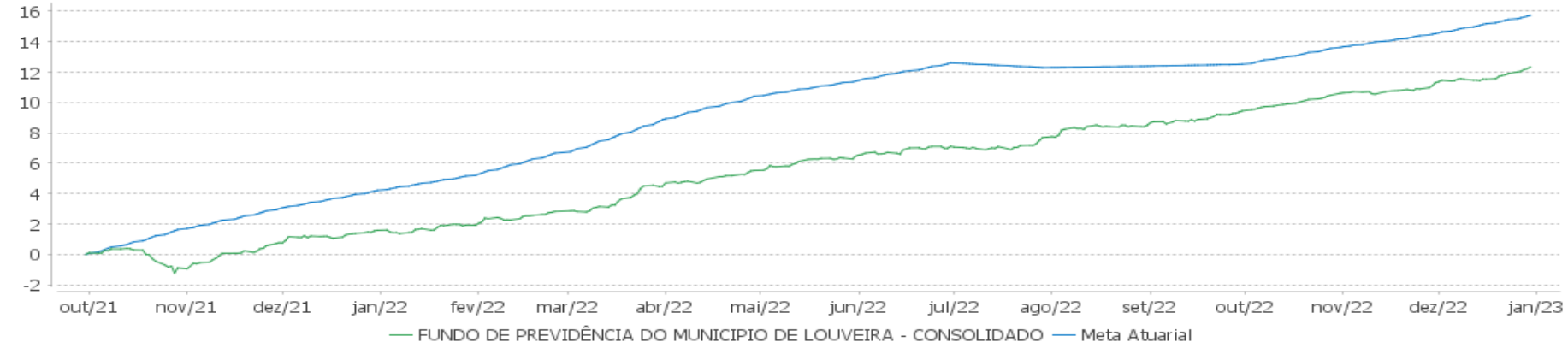
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



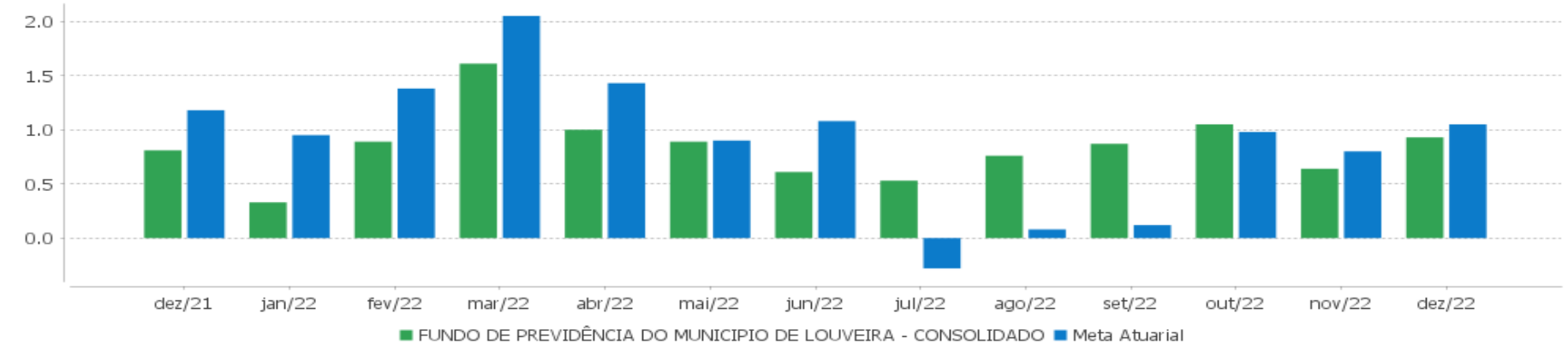
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



12 de 22

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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

Renda Variável

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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	BRADESCO 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	BRADESCO 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	BRADESCO 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
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	BRADESCO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	Total		**27.027.680,08**	**25.815.904,13**		

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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 MUNICIPIO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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
BRADESCO 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
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,43	0,12	0,05			38.060.750,82	9,24
BRADESCO 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


LDB
CONSULTORIA
RELATÓRIO MACROECONÔMICO
DEZEMBRO/2022

LDB CONSULTORIA

Prezados(as) Senhores(as),

Este documento tem por objetivo apresentar as principais informações macroeconômicas para o mês de dezembro de 2022, na intenção de ajudá-los na tomada de decisão e acompanhamento da carteira de investimentos.

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.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o último dia útil do mês de referência, sendo disponibilizado em 09.12.2022.

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.

Av. Angélica, 2.503, Cj 75 | 01227-200 | Higienópolis | São Paulo - SP
Tel.: 11 3214-0372
www.ldbempresas.com.br

LDB CONSULTORIA

“Uma jornada de mil quilômetros precisa começar com um simples passo.”
-Lao Tzu-

1. COMENTÁRIO DO MÊS:

MERCADOS INTERNACIONAIS

No mês de novembro, o sentimento dos mercados globais tiveram um tom positivo, dado o sinal de alívio nos dados de inflação de curto prazo nos EUA e o anúncio de flexibilização de medidas contra a Covid na China. Apesar do alívio na inflação, o trabalho dos bancos centrais seguirá desafiador e ainda espera-se desaceleração à frente, com atividade mais fraca nas principais economias.

Nos EUA, o ciclo de elevação dos juros pelo Fed deverá provocar um aperto das condições financeiras suficiente para induzir a desaceleração da atividade, que por sua vez deve contribuir para a queda da inflação. Ainda assim, como o risco em relação à inflação segue na direção altista, permanece a possibilidade de uma trajetória de juros mais pressionada.

Por fim, a China ainda enfrenta o desafio do aumento de novos casos da Covid-19 e dificuldade em traçar uma estratégia para o maior relaxamento da política sanitária. O cenário de abertura mais ampla da economia ocorrendo até meados do próximo ano continua sendo o mais provável. No entanto, o recente aumento de casos poderia levar a novas restrições, mesmo pontualmente, o que levaria a uma desaceleração de curto prazo. Além disso, o setor imobiliário deve continuar fraco, com efeito negativo no crescimento.

A Zona do Euro, vem demonstrando importante desaceleração, estando mais próxima de recessão. A situação negativa do mercado energético, reflexo do cenário geopolítico, é um dos principais fatores por trás dessa dinâmica. A política monetária mais apertada por parte do Banco Central Europeu também atua na direção de atividade mais fraca a fim de controlar o risco inflacionário.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos. Assim, no mês de novembro de 2022, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, subiram +7,60% e +5,38%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. Observando no acumulado do ano, esses índices apresentam queda de -16,42% e -14,39%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, subiram +8,36% e +6,12%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Acumulando retornos negativos de -20,71% e -18,79% no ano.

BRASIL

Internamente, devido ao encerramento da eleição presidencial, o cenário se volta para a definição de alguns pontos chave sobre a política econômica a ser seguida a partir de 2023. As diretrizes de política fiscal ocupam papel central nessas discussões. Onde, já ocorre o debate entre o novo governo e o Congresso sobre o montante adicional de despesas públicas para os próximos anos.

Há certo alívio nas pressões inflacionárias, com desaceleração do IPCA e das suas medidas de núcleo. Adicionalmente, houve a desaceleração do PIB do terceiro trimestre, em relação ao primeiro semestre, espera-se que essa dinâmica de desaquecimento prossiga nos próximos trimestres, como reflexo da política monetária restritiva e do cenário externo mais complexo. Essa dinâmica reforça a expectativa da inflação gradualmente convergindo para próximo do centro da meta até 2024.

Os primeiros sinais emitidos pelo novo governo em relação à pauta econômica foram consolidados na proposta de emenda constitucional (PEC). A qual mostra a disposição de elevar os gastos do governo. No início de dezembro, o Senado aprovou a PEC com algumas mudanças em relação ao texto original, prevendo um aumento do orçamento de R$ 145 bilhões com validade de dois anos. Com a conclusão da deliberação pelos senadores, a PEC é encaminhada à Câmara dos Deputados. Vale reforçar que mesmo com a "desidratação" da PEC, a convergência da inflação para a meta ainda segue desafiadora e demandará uma atuação mais conservadora do Banco Central.

Aqui, somente a título de exemplo da "Estrutura a Termo das Taxas de Juros - ETTJ" para o IPCA, estimada e divulgada pela ANBIMA para o fechamento de 05.12.2022, e apresentada no item 3 deste relatório como "Taxa de Juros Real", a taxa de juros real com vencimento para 10 anos apresentava taxa de retorno estimada em 6,03% a.a., continuando assim acima da taxa de desconto de 5,04% limitada pela SPREV para o ano de 2022.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, na contramão da alta dos índices internacionais, refletindo a incerteza em relação à condução da política fiscal. Apresentando um retorno negativo de -3,06% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +7,31% e de +10,37% nos últimos 12 meses.

Mediante a todo esse cenário exposto acima e em linha com o último relatório disponibilizado, tentando elucidar muitos questionamentos recebidos acerca dos prêmios trazidos pelas NTNB-s atualmente, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, respaldada por um estudo de ALM, pode auxiliar na "ancoragem de rentabilidade" ainda acima da meta atuarial dos RPPS. Tal estratégia, em especial para carregamento até o vencimento, pode contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos do RPPS, devido ao benefício da "marcação na curva" do preço desse ativo.

LDB CONSULTORIA

2. EXPECTATIVAS DE MERCADO

2.1. BOLETIM FOCUS

Mediana - Agregado	2022							2023						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***
IPCA (variação %)	5,63	5,91	5,92	▲	(6)	142	5,94	98	4,94	5,02	5,08	▲	(3)	141	5,11	97
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,76	2,81	3,05	▲	(4)	103	3,05	65	0,70	0,70	0,75	▲	(1)	103	0,75	65
Câmbio (R$/US$)	5,20	5,27	5,25	▼	(1)	115	5,24	71	5,20	5,25	5,25	=	(1)	114	5,25	71
Selic (% a.a)	13,75	13,75	13,75	=	(24)	131	13,75	82	11,25	11,50	11,75	▲	(1)	129	11,75	81
IGP-M (variação %)	6,35	5,95	5,42	▼	(23)	77	5,41	55	4,55	4,51	4,53	▲	(2)	74	4,55	54
IPCA Administrados (variação %)	-4,16	-3,55	-3,59	▼	(1)	90	-3,58	69	5,56	5,86	6,07	▲	(1)	87	6,25	67
Conta corrente (US$ bilhões)	-38,45	-44,07	-46,20	▼	(7)	25	-48,75	12	-34,00	-39,75	-43,00	▼	(5)	24	-43,50	12
Balança comercial (US$ bilhões)	55,00	55,00	55,00	=	(4)	21	55,00	9	56,00	56,00	58,15	▲	(1)	20	59,10	9
Investimento direto no país (US$ bilhões)	75,00	80,00	78,00	▼	(1)	22	84,00	9	73,80	75,00	75,00	=	(3)	21	77,00	9
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	58,45	57,70	57,70	=	(1)	19	57,20	7	62,90	61,00	61,50	▲	(2)	19	61,00	7
Resultado primário (% do PIB)	1,00	1,25	1,29	▲	(4)	31	1,25	11	-0,50	-0,80	-0,90	▼	(1)	31	-0,80	11
Resultado nominal (% do PIB)	-6,10	-5,76	-5,51	▲	(2)	20	-5,65	6	-7,50	-8,25	-8,52	▼	(4)	20	-8,63	6

Relatório Focus de 02.12.2022. Fonte: https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus

2.2. DINÂMICA DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO

Como destaques para o final de 2022, o último Boletim Focus apresentou expectativas reduzidas para o câmbio, aumentadas para a inflação e PIB e estáveis para a taxa Selic.

Inflação (IPCA): A inflação esperada para o final de 2022 vem sendo revisada para cima, estando em 5,92%. Para o final de 2023 se espera uma inflação em torno de 5,08%.

SELIC: Em relação ao último relatório e para o final de 2022, a expectativa vem sendo mantida em 13,75%. Para 2023 a expectativa aumentou para 11,75%.

PIB: Para o final de 2022 tivemos o aumento da expectativa para 3,05%, e, para 2023, em relação ao último relatório, um aumento para 0,75%.

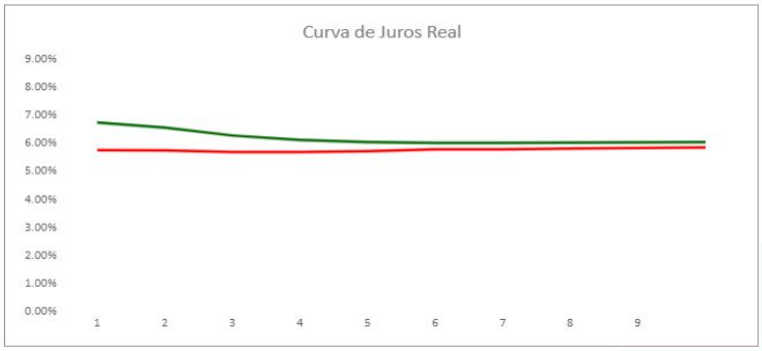
Câmbio (Dólar/ Real): Para 2022 as expectativas foram revisadas para R$ 5,25. Para o final de 2023 as expectativas se mantiveram em R$ 5,25.

LDB CONSULTORIA

3. CURVA DE JUROS E INFLAÇÃO

Taxa de Juros Real: A curva de juros real calculada pela ANBIMA, projetada em 05.12.2022, estima uma taxa real de juros de 6,03% a.a. para 10 anos.

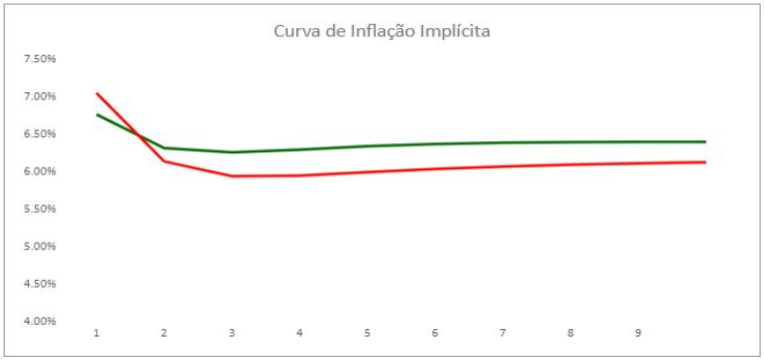
Curva de Juros Real		
Ano	Taxa*	
	Nov/22	Dez/22
1	5.74%	6.72%
2	5.73%	6.55%
3	5.68%	6.26%
4	5.68%	6.10%
5	5.70%	6.03%
6	5.77%	6.00%
7	5.77%	6.00%
8	5.79%	6.01%
9	5.82%	6.02%
10	5.84%	6.03%



** **FONTE:** ANBIMA; Referência nov/22 divulgada em 08.11.2022 e referência dez/22 divulgada em 05.12.2022.*

Taxa de Inflação Implícita: A curva de inflação implícita calculada pela ANBIMA, projetada em 05.12.2022, estima uma taxa de inflação máxima de 6,39% a.a. para 10 anos.

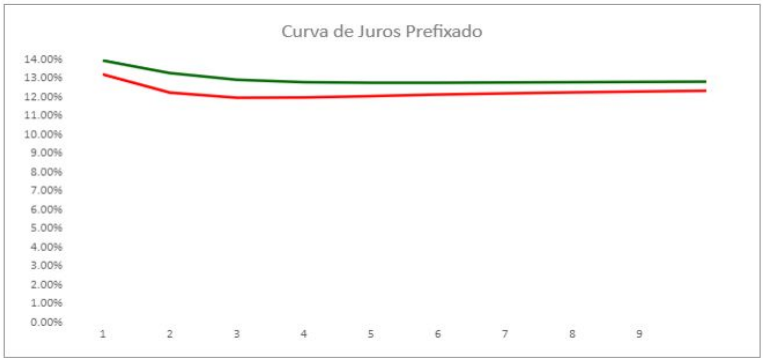
Curva de Inflação Implícita		
Ano	Taxa*	
	Nov/22	Dez/22
1	7.04%	6.76%
2	6.13%	6.31%
3	5.93%	6.25%
4	5.94%	6.29%
5	5.98%	6.33%
6	6.03%	6.36%
7	6.06%	6.38%
8	6.08%	6.38%
9	6.10%	6.39%
10	6.12%	6.39%



** **FONTE:** ANBIMA; Referência nov/22 divulgada em 08.11.2022 e referência dez/22 divulgada em 05.12.2022.*

Taxa de Juros Prefixados: A curva de juros prefixada calculada pela ANBIMA, projetada em 05.12.2022, estima uma taxa prefixada de juros de 12,80% a.a. para 10 anos.

Curva de Juros Pré		
Ano	Taxa*	
	Nov/22	Dez/22
1	13.18%	13.93%
2	12.21%	13.26%
3	11.94%	12.90%
4	11.95%	12.77%
5	12.03%	12.74%
6	12.11%	12.75%
7	12.18%	12.76%
8	12.23%	12.78%
9	12.28%	12.79%
10	12.31%	12.80%



** **FONTE:** ANBIMA; Referência nov/22 divulgada em 08.11.2022 e referência dez/22 divulgada em 05.12.2022.*

Av. Angélica, 2.503, Cj 75 | 01227-200 | Higienópolis | São Paulo - SP
Tel.: 11 3214-0372
www.ldbempresas.com.br

LDB CONSULTORIA

4. INDICADORES

Indicadores	2021	2022											No ano (2022)	Acumulado 12 meses
	dezembro	janeiro	fevereiro	março	abril	maio	junho	julho	agosto	setembro	outubro	novembro		
Renda Fixa														
IMA-S	0.78%	0.83%	0.92%	0.91%	0.69%	1.11%	1.07%	1.04%	1.19%	1.11%	1.08%	1.01%	11.51%	12.38%
CDI	0.76%	0.73%	0.75%	0.92%	0.83%	1.03%	1.01%	1.03%	1.17%	1.07%	1.02%	1.02%	11.12%	11.97%
IRF-M 1	0.88%	0.63%	0.74%	0.89%	0.75%	0.95%	0.93%	1.05%	1.23%	1.11%	1.00%	0.94%	10.71%	11.68%
IMA-GERAL	0.87%	0.21%	0.74%	1.57%	0.54%	0.92%	0.43%	0.47%	1.40%	1.26%	1.01%	-0.06%	8.82%	9.76%
IMA-B5	0.79%	0.11%	1.06%	2.61%	1.56%	0.78%	0.33%	0.01%	0.00%	0.42%	1.91%	-0.33%	8.76%	9.62%
IDkA IPCA 2A	0.83%	0.05%	1.26%	2.54%	1.51%	0.85%	0.47%	-0.17%	-0.36%	0.62%	1.78%	-0.77%	8.00%	8.90%
IRF-M	1.89%	-0.08%	0.58%	0.84%	-0.12%	0.58%	0.37%	1.15%	2.05%	1.40%	0.93%	-0.66%	7.24%	9.26%
IMA-B	0.22%	-0.73%	0.54%	3.07%	0.83%	0.96%	-0.36%	-0.88%	1.10%	1.48%	1.23%	-0.79%	6.58%	6.82%
IRF-M 1+	2.29%	-0.50%	0.48%	0.81%	-0.53%	0.39%	0.09%	1.20%	2.60%	1.58%	0.92%	-1.42%	5.70%	8.12%
IMA-B5+	-0.34%	-1.61%	0.01%	3.56%	0.08%	1.16%	-1.10%	-1.84%	2.49%	2.39%	0.65%	-1.18%	4.54%	4.19%
IDkA IPCA 20A	-2.28%	-2.92%	-0.58%	4.00%	-1.21%	1.21%	-2.95%	-3.59%	5.45%	5.00%	-0.33%	-2.10%	1.45%	-0.87%
Renda Variável														
IDIV	1.60%	7.47%	-2.32%	10.00%	-5.19%	4.26%	-8.38%	1.98%	4.27%	-1.80%	4.03%	0.78%	14.50%	16.33%
IBRX - 50	3.76%	7.65%	1.74%	5.43%	-10.51%	3.30%	-11.67%	4.54%	6.33%	0.48%	5.32%	-2.19%	8.48%	12.57%
Ibovespa	2.85%	6.98%	0.89%	6.06%	-10.10%	3.22%	-11.50%	4.69%	6.16%	0.47%	5.45%	-3.06%	7.31%	10.37%
IBrX - 100	3.14%	6.87%	1.46%	5.96%	-10.11%	3.23%	-11.56%	4.40%	6.15%	-0.05%	5.57%	-3.11%	6.82%	10.17%
IFIX	8.78%	-0.99%	-1.29%	1.42%	1.19%	0.26%	-0.88%	0.66%	5.76%	0.49%	0.02%	-4.15%	2.23%	11.20%
ISE	1.73%	3.86%	-3.43%	7.48%	-10.17%	2.01%	-12.35%	4.40%	5.97%	-2.54%	7.65%	-10.48%	-10.03%	-8.47%
IVBX-2	2.71%	3.18%	-2.63%	6.50%	-11.63%	0.88%	-12.83%	5.79%	4.04%	-2.48%	8.89%	-7.47%	-10.09%	-7.65%
SMLL	3.80%	3.42%	-5.19%	8.81%	-8.36%	-1.82%	-16.33%	5.16%	10.90%	-1.84%	7.30%	-11.23%	-12.42%	-9.10%
Investimentos no Exterior														
S&P 500 (M. Orig.)	4.36%	-5.26%	-2.90%	3.32%	-8.80%	0.01%	-8.39%	9.11%	-4.24%	-9.34%	7.99%	5.38%	-14.39%	-10.66%
MSCI ACWI (M.Orig.)	3.89%	-4.96%	-2.63%	1.86%	-8.14%	-0.13%	-8.58%	6.86%	-3.86%	-9.74%	5.96%	7.60%	-16.42%	-13.16%
S&P 500	3.63%	-9.05%	-6.85%	-4.75%	-5.31%	-3.86%	1.47%	8.08%	-4.42%	-5.36%	5.00%	6.12%	-18.79%	-15.84%
MSCI ACWI	3.17%	-8.76%	-6.59%	-6.10%	-4.62%	-3.99%	1.26%	5.85%	-4.03%	-5.78%	3.03%	8.36%	-20.71%	-18.19%
Global BDRX	1.71%	-9.83%	-6.82%	-3.98%	-6.96%	-4.32%	0.79%	7.65%	-3.05%	-8.38%	1.33%	7.09%	-24.89%	-23.60%
Índices Econômicos														
SELIC	0.76%	0.73%	0.75%	0.92%	0.83%	1.03%	1.01%	1.03%	1.17%	1.07%	1.02%	1.02%	11.12%	11.97%
INPC	0.73%	0.67%	1.00%	1.71%	1.04%	0.45%	0.62%	-0.60%	-0.31%	-0.32%	0.47%	0.38%	5.21%	5.97%
IPCA	0.73%	0.54%	1.01%	1.62%	1.06%	0.47%	0.67%	-0.68%	-0.36%	-0.29%	0.59%	0.41%	5.13%	5.90%
IGPM	0.87%	1.82%	1.83%	1.74%	1.41%	0.52%	0.59%	0.21%	-0.70%	-0.95%	-0.97%	-0.56%	4.98%	5.90%
DÓLAR	-0.70%	-4.00%	-4.07%	-7.81%	3.83%	-3.87%	10.77%	-0.95%	-0.18%	4.39%	-2.77%	0.71%	-5.13%	-5.80%
Meta Atuarial														
INPC + 6% a.a.	1.27%	1.16%	1.44%	2.23%	1.48%	0.96%	1.11%	-0.12%	0.22%	0.17%	0.94%	0.85%	10.93%	12.33%
IPCA + 6% a.a.	1.27%	1.03%	1.45%	2.14%	1.50%	0.98%	1.16%	-0.20%	0.17%	0.20%	1.06%	0.88%	10.85%	12.25%
INPC + 5% a.a.	1.18%	1.08%	1.37%	2.14%	1.41%	0.88%	1.03%	-0.20%	0.13%	0.09%	0.86%	0.77%	9.98%	11.27%
IPCA + 5% a.a.	1.18%	0.95%	1.38%	2.05%	1.43%	0.90%	1.08%	-0.28%	0.08%	0.12%	0.98%	0.80%	9.90%	11.20%
INPC + 4% a.a.	1.09%	1.00%	1.30%	2.06%	1.34%	0.79%	0.95%	-0.27%	0.05%	0.01%	0.78%	0.69%	9.02%	10.21%
IPCA + 4% a.a.	1.09%	0.87%	1.31%	1.97%	1.36%	0.81%	1.00%	-0.35%	0.00%	0.04%	0.90%	0.72%	8.95%	10.14%


LDB
CONSULTORIA
Desempenho de Índices e
Indicadores Financeiros em 2022

AOS REGIMES PRÓPRIOS DE PREVIDÊNCIA SOCIAL - RPPS

Prezados(as) Senhores(as),

Este documento tem por objetivo analisar e apresentar informações a respeito do comportamento de alguns dos principais índices e indicadores financeiros, em especial os mais observados nas carteiras dos RPPS ao longo de 2022. Adicionalmente, este relatório traz as expectativas de mercado e tendências para 2023.

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.

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.

Av. Angélica, 2.503, Cj 75 | 01227-200 | Higienópolis | São Paulo - SP
Tel.: 11 3214-0372
www.ldbempresas.com.br

LDB CONSULTORIA

Sumário

1. Breve comentário sobre os cenários nacional e internacional ao final de 2021 **3**
1.1. Comportamento dos mercados ao final de 2021 3
2. Cenário Macroeconômico e Desempenho de Índices em 2022 **4**
2.1. Cenário Macroeconômico em 2022 4
2.2. Dinâmica dos mercados e Desempenho de Índices em 2022 6
2.3. Comparativo Índices x Meta Atuarial em 2022 8
3. Expectativas de Mercado para 2023 **10**
3.2. Dinâmica das Expectativas de Mercado 10
4. Comentários sobre as Expectativas de Mercado para 2023 **11**
Anexo I – Curva de Juros e Inflação **12**

Av. Angélica, 2.503, Cj 75 | 01227-200 | Higienópolis | São Paulo - SP
Tel.: 11 3214-0372
www.ldbempresas.com.br

"Alguém está sentado na sombra hoje porque alguém plantou uma árvore há muito tempo."
- Warren Buffet-

1. Breve comentário sobre os cenários nacional e internacional ao final de 2021

Antes de remontarmos os principais eventos ocorridos durante o ano de 2022, é importante pontuarmos, ainda que de forma resumida, como se deu a dinâmica nos mercados ao final do ano de 2021. A partir daí, apresentaremos a evolução dos mercados ao longo do ano de 2022 e seus desdobramentos, com reflexos no desempenho dos indicadores.

1.1. Comportamento dos mercados ao final de 2021

Sobre a pandemia, o final de novembro trouxe a descoberta de uma nova cepa do Coronavírus, a Ômicron, tendo alto número de mutações e elevado potencial de contágio. Essa descoberta trouxe grande volatilidade aos mercados, devido à maior possibilidade de fechamento de economias, provocando queda nos mercados de renda variável pelo mundo afora.

Passado pouco mais de duas semanas, e com melhor entendimento sobre a gravidade da nova cepa, autoridades nos EUA e na Europa informaram que todos os casos notificados foram classificados como assintomáticos ou leves, demonstrando a eficácia das vacinas. O que levou os mercados a absorverem as últimas notícias de forma positiva. Em linhas gerais a dinâmica de contenção da pandemia vem se comportando de forma positiva.

O 4º trimestre de 2021 foi positivo para ativos de renda fixa e negativo para ativos de renda variável. Vale ressaltar que o mês de outubro trouxe o pior cenário para ambas as classes, trazendo sérias dúvidas e posterior ruptura do teto de gastos do governo federal.

No campo internacional, já precificando menor crescimento chinês e ainda observando uma aceleração inflacionária global, as atenções continuaram concentradas nos próximos movimentos do Fed, especialmente sobre as expectativas do início de redução do "tapering", oficialmente comunicado no início de novembro, e sinalizações de quando poderia ocorrer uma elevação de taxa de juros no mercado americano.

Em outubro, agregando o avanço inflacionário novamente acima do esperado, dúvidas fiscais mais acentuadas e acirramento de tensões políticas entre os três poderes, não foi bem digerido pelo mercado o trecho da fala de Paulo Guedes, sobre uma potencial ruptura do teto de gastos, tão temida pelos investidores.

Município de Louveira - SP
Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

Após o anúncio de Guedes, houve pelo menos quatro importantes baixas no ministério da economia, sendo duas delas os pedidos de exoneração do secretário especial do Tesouro e Orçamento, Bruno Funchal, e do secretário do Tesouro Nacional, Jeferson Bittencourt. Foram dois dias seguidos de fortes quedas do Ibovespa durante e no fechamento desses dois pregões, e, os juros futuros apresentaram forte alta.

Falando sobre o desempenho dos mercados locais ao final do ano, a começar pela renda fixa, observamos resultados positivos, com destaque positivo para IDKA PRÉ 2A, IMA-S, IMA-B 5 e CDI, com retornos acumulados no ano positivos de +4,92%, +4,67%, +4,57% e +4,40%, respectivamente. Já a renda variável o Ibovespa apresentou retorno positivo em somente um trimestre, fechando o ano de 2021 com baixa acumulada de -11,93%.

Sobre investimentos no exterior, salvo o mês de novembro, em que o mercado acionário internacional acabou sofrendo um pouco mais com temores ligados à descoberta da nova cepa do Coronavírus, a Ômicron, tanto o S&P 500 como o Global BDRX encerraram o ano de 2021 com retornos expressivamente positivos, de 36,26% e de 33,65%, respectivamente.

2. Cenário Macroeconômico e Desempenho de Índices em 2022

Como veremos adiante, tendo em vista o cenário econômico desafiador de 2022, somente alguns índices do mercado conseguiram superar as metas atuariais, aqui propostas para o estudo, foram representadas pelo IPCA e INPC mais 5,04%, taxa pré-fixada para 2022 pela SPREV, através da Portaria nº 6.132/21.

2.1. Cenário Macroeconômico em 2022

O mercado internacional apresentou como um cenário relativamente desafiador, o ano de 2022 foi marcado com a contínua preocupação com as pressões inflacionárias, retração econômica global e aumento de juros ao longo do globo.

De forma negativa, e mais acentuada no primeiro semestre, tivemos o reflexo do conflito entre a Rússia e a Ucrânia, que prejudicou a oferta de commodities. O conflito continua durando mais que o esperado, o que impactou o mercado e gerou incerteza sobre uma crise energética na Zona do Euro. Enquanto isso, o Banco Central Europeu indicou uma política monetária mais apertada para enfrentar o risco inflacionário.

Nos Estados Unidos, houve o início do novo ciclo de alta dos juros. O que impactou negativamente os mercados de risco. Entretanto, as últimas leituras da inflação (CPI) mostraram-se mais favoráveis, com o núcleo desacelerando, ainda que gradualmente. Contribuindo de forma mais otimista para o controle inflacionário e redução do risco do cenário de recessão.

Na China, a recuperação econômica foi afetada em decorrência da política de covid zero, o que resultou em um crescimento abaixo das expectativas e impactos nas bolsas de outras economias. Já, somente ao fim do semestre, as preocupações com relação à fraqueza da economia e dos sinais de instabilidade social devido a restrição da mobilidade dos cidadãos, advindas do controle contra a covid, resultaram no encerramento da política de covid zero.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos negativos no ano com quedas de -19,80% e -19,44%, todos em "moeda original", ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500 caíram -25,01% e -24,68% no acumulado do ano, em conjunto com a desvalorização do Dólar frente ao Real.

No cenário doméstico, ao longo do ano, houve atenção com a dinâmica inflacionária e dúvidas fiscais acentuadas pelo ano eleitoral. Onde, mesmo com a inflação pendendo para certa estabilidade, havia possibilidade dos estímulos fiscais agirem em contramão aos objetivos da política econômica vigente, ocasionando em mais altas de juros.

Ao longo do ano, o Banco Central do Brasil (BC) aumentou a alta da taxa de juros, interrompendo seu aumento somente no começo do segundo semestre, fechando o ano em 13,75%. Por outro lado, mesmo com a estabilidade da Taxa Selic, o Copom através do comunicado e da ata, enfatizou a questão dos riscos fiscais e seus potenciais efeitos sobre a política monetária.

Com as altas leituras de inflação ao longo do primeiro semestre, foi gerado uma pressão sobre a curva de juros domésticas. Onde, os títulos mais curtos atrelados à inflação tiveram retornos positivos, enquanto os mais longos, sofreram mais com a alta da curva causada por esta pressão gerada.

Entretanto, esse cenário começou a mudar na segunda metade do ano devido ao certo alívio nas pressões inflacionárias, onde a trajetória da inflação tende a uma direção mais favorável. Adicionalmente, houve a desaceleração do PIB do terceiro trimestre, sendo esperada que essa dinâmica de desaquecimento prossiga nos próximos trimestres, como reflexo da política monetária restritiva e do cenário externo mais complexo.

Em relação ao resultado das eleições, no primeiro turno tivemos a definição do Congresso Nacional eleito, onde apresentou uma composição mais centrista, o que pode diminuir a chance de grandes desvios na condução de políticas públicas nos próximos anos. Já no segundo turno, o candidato Lula foi eleito presidente do Brasil.

Além disso, tivemos a aprovação da PEC de transição, com ampliação do limite de gastos em 2023 e autorização para que um novo arcabouço fiscal seja proposto via lei complementar, que elevam o questionamento sobre uma eventual consolidação fiscal.

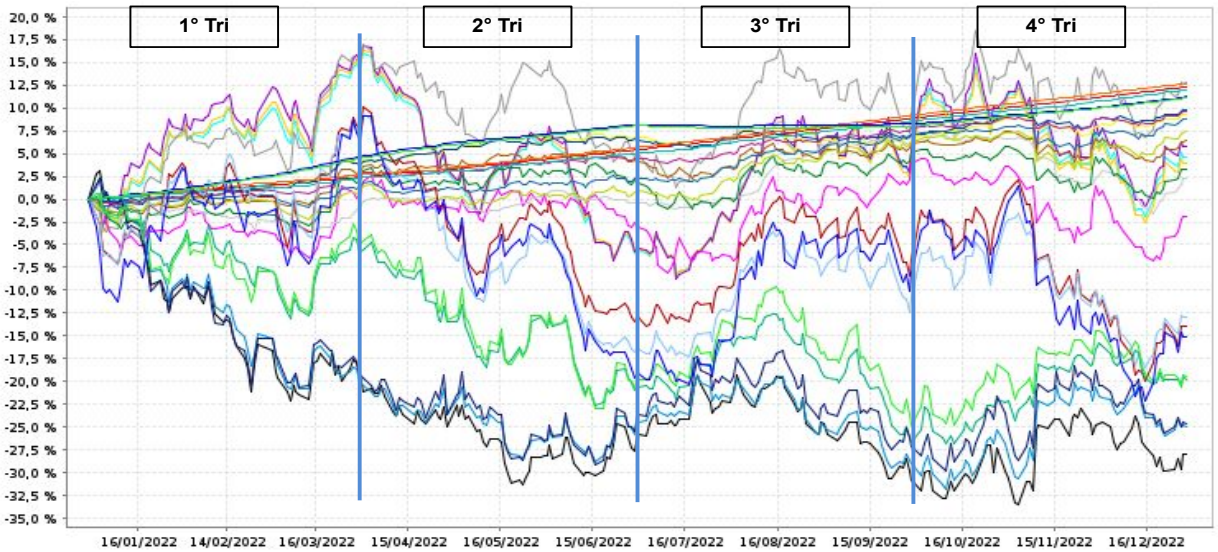
Já observando a composição da equipe do novo governo, com ministros e autoridades em postos chave que veem um estado mais atuante e indutor do crescimento, reforça este sinal, indicando que o impulso fiscal deverá ser potencializado por uma maior atuação dos bancos públicos e elevação do investimento das empresas estatais.

Na renda variável, os índices Ibovespa e SMLL seguiram a dinâmica de recuperação dos índices internacionais, apresentaram certa recuperação no segundo semestre, mesmo com as incertezas locais. Respectivamente, apresentando um retorno de 4,69% e -15,06% no acumulado do ano.

2.2. Dinâmica dos mercados e Desempenho de Índices em 2022

Para melhor entendimento sobre a dinâmica dos eventos que mais impactaram os mercados ao longo de 2022, apresentamos abaixo um gráfico de retornos acumulado no ano, com separação por trimestres, na tentativa de evidenciarmos alguns eventos relevantes para cada um dos períodos. Vale mencionar, os indicadores apresentados no gráfico são os mesmos presentes na tabela da página 7.

Gráfico de retorno em 2022 - de 01.01.2022 até 31.12.2022



Município de Louveira - SP
Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Além disso, no intuito de evidenciar os impactos dos eventos abordados anteriormente no tópico "Cenário Macroeconômico em 2022", a tabela abaixo demonstra os retornos obtidos nos principais índices do mercado em janelas mensais e no acumulado do ano de 2022.

Tabela de Retornos em 2022 - de 01.01.2022 até 31.12.2022

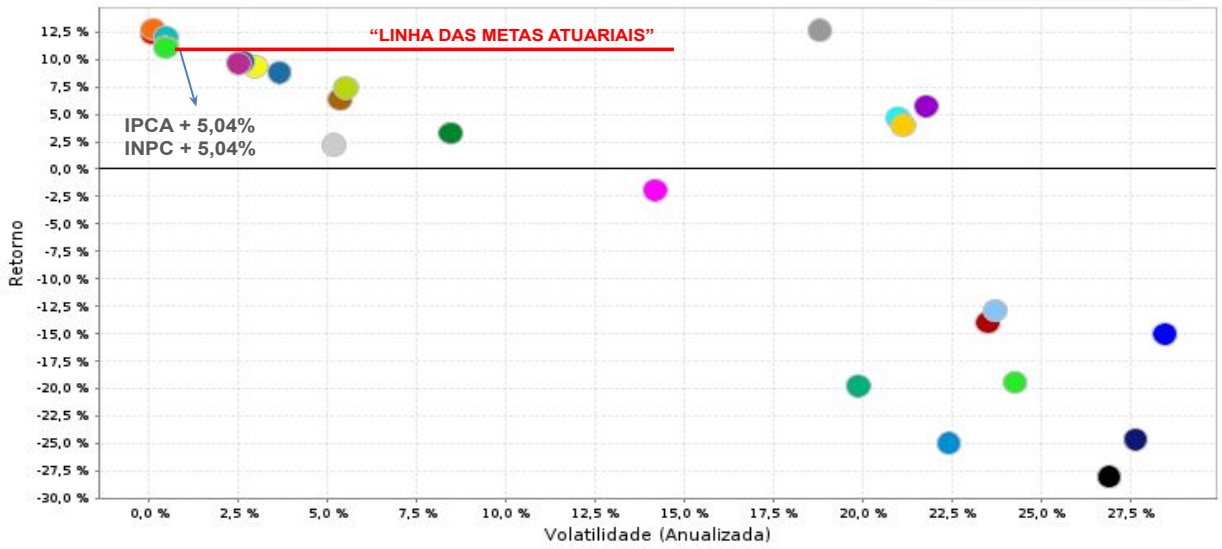
Índices Financeiros em 2022													
Indicadores	1º Trimestre			2º Trimestre			3º Trimestre			4º Trimestre			No ano
	janeiro	fevereiro	março	abril	maio	junho	julho	agosto	setembro	outubro	novembro	dezembro	
Renda Fixa													
IMA-S	0.83%	0.92%	0.91%	0.69%	1.11%	1.07%	1.04%	1.19%	1.11%	1.08%	1.01%	1.11%	**12.74%**
CDI	0.73%	0.75%	0.92%	0.83%	1.03%	1.01%	1.03%	1.17%	1.07%	1.02%	1.02%	1.12%	**12.37%**
IRF-M 1	0.63%	0.74%	0.89%	0.75%	0.95%	0.93%	1.05%	1.23%	1.11%	1.00%	0.94%	1.18%	**12.02%**
IMA-B5	0.11%	1.06%	2.61%	1.56%	0.78%	0.33%	0.01%	0.00%	0.42%	1.91%	-0.33%	0.94%	**9.78%**
IMA-GERAL	0.21%	0.74%	1.57%	0.54%	0.92%	0.43%	0.47%	1.40%	1.26%	1.01%	-0.06%	0.77%	**9.66%**
IDkA IPCA 2A	0.05%	1.26%	2.54%	1.51%	0.85%	0.47%	-0.17%	-0.36%	0.62%	1.78%	-0.77%	1.24%	**9.34%**
IRF-M	-0.08%	0.58%	0.84%	-0.12%	0.58%	0.37%	1.15%	2.05%	1.40%	0.93%	-0.66%	1.48%	**8.82%**
IRF-M 1+	-0.50%	0.48%	0.81%	-0.53%	0.39%	0.09%	1.20%	2.60%	1.58%	0.92%	-1.42%	1.62%	**7.41%**
IMA-B	-0.73%	0.54%	3.07%	0.83%	0.96%	-0.36%	-0.88%	1.10%	1.48%	1.23%	-0.79%	-0.19%	**6.37%**
IMA-B5+	-1.61%	0.01%	3.56%	0.08%	1.16%	-1.10%	-1.84%	2.49%	2.39%	0.65%	-1.18%	-1.19%	**3.30%**
IDkA IPCA 20A	-2.92%	-0.58%	4.00%	-1.21%	1.21%	-2.95%	-3.59%	5.45%	5.00%	-0.33%	-2.10%	-3.32%	**-1.92%**
Renda Variável													
IDIV	7.47%	-2.32%	10.00%	-5.19%	4.26%	-8.38%	1.98%	4.27%	-1.80%	4.03%	0.78%	-1.61%	**12.65%**
IBRX - 50	7.65%	1.74%	5.43%	-10.51%	3.30%	-11.67%	4.54%	6.33%	0.48%	5.32%	-2.19%	-2.55%	**5.72%**
Ibovespa	6.98%	0.89%	6.06%	-10.10%	3.22%	-11.50%	4.69%	6.16%	0.47%	5.45%	-3.06%	-2.45%	**4.69%**
IBrX - 100	6.87%	1.46%	5.96%	-10.11%	3.23%	-11.56%	4.40%	6.15%	-0.05%	5.57%	-3.11%	-2.63%	**4.02%**
IFIX	-0.99%	-1.29%	1.42%	1.19%	0.26%	-0.88%	0.66%	5.76%	0.49%	0.02%	-4.15%	0.00%	**2.22%**
IVBX-2	3.18%	-2.63%	6.50%	-11.63%	0.88%	-12.83%	5.79%	4.04%	-2.48%	8.89%	-7.47%	-3.14%	**-12.91%**
ISE	3.86%	-3.43%	7.48%	-10.17%	2.01%	-12.35%	4.40%	5.97%	-2.54%	7.65%	-10.48%	-4.37%	**-13.96%**
SMLL	3.42%	-5.19%	8.81%	-8.36%	-1.82%	-16.33%	5.16%	10.90%	-1.84%	7.30%	-11.23%	-3.01%	**-15.06%**
Investimentos no Exterior													
S&P 500 (M. Orig.)	-5.26%	-2.90%	3.32%	-8.80%	0.01%	-8.39%	9.11%	-4.24%	-9.34%	7.99%	5.38%	-5.90%	**-19.44%**
MSCI ACWI (M.Orig.)	-4.96%	-2.63%	1.86%	-8.14%	-0.13%	-8.58%	6.86%	-3.86%	-9.74%	5.96%	7.60%	-4.05%	**-19.80%**
S&P 500	-9.05%	-6.85%	-4.75%	-5.31%	-3.86%	1.47%	8.08%	-4.42%	-5.36%	5.00%	6.12%	-7.26%	**-24.68%**
MSCI ACWI	-8.76%	-6.59%	-6.10%	-4.62%	-3.99%	1.26%	5.85%	-4.03%	-5.78%	3.03%	8.36%	-5.43%	**-25.01%**
Global BDRX	-9.83%	-6.82%	-3.98%	-6.96%	-4.32%	0.79%	7.65%	-3.05%	-8.38%	1.33%	7.09%	-4.22%	**-28.05%**
Meta Atuarial													
INPC + 5,04%	1.08%	1.38%	2.15%	1.42%	0.88%	1.03%	-0.19%	0.14%	0.09%	0.86%	0.77%	1.12%	**11.25%**
IPCA + 5,04%	0.95%	1.39%	2.06%	1.44%	0.90%	1.08%	-0.27%	0.09%	0.12%	0.98%	0.80%	1.05%	**11.09%**

LDB CONSULTORIA

2.3. Comparativo Índices x Meta Atuarial em 2022

Com o intuito de realizar um comparativo, abordado no gráfico e tabela abaixo, entre os índices de mercado e as Metas Atuariais, utilizamos alguns dos principais indicadores do mercado local para renda fixa e renda variável. Além disso, para bolsa internacional utilizamos o S&P 500, MSCI ACWI e o GLOBAL BDRX. Para ativos imobiliários utilizamos o IFIX.

Gráfico de Dispersão em 2022 - de 01.01.2022 a 31.12.2022



Olhando para o gráfico apresentado acima, em especial para a "Linha das Metas Atuariais", com destaque em vermelho, é possível constatar o quão improvável foi para os Institutos o atingimento de suas respectivas metas no período, uma vez que a maior parte dos índices não alcançaram a rentabilidade das metas.

LDB CONSULTORIA

Tabela de Retorno e Volatilidade em 2022 - de 01.01.2022 a 31.12.2022

Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
IMA-S	12.74%	0.11%
IDIV	12.65%	18.80%
CDI	12.37%	0.08%
IRF-M 1	12.02%	0.48%
INPC + 5,04%	11.25%	0.47%
IPCA + 5,04%	11.09%	0.47%
IMA-B 5	9.78%	2.61%
IMA Geral	9.66%	2.51%
IDkA IPCA 2 Anos	9.34%	2.97%
IRF-M	8.82%	3.66%
IRF-M 1+	7.41%	5.51%
IMA-B	6.37%	5.36%
IBX-50	5.72%	21.79%
Ibovespa	4.69%	21.00%
IBX	4.02%	21.13%
IMA-B 5+	3.30%	8.45%
IFIX	2.22%	5.18%
IDkA IPCA 20 Anos	-1.92%	14.19%
IVBX-2	-12.91%	23.71%
ISE	-13.96%	23.51%
SMLL	-15.06%	28.48%
S&P 500 (Moeda Original)	-19.44%	24.28%
MSCI ACWI (Moeda Original)	-19.80%	19.88%
S&P 500	-24.68%	27.65%
MSCI ACWI	-25.01%	22.42%
Global BDRX	-28.05%	26.91%

Adicionalmente, podemos observar que somente quatro índices do mercado tiveram êxito em superar a Meta Atuarial. Sendo somente um deles de renda variável, enquanto os demais são índices de renda fixa atrelados aos títulos de vencimento mais curtos. Em contraponto temos os índices internacionais de renda variável, que mesmo demonstrando uma leve recuperação no último trimestre, tiveram rentabilidade negativa expressiva no acumulado do ano.

LDB CONSULTORIA

3. Expectativas de Mercado para 2023

3.1. Boletim Focus

Mediana - Agregado	2022							2023							2024					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **
IPCA (variação %)	5,79	5,62	5,62	=	(1)	139	5,61	47	5,08	5,31	5,36	▲	(4)	138	5,48	47	3,50	3,65	3,70	▲	(3)	124
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	3,05	3,04	3,03	▼	(1)	101	3,00	27	0,75	0,80	0,78	▼	(1)	100	0,65	27	1,70	1,50	1,50	=	(2)	80
Câmbio (R$/US$)	5,25	-	-						5,25	5,27	5,28	▲	(1)	111	5,28	35	5,24	5,26	5,30	▲	(1)	95
Selic (% a.a)	-	-	-						11,75	12,25	12,25	=	(1)	124	12,38	42	8,50	9,00	9,25	▲	(1)	117
IGP-M (variação %)	5,42	-	-						4,54	4,55	4,61	▲	(2)	71	4,74	19	4,02	4,01	4,01	=	(2)	56
IPCA Administrados (variação %)	-3,61	-3,89	-3,89	=	(1)	85	-3,84	21	6,09	6,77	6,79	▲	(6)	84	7,49	21	4,00	4,00	4,00	=	(5)	63
Conta corrente (US$ bilhões)	-46,61	-51,30	-50,50	▲	(1)	26	-51,00	10	-44,00	-47,10	-46,55	▲	(1)	24	-47,10	9	-45,00	-45,00	-45,00	=	(4)	21
Balança comercial (US$ bilhões)	55,00	56,90	-						60,00	58,00	56,61	▼	(4)	24	58,00	9	54,13	53,00	52,40	▼	(2)	20
Investimento direto no país (US$ bilhões)	80,00	81,60	84,50	▲	(1)	24	82,93	8	76,00	80,00	80,00	=	(2)	22	75,00	7	80,00	80,00	80,00	=	(8)	20
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	57,30	57,50	57,50	=	(2)	22	58,00	5	61,50	61,95	61,95	=	(1)	22	63,90	5	64,00	64,00	64,50	▲	(1)	21
Resultado primário (% do PIB)	1,29	1,20	1,20	=	(2)	31	1,30	10	-0,95	-1,20	-1,20	=	(1)	31	-1,15	10	-0,60	-1,00	-1,00	=	(2)	27
Resultado nominal (% do PIB)	-5,50	-5,20	-5,20	=	(3)	19	-4,70	5	-8,70	-8,60	-8,50	▲	(1)	19	-7,40	5	-6,50	-6,80	-6,90	▼	(1)	18

Relatório Focus de 06.01.2023. Fonte: https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus

3.2. Dinâmica das Expectativas de Mercado

Como destaques para o final de 2023, o último Boletim Focus apresentou expectativas reduzidas para o PIB, estáveis para a taxa Selic e elevadas para a inflação e Câmbio.

Inflação (IPCA): A inflação esperada para o final de 2023 foi mantida em 5,36%. Já para o final de 2024 espera-se uma inflação menor em torno de 3,70%.

SELIC: Em relação ao último relatório e para o final de 2023, a expectativa foi mantida em 12,25%. Para 2024 a expectativa foi aumentada para 9,25%.

PIB: Para o final de 2023 tivemos a redução da expectativa para 0,78%. Para 2024, em relação ao último relatório, foi mantida em 1,50%.

Câmbio (Dólar/ Real): Para 2023, em relação ao último relatório, houve aumento da expectativa para R$ 5,28. Para 2024 a previsão foi aumentada para R$ 5,30.

LDB CONSULTORIA

4. Comentários sobre as Expectativas de Mercado para 2023

Tomando o Relatório Focus como referência de mercado para o final de 2023, vimos que o mercado espera Inflação de 5,36% e taxa Selic de 12,25%, o que nos traria uma taxa de juros real esperada de 6,54%, se tudo o mais constante. Certamente essa taxa de juros real projetada para o final de 2023 é positiva para os RPPS, ao considerarmos que a taxa pré-fixada para 2023, através do Anexo VII da Portaria MTP nº 1.467/22, está limitada em 4,90%.

No entanto, o mesmo relatório aponta para uma redução gradativa da taxa Selic, até que ela atinja 9,25% ao final de 2024, com taxa de inflação esperada de 3,70%, se tudo o mais constante, apontando para juros reais esperados de 5,35%. É certo que o aperto monetário tornou os investimentos em renda fixa mais atrativos, com melhora na relação risco/retorno, mas, de acordo com esse mesmo relatório essas taxas tendem a ser reduzidas nos próximos anos, destacando ainda que o passivo atuarial tem um horizonte de longo prazo, havendo ainda a necessidade de casamento de ativos com passivos.

Repetindo o que temos comentado acerca dos prêmios trazidos pelas NTB-s, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, para carregamento até o vencimento, pode auxiliar em uma “ancoragem de rentabilidade” acima da meta atuarial do RPPS, bem como, pode contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos do Instituto, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo.

Aqui, somente a título de exemplo da “Estrutura a Termo das Taxas de Juros - ETTJ” para o IPCA, estimada e divulgada pela ANBIMA para o fechamento de 09.01.2023, e apresentada no “Anexo I - Curva de Juros e Inflação” como “Taxa de Juros Real”, a taxa de juros real com vencimento para 9 anos apresentava taxa de retorno estimada em 6,25% a.a., acima da taxa pré-fixada para 4,90% limitada pela SPREV para o ano de 2023. Comparativamente, em 09.12.2021 essa mesma taxa estava em 5,06% a.a.

Assim, enfatizamos a melhora nas condições de risco/retorno para ativos de renda fixa, mas, de forma mais assertiva para a elaboração de Políticas de Investimentos, com a adoção dos devidos critérios técnicos para a definição de macro alocação de ativos, seleção de gestores, e, com boa diversificação na alocação entre os produtos de investimento, as estratégias também poderiam considerar, em alguma proporção, além dos ativos de renda fixa, produtos estruturados, exposição em renda variável e considerar a possibilidade de alocação em “investimentos no exterior”, com vista à obtenção de ganhos de capital e redução do risco Brasil.

De qualquer forma, salientamos que, para uma alocação mais eficiente, técnica, com indicação mais precisa de fatores de risco, é necessária a realização do estudo de ALM (Asset Liability Management) em bases anuais. Esse estudo, previsto inclusive no manual técnico do Pró-Gestão, adotado pela SPREV-MTP, é realizado para identificar a alocação ideal dos ativos, tendo em vista o passivo atuarial e a necessidade de rentabilização desses ativos (meta atuarial), de forma a neutralizar um "descasamento" entre as taxas de crescimento do ativo (investimento) e do passivo atuarial (fluxo de pagamento de benefícios futuros).

LDB CONSULTORIA

Anexo I – Curva de Juros e Inflação

Taxa de Juros Real: A curva de juros real calculada pela ANBIMA, projetada em 09.01.2023, estima uma taxa real de juros de 6,25% a.a. para 9 anos.

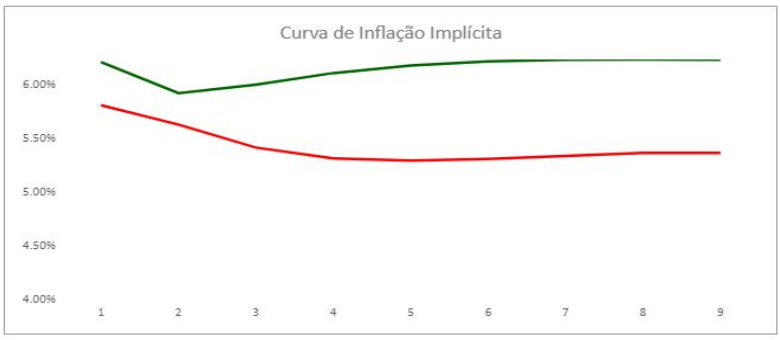
Curva de Juros Real		
Ano	Taxa*	
	dez/21	Jan/23
1	5.49%	6.84%
2	5.30%	6.57%
3	5.10%	6.35%
4	5.03%	6.25%
5	5.01%	6.21%
6	5.02%	6.22%
7	5.03%	6.22%
8	5.05%	6.23%
9	5.06%	6.25%



** **FONTE:** ANBIMA; Referência dez/21 divulgada em 09.12.2021 e referência jan/23 divulgada em 09.01.2023.*

Taxa de Inflação Implícita: A curva de inflação implícita calculada pela ANBIMA, projetada em 09.01.2023, estima uma taxa de inflação máxima de 6,23% a.a. para 9 anos.

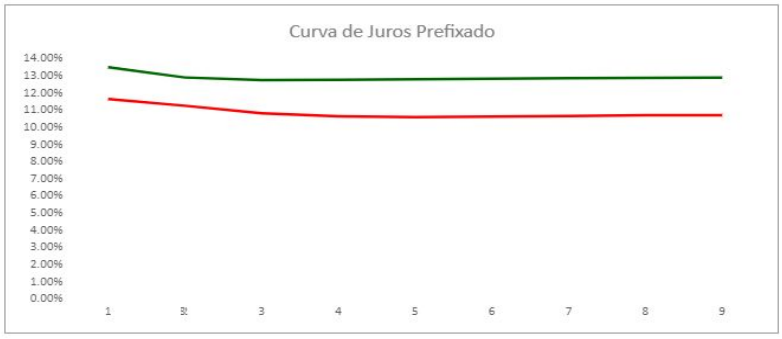
Curva de Inflação Implícita		
Ano	Taxa*	
	Dez/21	Jan/23
1	5.81%	6.21%
2	5.63%	5.92%
3	5.41%	6.00%
4	5.31%	6.11%
5	5.29%	6.18%
6	5.31%	6.21%
7	5.34%	6.23%
8	5.36%	6.23%
9	5.36%	6.23%



** **FONTE:** ANBIMA; Referência dez/21 divulgada em 09.12.2021 e referência jan/23 divulgada em 09.01.2023.*

Taxa de Juros Prefixados: A curva de juros prefixada calculada pela ANBIMA, projetada em 09.01.2023, estima uma taxa prefixada de juros de 12,87% a.a. para 9 anos.

Curva de Juros Pré		
Ano	Taxa*	
	Dez/21	Jan/23
1	11.62%	13.47%
2	11.23%	12.87%
3	10.79%	12.73%
4	10.61%	12.74%
5	10.57%	12.77%
6	10.59%	12.80%
7	10.63%	12.83%
8	10.68%	12.85%
9	10.68%	12.87%



** **FONTE:** ANBIMA; Referência dez/21 divulgada em 09.12.2021 e referência jan/23 divulgada em 09.01.2023.*


LDB
CONSULTORIA
RELATÓRIO MACROECONÔMICO
2º SEMESTRE DE 2022

LDB CONSULTORIA

Prezados(as) Senhores(as),

Este documento tem por objetivo apresentar as principais informações macroeconômicas ocorridas ao longo do segundo semestre de 2022, na intenção de contribuir com um enfoque adicional para explicação de resultados acerca do período analisado.

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.

O presente relatório, concluído e disponibilizado em 10.01.2023, apresenta todas as informações de índices de performance disponíveis até o dia 31.12.2022, data de fechamento do segundo semestre de 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.

Av. Angélica, 2.503, Cj 75 | 01227-200 | Higienópolis | São Paulo - SP
Tel.: 11 3214-0372
www.ldbempresas.com.br

LDB CONSULTORIA

"O medo de arriscar destrói mais sonhos do que o fracasso."
-Fernando Reis-

1. COMENTÁRIO SOBRE O SEMESTRE:

MERCADOS INTERNACIONAIS

O mercado internacional apresentou como um cenário relativamente desafiador, em conformidade com a primeira metade do ano, o segundo semestre de 2022 foi marcado com a contínua preocupação com as pressões inflacionárias, retração econômica global e aumento de juros ao longo do globo.

Na Zona do Euro, houve incerteza sobre a crise energética acarretada pela guerra na Ucrânia, enquanto o Banco Central indica uma política monetária mais apertada para enfrentar o risco inflacionário.

Nos Estados Unidos, ao longo do semestre, houve a continuidade do ciclo de alta dos juros em razão das surpresas inflacionárias agravado por um contexto de mercado de trabalho muito aquecido. Já as últimas leituras da inflação (CPI) mostraram-se mais favoráveis, com o núcleo desacelerando, ainda que gradualmente. Contribuindo de forma mais otimista para o controle inflacionário e redução do risco do cenário de recessão.

Na China, a recuperação econômica foi afetada em decorrência da política de covid zero, o que resultou em um crescimento abaixo das expectativas e impactos nas bolsas de outras economias. Já, somente ao fim do semestre, as preocupações com relação à fraqueza da economia e dos sinais de instabilidade social devido a restrição da mobilidade dos cidadãos, advindas do controle contra a covid, resultaram no encerramento da política de covid zero.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos no semestre. Assim, no 2º semestre de 2022 o MSCI ACWI e o S&P 500 respectivamente subiram 1,44% e 1,43%. Entretanto, no acumulado do ano apresentam queda de -19,80% e -19,44%, todos em "moeda original", ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500 subiram 1,05% e 1,04% no segundo semestre de 2022, entretanto, caíram -25,01% e -24,68% no acumulado do ano, em conjunto com a desvalorização do Dólar frente ao Real.

Município de Louveira - SP
Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

BRASIL

No cenário doméstico, ao longo do semestre, houve atenção com a dinâmica inflacionária e dúvidas fiscais acentuadas pelo ano eleitoral. Onde, mesmo com a inflação pendendo para certa estabilidade, havia possibilidade dos estímulos fiscais agirem em contramão aos objetivos da política econômica vigente, ocasionando em mais altas de juros.

Em relação ao resultado das eleições, no primeiro turno tivemos a definição do Congresso Nacional eleito, onde apresentou uma composição mais centrista, o que pode diminuir a chance de grandes desvios na condução de políticas públicas nos próximos anos. Já no segundo turno, o candidato Lula foi eleito presidente do Brasil.

Além disso, tivemos a aprovação da PEC de transição, com ampliação do limite de gastos em 2023 e autorização para que um novo arcabouço fiscal seja proposto via lei complementar, que elevam o questionamento sobre uma eventual consolidação fiscal.

Já observando a composição da equipe do novo governo, com ministros e autoridades em postos chave que veem um estado mais atuante e indutor do crescimento, reforça este sinal, indicando que o impulso fiscal deverá ser potencializado por uma maior atuação dos bancos públicos e elevação do investimento das empresas estatais.

Durante o semestre foi observado certo alívio nas pressões inflacionárias, onde a trajetória da inflação tende a uma direção mais favorável. Ainda que em patamares pressionados, o IPCA vem desacelerando e exibindo uma composição melhor. Adicionalmente, houve a desaceleração do PIB do terceiro trimestre, em relação ao primeiro semestre, espera-se que essa dinâmica de desaquecimento prossiga nos próximos trimestres, como reflexo da política monetária restritiva e do cenário externo mais complexo.

No começo do semestre, o Banco Central do Brasil (BC) aumentou pela última vez a taxa de juros, fechando o ano em 13,75%. Por outro lado, mesmo com a estabilidade da Taxa Selic, o Copom através do comunicado e da ata, enfatizou a questão dos riscos fiscais e seus potenciais efeitos sobre a política monetária.

Na renda variável, os índices Ibovespa e SMLL seguiram a dinâmica de recuperação dos índices internacionais, fechando o semestre em território positivo, mesmo com as incertezas locais. Respectivamente, apresentando um retorno de 11,36% e 5,76% no 2º semestre de 2022 e de 4,69% e -15,06% no acumulado do ano.

LDB CONSULTORIA

2. EXPECTATIVAS DE MERCADO

2.1. BOLETIM FOCUS

Mediana - Agregado	2022							2023							2024					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **
IPCA (variação %)	5,79	5,62	5,62	=	(1)	139	5,61	47	5,08	5,31	5,36	▲	(4)	138	5,48	47	3,50	3,65	3,70	▲	(3)	124
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	3,05	3,04	3,03	▼	(1)	101	3,00	27	0,75	0,80	0,78	▼	(1)	100	0,65	27	1,70	1,50	1,50	=	(2)	80
Câmbio (R$/US$)	5,25	-	-						5,25	5,27	5,28	▲	(1)	111	5,28	35	5,24	5,26	5,30	▲	(1)	95
Selic (% a.a)	-	-	-						11,75	12,25	12,25	=	(1)	124	12,38	42	8,50	9,00	9,25	▲	(1)	117
IGP-M (variação %)	5,42	-	-						4,54	4,55	4,61	▲	(2)	71	4,74	19	4,02	4,01	4,01	=	(2)	56
IPCA Administrados (variação %)	-3,61	-3,89	-3,89	=	(1)	85	-3,84	21	6,09	6,77	6,79	▲	(6)	84	7,49	21	4,00	4,00	4,00	=	(5)	63
Conta corrente (US$ bilhões)	-46,61	-51,30	-50,50	▲	(1)	26	-51,00	10	-44,00	-47,10	-46,55	▲	(1)	24	-47,10	9	-45,00	-45,00	-45,00	=	(4)	21
Balança comercial (US$ bilhões)	55,00	56,90	-						60,00	58,00	56,61	▼	(4)	24	58,00	9	54,13	53,00	52,40	▼	(2)	20
Investimento direto no país (US$ bilhões)	80,00	81,60	84,50	▲	(1)	24	82,93	8	76,00	80,00	80,00	=	(2)	22	75,00	7	80,00	80,00	80,00	=	(8)	20
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	57,30	57,50	57,50	=	(2)	22	58,00	5	61,50	61,95	61,95	=	(1)	22	63,90	5	64,00	64,00	64,50	▲	(1)	21
Resultado primário (% do PIB)	1,29	1,20	1,20	=	(2)	31	1,30	10	-0,95	-1,20	-1,20	=	(1)	31	-1,15	10	-0,60	-1,00	-1,00	=	(2)	27
Resultado nominal (% do PIB)	-5,50	-5,20	-5,20	=	(3)	19	-4,70	5	-8,70	-8,60	-8,50	▲	(1)	19	-7,40	5	-6,50	-6,80	-6,90	▼	(1)	18

Relatório Focus de 06.01.2023. Fonte: https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus

2.2. DINÂMICA DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO

Como destaques para o final de 2023, o último Boletim Focus apresentou expectativas reduzidas para o PIB, estáveis para a taxa Selic e elevadas para a inflação e Câmbio.

Inflação (IPCA): A inflação esperada para o final de 2023 foi mantida em 5,36%. Já para o final de 2024 espera-se uma inflação menor em torno de 3,70%.

SELIC: Em relação ao último relatório e para o final de 2023, a expectativa foi mantida em 12,25%. Para 2024 a expectativa foi aumentada para 9,25%.

PIB: Para o final de 2023 tivemos a redução da expectativa para 0,78%. Para 2024, em relação ao último relatório, foi mantida em 1,50%.

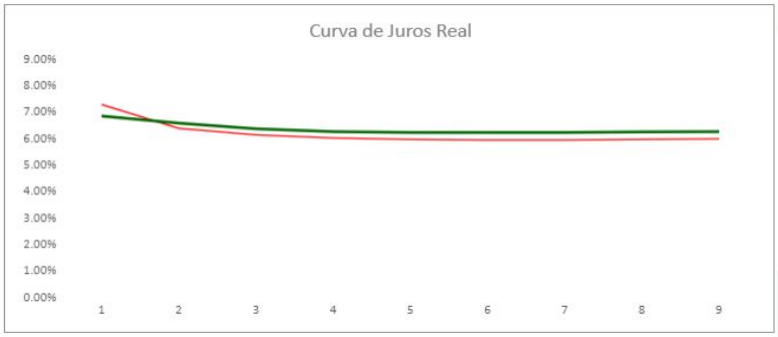
Câmbio (Dólar/ Real): Para 2023, em relação ao último relatório, houve aumento da expectativa para R$ 5,28. Para 2024 a previsão foi aumentada para R$ 5,30.

LDB CONSULTORIA

3. CURVA DE JUROS E INFLAÇÃO

Taxa de Juros Real: A curva de juros real calculada pela ANBIMA, projetada em 09.01.2023, estima uma taxa real de juros de 6,25% a.a. para 9 anos.

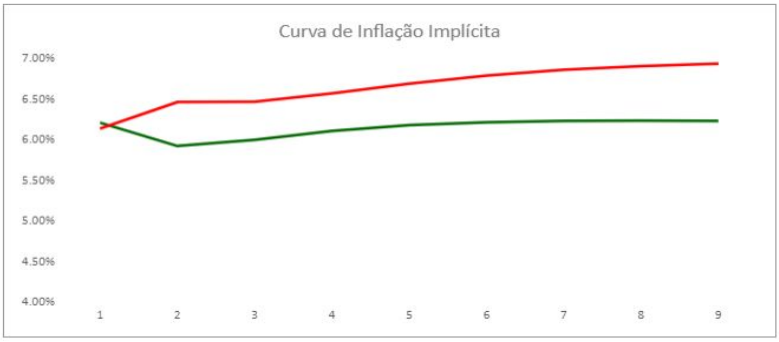
Curva de Juros Real		
Ano	Taxa*	
	Jul/22	Jan/23
1	7.27%	6.84%
2	6.37%	6.57%
3	6.12%	6.35%
4	6.00%	6.25%
5	5.95%	6.21%
6	5.93%	6.22%
7	5.93%	6.22%
8	5.95%	6.23%
9	5.97%	6.25%



** **FONTE:** ANBIMA; Referência jul/22 divulgada em 06.07.2022 e referência jan/23 divulgada em 09.01.2023.*

Taxa de Inflação Implícita: A curva de inflação implícita calculada pela ANBIMA, projetada em 09.01.2023, estima uma taxa de inflação máxima de 6,23% a.a. para 9 anos.

Curva de Inflação Implícita		
Ano	Taxa*	
	Jul/22	Jan/23
1	6.14%	6.21%
2	6.46%	5.92%
3	6.46%	6.00%
4	6.57%	6.11%
5	6.69%	6.18%
6	6.79%	6.21%
7	6.86%	6.23%
8	6.91%	6.23%
9	6.94%	6.23%



** **FONTE:** ANBIMA; Referência jul/22 divulgada em 06.07.2022 e referência jan/23 divulgada em 09.01.2023.*

Taxa de Juros Prefixados: A curva de juros prefixada calculada pela ANBIMA, projetada em 09.01.2023, estima uma taxa prefixada de juros de 12,87% a.a. para 9 anos.

Curva de Juros Pré		
Ano	Taxa*	
	Jul/22	Jan/23
1	13.85%	13.47%
2	13.25%	12.87%
3	12.98%	12.73%
4	12.97%	12.74%
5	13.04%	12.77%
6	13.12%	12.80%
7	13.20%	12.83%
8	13.27%	12.85%
9	13.32%	12.87%



** **FONTE:** ANBIMA; Referência jul/22 divulgada em 06.07.2022 e referência jan/23 divulgada em 09.01.2023.*

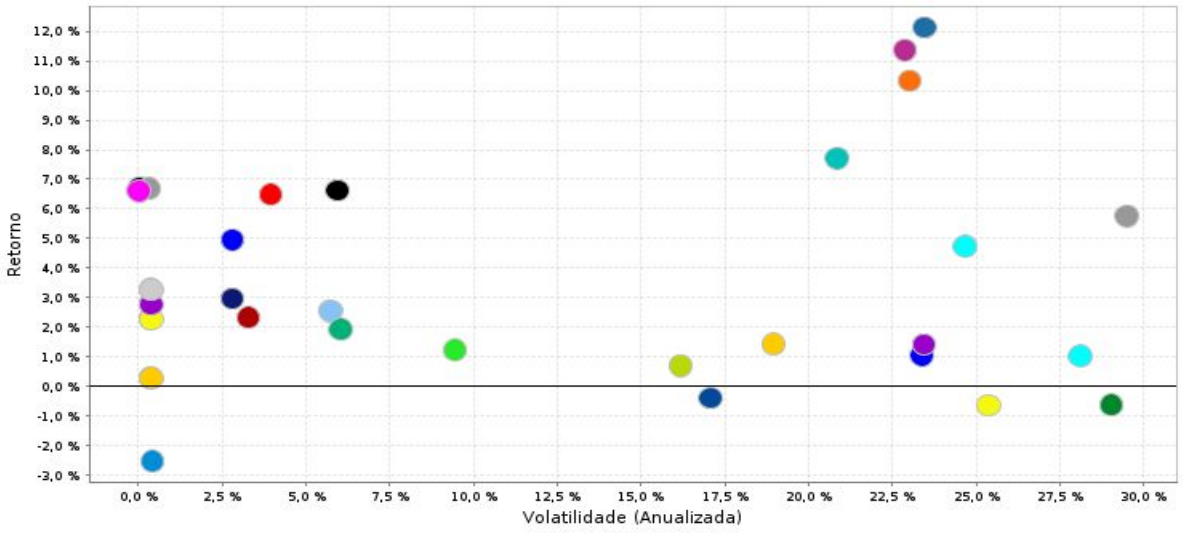
LDB CONSULTORIA

4. INDICADORES

Índices Financeiros								
Indicadores	2º Semestre de 2022						Semestre	No ano (2022)
	julho	agosto	setembro	outubro	novembro	dezembro		
Renda Fixa								
IMA-S	1.04%	1.19%	1.11%	1.08%	1.01%	1.11%	**6.71%**	**12.74%**
CDI	1.03%	1.17%	1.07%	1.02%	1.02%	1.12%	**6.61%**	**12.37%**
IRF-M 1	1.05%	1.23%	1.11%	1.00%	0.94%	1.18%	**6.70%**	**12.02%**
IMA-B5	0.01%	0.00%	0.42%	1.91%	-0.33%	0.94%	**2.98%**	**9.78%**
IMA-GERAL	0.47%	1.40%	1.26%	1.01%	-0.06%	0.77%	**4.95%**	**9.66%**
IDkA IPCA 2A	-0.17%	-0.36%	0.62%	1.78%	-0.77%	1.24%	**2.34%**	**9.34%**
IRF-M	1.15%	2.05%	1.40%	0.93%	-0.66%	1.48%	**6.49%**	**8.82%**
IRF-M 1+	1.20%	2.60%	1.58%	0.92%	-1.42%	1.62%	**6.63%**	**7.41%**
IMA-B	-0.88%	1.10%	1.48%	1.23%	-0.79%	-0.19%	**1.94%**	**6.37%**
IMA-B5+	-1.84%	2.49%	2.39%	0.65%	-1.18%	-1.19%	**1.24%**	**3.30%**
IDkA IPCA 20A	-3.59%	5.45%	5.00%	-0.33%	-2.10%	-3.32%	**0.71%**	**-1.92%**
Renda Variável								
IDIV	1.98%	4.27%	-1.80%	4.03%	0.78%	-1.61%	**7.71%**	**12.65%**
IBRX - 50	4.54%	6.33%	0.48%	5.32%	-2.19%	-2.55%	**12.12%**	**5.72%**
Ibovespa	4.69%	6.16%	0.47%	5.45%	-3.06%	-2.45%	**11.36%**	**4.69%**
IBrX - 100	4.40%	6.15%	-0.05%	5.57%	-3.11%	-2.63%	**10.33%**	**4.02%**
IFIX	0.66%	5.76%	0.49%	0.02%	-4.15%	0.00%	**2.56%**	**2.22%**
IVBX-2	5.79%	4.04%	-2.48%	8.89%	-7.47%	-3.14%	**4.74%**	**-12.91%**
ISE	4.40%	5.97%	-2.54%	7.65%	-10.48%	-4.37%	**-0.63%**	**-13.96%**
SMLL	5.16%	10.90%	-1.84%	7.30%	-11.23%	-3.01%	**5.76%**	**-15.06%**
Investimentos no Exterior								
S&P 500 (M. Orig.)	9.11%	-4.24%	-9.34%	7.99%	5.38%	-5.90%	**1.43%**	**-19.44%**
MSCI ACWI (M.Orig.)	6.86%	-3.86%	-9.74%	5.96%	7.60%	-4.05%	**1.44%**	**-19.80%**
S&P 500	8.08%	-4.42%	-5.36%	5.00%	6.12%	-7.26%	**1.04%**	**-24.68%**
MSCI ACWI	5.85%	-4.03%	-5.78%	3.03%	8.36%	-5.43%	**1.05%**	**-25.01%**
Global BDRX	7.65%	-3.05%	-8.38%	1.33%	7.09%	-4.22%	**-0.61%**	**-28.05%**
Índices Econômicos								
SELIC	1.03%	1.17%	1.07%	1.02%	1.02%	1.12%	**6.61%**	**12.37%**
INPC	-0.60%	-0.31%	-0.32%	0.47%	0.38%	0.69%	**0.30%**	**5.93%**
IPCA	-0.68%	-0.36%	-0.29%	0.59%	0.41%	0.62%	**0.28%**	**5.78%**
IGPM	0.21%	-0.70%	-0.95%	-0.97%	-0.56%	0.45%	**-2.51%**	**5.45%**
DÓLAR	-0.95%	-0.18%	4.39%	-2.77%	0.71%	-1.44%	**-0.39%**	**-6.50%**
Meta Atuarial								
INPC + 6% a.a.	-0.12%	0.22%	0.17%	0.94%	0.85%	1.20%	**3.29%**	**12.26%**
IPCA + 6% a.a.	-0.20%	0.17%	0.20%	1.06%	0.88%	1.13%	**3.27%**	**12.11%**
INPC + 5% a.a.	-0.20%	0.13%	0.09%	0.86%	0.77%	1.12%	**2.80%**	**11.21%**
IPCA + 5% a.a.	-0.28%	0.08%	0.12%	0.98%	0.80%	1.05%	**2.78%**	**11.05%**
INPC + 4% a.a.	-0.27%	0.05%	0.01%	0.78%	0.69%	1.04%	**2.31%**	**10.15%**
IPCA + 4% a.a.	-0.35%	0.00%	0.04%	0.90%	0.72%	0.97%	**2.28%**	**10.00%**

LDB CONSULTORIA

4.1. GRÁFICO DE DISPERSÃO DOS INDICADORES NO 2º SEMESTRE



Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
IBX-50	12,12%	23,46%
Ibovespa	11,36%	22,87%
IBX	10,33%	23,01%
IDIV	7,71%	20,84%
IMA-S	6,71%	0,04%
IRF-M 1	6,70%	0,31%
IRF-M 1+	6,63%	5,94%
CDI	6,61%	0,01%
Selic	6,61%	0,01%
IRF-M	6,49%	3,94%
SMLL	5,76%	29,48%
IMA Geral	4,95%	2,80%
IVBX-2	4,74%	24,66%
INPC + 6,00%	3,29%	0,36%
IPCA + 6,00%	3,27%	0,39%
IMA-B 5	2,98%	2,80%
INPC + 5,00%	2,80%	0,36%
IPCA + 5,00%	2,78%	0,39%
IFIX	2,56%	5,73%
IDkA IPCA 2 Anos	2,34%	3,28%
INPC + 4,00%	2,31%	0,36%
IPCA + 4,00%	2,28%	0,39%
IMA-B	1,94%	6,04%
MSCI ACWI (Moeda Original)	1,44%	18,95%
S&P 500 (Moeda Original)	1,43%	23,43%
IMA-B 5+	1,24%	9,45%
MSCI ACWI	1,05%	23,37%
S&P 500	1,04%	28,10%
IDkA IPCA 20 Anos	0,71%	16,17%
INPC	0,30%	0,36%
IPCA	0,28%	0,39%
Dólar	-0,39%	17,07%
Global BDRX	-0,61%	29,03%
ISE	-0,63%	25,37%
IGP-M	-2,51%	0,42%

LDB EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

3º TRIMESTRE 2022



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.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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 (%) Dia	Mês	Trim.	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	0,05	1,09	3,33	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	3,38	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	0,40	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	0,00	0,50	3,69	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	3,37	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	3,37	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	3,38	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	3,19	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	0,50	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	0,26	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	3,21	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	0,11	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	0,40	8.814.278,84	2,21	6.260.416.458,58	0,14
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,84	0,37	1,53	2,97	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	2,87	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	3,54	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	3,32	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**	**2,34**	**100.605.919,58**	**25,23**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Trim.	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,14	0,05	1,07	3,29	3.337.702,57	0,84	28.919.876.622,20	0,01

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	2,83	0,25	1,21	3,07	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	3,35	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	0,38	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	3,44	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**	**1,84**	**298.227.389,43**	**74,77**		
		Renda Fixa	**1,57**	**0,07**	**0,87**	**2,18**	**398.833.309,01**	**100,00**		

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,20	0,00	0,26	3,71	0,00	0,00	2.178.950.672,02	0,00
		Sub-total Artigo 10º I	**3,20**	**0,00**	**0,26**	**3,71**	**0,00**	**0,00**		
		Investimentos Estruturados	**2,96**	**0,00**	**0,26**	**3,71**	**0,00**	**0,00**		
		Total	**1,57**	**0,07**	**0,87**	**2,18**	**398.833.309,01**	**100,00**		

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	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					

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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 b % do CDI	0,91 84,78	2,34 70,83	2,34 70,83	4,90 77,59	9,38 86,12	1.410.188,00	5.314.364,99
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 76,87	1,84 55,71	1,84 55,71	4,48 70,89		1.877.761,13	3.041.844,72
Artigo 10º I % do CDI	0,26 24,37	3,71 111,99	3,71 111,99	3,65 57,85		248,82	3.414,04
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						**3.288.197,95**	**8.359.623,75**

RESULTADO POR ATIVO

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	3.913.547,05	0,00	0,00	0,00	3.961.990,73	48.443,68	110.652,20
BB PREV RF IDKA2	12.124.493,06	0,00	-10.000.000,00	0,00	2.139.938,28	15.445,22	-16.813,30
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	132.244,31
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	29.787,70
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	1.326.637,19
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	145.040,09
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	-112.860,16
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	44.529,71
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	336.773,62
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	1.094.743,02
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	1.137.962,29
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	227.612,80
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	15.737.005,49	0,00	-15.000.000,00	0,00	779.172,68	42.167,19	262.042,63
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	28.979,34
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	204.612,24
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	329.188,49

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financeiro Trimestre (R$)
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	33.232,82
					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$)	Resultado Financeiro Trimestre (R$)
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	3.302.243,24	0,00	0,00	0,00	3.337.702,57	35.459,33	106.381,67
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	1.097.634,86
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	38.038.912,80	2.219.530,10	0,00	0,00	40.694.329,33	435.886,43	1.245.164,30
BRADESCO 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	153.467,61
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	16.135.237,97	0,00	-6.000.000,00	0,00	10.284.272,46	149.034,49	439.196,28
					298.227.389,43	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financeiro Trimestre (R$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	95.256,99	0,00	-95.505,81	0,00	0,00	248,82	3.414,04
					0,00	0,00	0,00

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

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

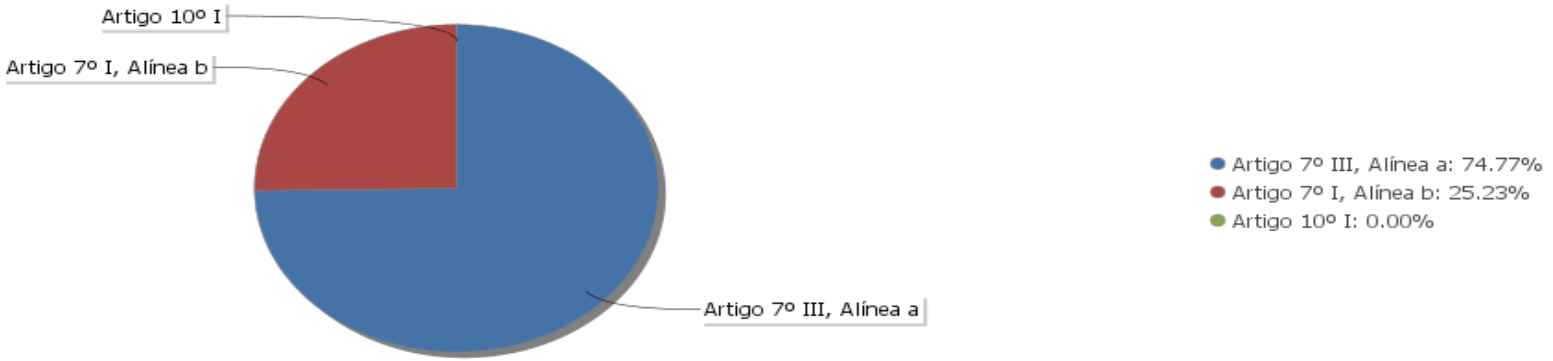
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

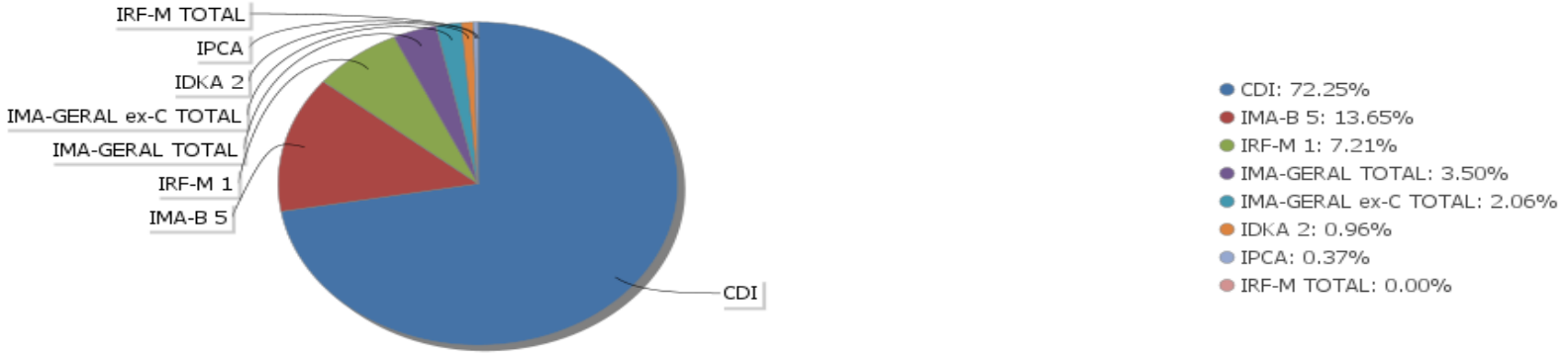
Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



8 de 22

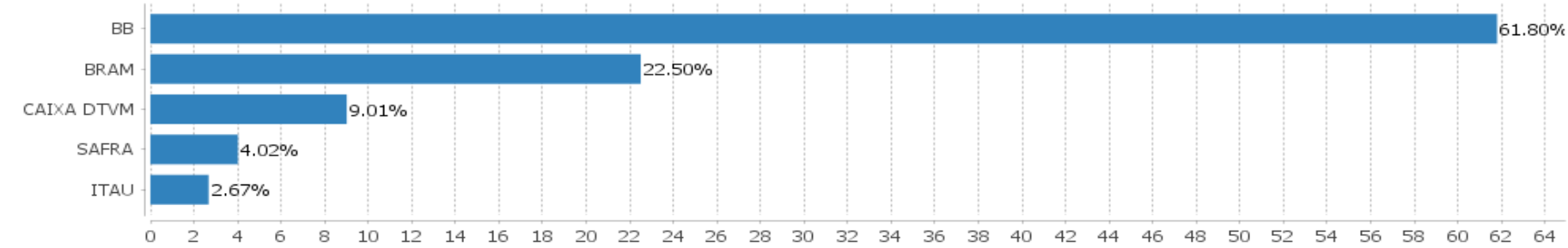
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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										-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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	4	33,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	66,67

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,18	-0,07	2,26	1,32
06 meses	4,75	3,37	1,38	1,28
12 meses	9,45	12,79	-3,34	1,57
24 meses				
Desde 30/09/2021	9,45	12,79	-3,34	1,57

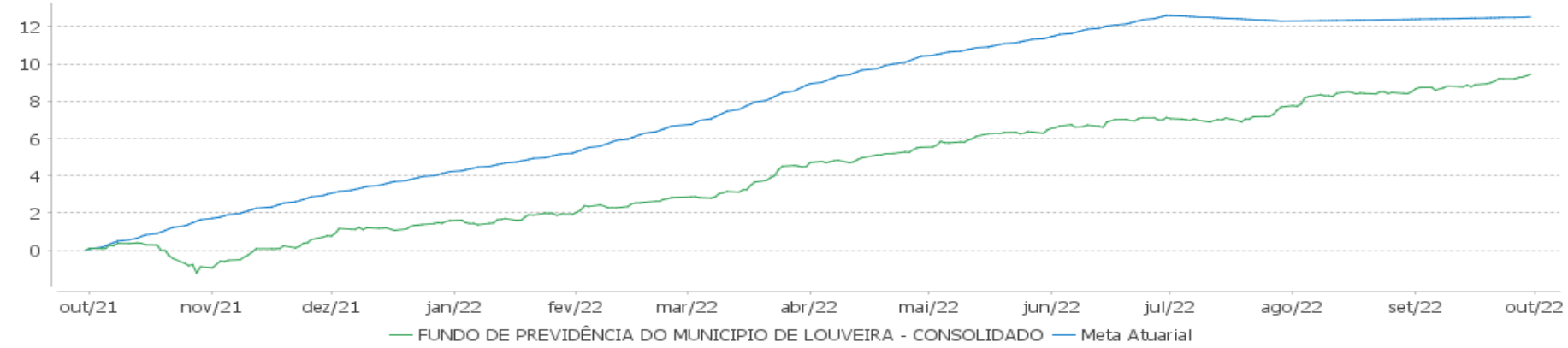
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



11 de 22

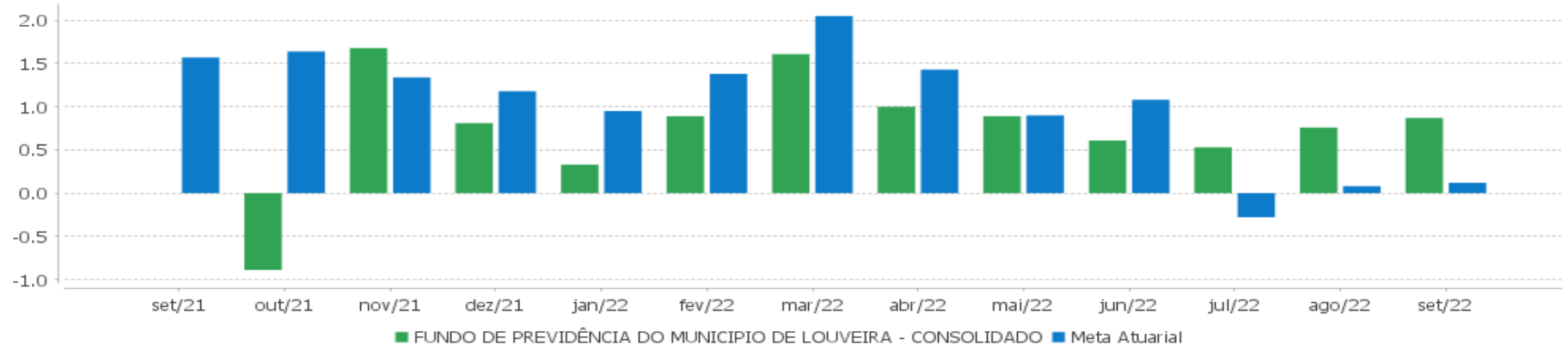
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 0,00	3,38 -0,05	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	0,50 0,06	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	0,40 -0,03	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	3,37 -0,06	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	0,40 -0,03	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	3,33 100,46	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	3,19 0,02	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	3,32 100,25	3,32 100,25	6,22 98,60	10,87 99,73	14,06 98,93	17,74 97,06
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	1,53 1,82	2,97 4,30	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	0,26 0,18	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	4,59 -0,08	4,59 -0,08	5,37 -0,16	7,70 -0,31	6,38 -0,54	13,12 -0,81
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	1,10 -0,02	3,38 -0,05	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	2,87	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	3,54 4,86	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	0,11 0,02	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	3,37 -0,07	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	3,21	3,21	5,05	8,89	10,80	14,70

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.							
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,41 -0,01	0,38 -0,05	0,38 -0,05	2,94 -0,20	8,79 -0,46	14,20 -1,54	22,35 -1,78
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,12 104,02	3,44 103,94	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	3,35 101,16	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	3,29 99,45	3,29 99,45	6,25 98,94	10,92 100,22	14,13 99,42	17,83 97,59
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,21 -0,05	3,07 -0,10	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	4,90 148,03	4,90 148,03	4,84 76,73	10,03 92,10	15,37 108,16	18,89 103,38
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,87 0,75	2,18 2,26	2,18 2,26	4,75 1,38	9,45 -3,07		
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	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
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI			D+0	D+0		0,10

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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

Renda Variável

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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	-5,36	-2,23	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
93	07/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	64.851,67	25.451,87847900	2,5480111440
102	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.000.000,00	2.635.694,99135116	2,6558460000
97	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.000.000,00	0,00	559.491,57881250	3,5746740000
101	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.510,16	535,51868000	2,8199950000
99	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	246.128,79	55.066,66851618	4,4696510000
98	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.000.000,00	0,00	1.118.655,57288477	4,4696510000
96	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	95.455,69	35.941,72628985	2,6558460000
103	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	67.183,70	25.348,40822801	2,6504110000
100	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	12.821,32	2.865,72509797	4,4740230000
90	14/07/2022	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.223.163,70	0,00	162.290,64606470	13,6986558000
104	15/07/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	641.147,75	242.421,71885410	2,6447620000
95	15/07/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	995.612,37	0,00	222.104,96269928	4,4826210000
94	18/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	150.358,14	0,00	58.811,40464900	2,5566153520
92	28/07/2022	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	1.107.089,91	395.499,49905679	2,7992195000
91	28/07/2022	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	367.479,54	131.279,28695838	2,7992195000
108	03/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	52.863,20	20.554,95164700	2,5717988010
113	03/08/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	332.255,16	92.492,69873001	3,5922312200
111	03/08/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	88.718,26	24.697,25765593	3,5922312200
105	12/08/2022	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.202.646,70	0,00	159.070,70331975	13,8469665000
109	15/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	150.358,14	0,00	58.226,41822900	2,5823010340
114	15/08/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	633.521,09	236.422,62595867	2,6796127800
112	15/08/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	961.925,13	0,00	212.405,71024905	4,5287159600
110	18/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.100,00	1.971,93721600	2,5862892380
107	29/08/2022	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	750.574,83	265.018,13807393	2,8321640000
106	29/08/2022	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	739.730,64	261.189,19667081	2,8321640000
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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.219.530,10	0,00	158.268,62899896	14,0238158000
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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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		**252.250.874,95**	**250.056.586,54**		

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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 ALOCACAO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI		0,01	-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

LDB EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO 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.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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 (%) Dia	Mês	Trim.	Valor (R$)	% Carteira
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 (%) Dia	Mês	Trim.	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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**		

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 1,40%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Trim.	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
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**		

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea 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					

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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 MUNICIPIO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
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	

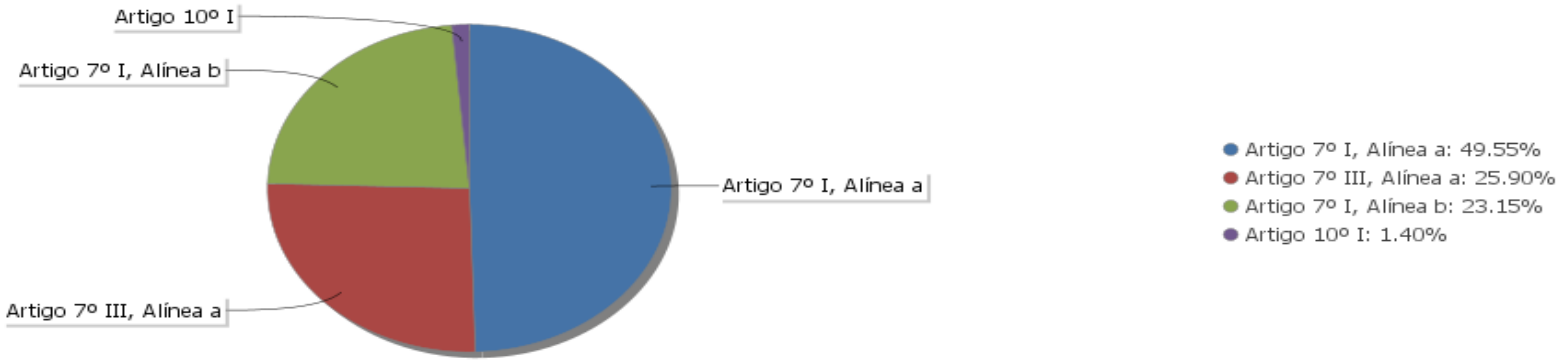
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

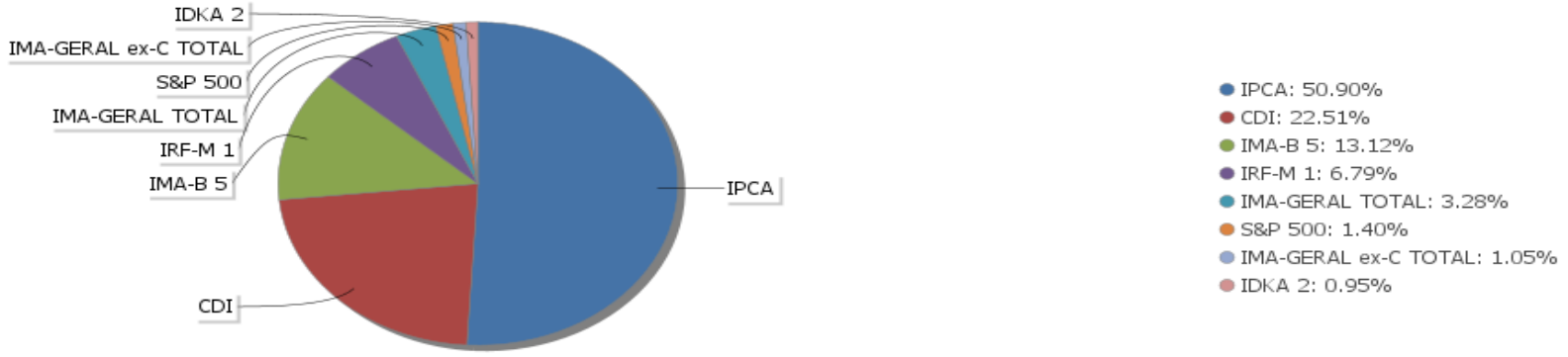
Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



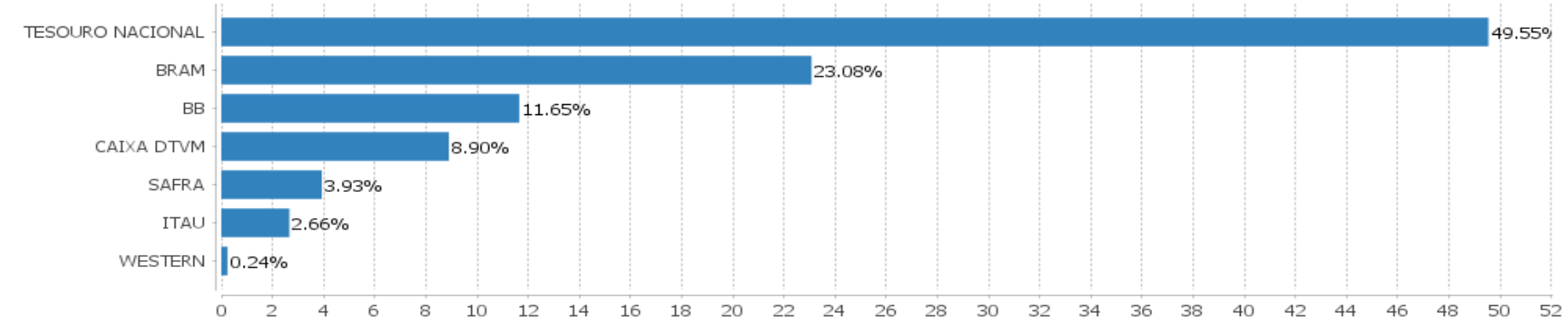
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	5	33,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	10	66,67

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,64	2,86	-0,21	0,82
06 meses	4,88	2,78	2,10	1,10
12 meses	10,59	11,05	-0,47	1,22
24 meses				
Desde 30/09/2021	12,35	16,02	-3,67	1,46

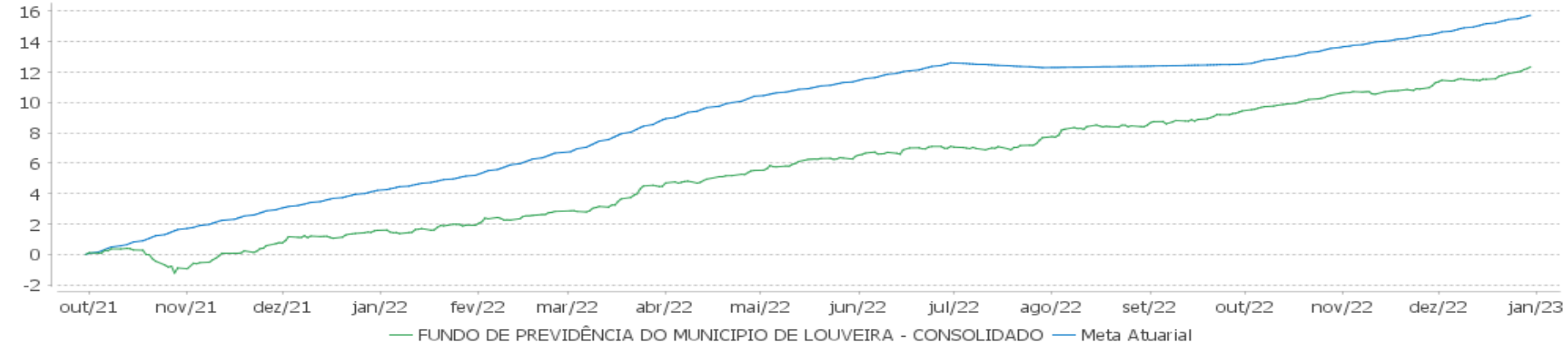
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



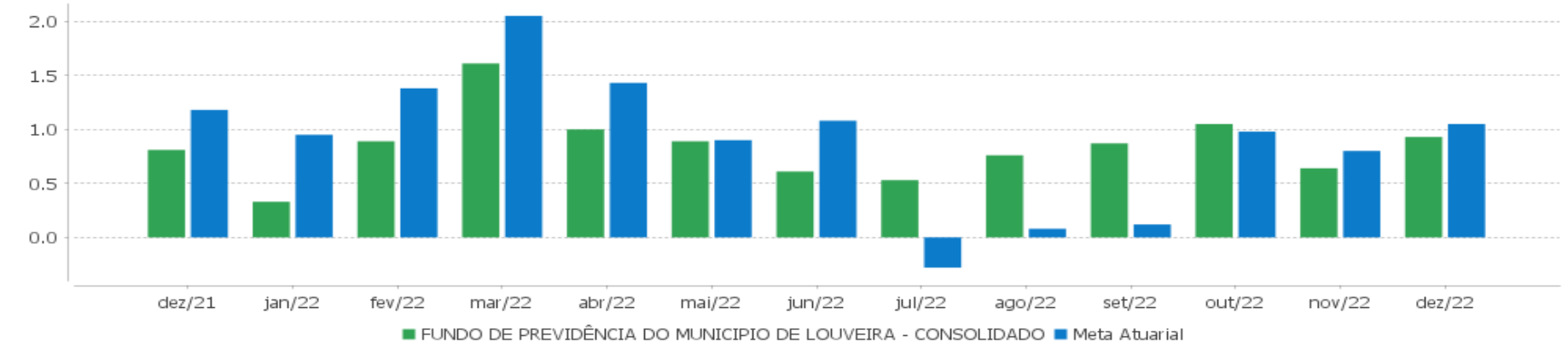
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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 ALOCACAO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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	1,23	2,36	2,36	2,47	9,04	14,12	23,29
Var. IDKA 2 p.p.	-0,01	0,11	0,11	0,13	-0,30	-0,66	-1,38
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,77	1,67	1,67	4,80	9,30	9,89	
Var. IPCA p.p.	0,15	0,04	0,04	4,51	3,52	-6,54	
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,15	3,09	3,09	6,56	11,74	14,76	18,92
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,06	-0,06	-0,13	-0,28	-0,54	-0,80
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,84	1,90	1,90	5,17	9,52	9,78	14,74
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.							
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,93	2,41	2,41	2,80	9,29	13,30	22,20
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,12	-0,12	-0,17	-0,49	-1,49	-1,82
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,17	3,34	3,34	6,89	13,00	18,58	21,11
% do CDI	103,79	104,31	104,31	104,19	105,05	107,34	102,67
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,12	3,22	3,22	6,67	12,59	17,79	20,62
% do CDI	99,92	100,61	100,61	100,91	101,73	102,78	100,29
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,09	2,39	2,39	6,22	11,61	14,42	20,06
% do CDI	97,28	74,75	74,75	94,01	93,87	83,32	97,57
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1,10	3,17	3,17	6,57	12,35	17,22	20,13
% do CDI	98,20	99,18	99,18	99,31	99,81	99,47	97,89
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	0,76	1,63	1,63	4,74	9,30	9,39	15,78
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,01	-0,10	-0,10	-0,21	-0,36	-1,32	-0,84
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-0,26	-3,59					
Var. S&P 500 p.p.	7,00	-1,80					
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO	0,93	2,64	2,64	4,88	10,59		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,12	-0,21	-0,21	2,10	-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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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	BRADESCO 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	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	248.363,60	17.459,26032465	14,2253220000
199	26/10/2022	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	1.598.022,34	552.796,36155767	2,8907975000
188	27/10/2022	BRADESCO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
213	11/11/2022	BRADESCO 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	BRADESCO 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	BRADESCO 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	BRADESCO 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	BRADESCO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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	BRADESCO 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**		

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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 MUNICIPIO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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
BRADESCO 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
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,43	0,12	0,05			38.060.750,82	9,24
BRADESCO 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

LDB EMPRESAS

FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

DEZEMBRO 2022



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.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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	Ano		
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	Ano				
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	12,43	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	11,85	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	9,60	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	11,73	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	11,74	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	9,42	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	9,67	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	9,32	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	9,52	4.327.690,38	1,05	164.124.316,76	2,64

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,04	1,23	9,04	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	9,51	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	7,83	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	7,27	0,00	0,00	0,00	
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	1,14	10,70	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	6,76	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**	**10,77**	**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	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,08	0,05	1,10	12,35	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	9,30	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	12,59	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	9,29	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	13,00	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**	**10,60**	**106.717.347,12**	**25,90**		
		Renda Fixa	**1,20**	**0,04**	**0,95**	**10,67**	**406.181.481,49**	**98,60**		

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 1,40%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
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**	**4,00**	**5.784.686,82**	**1,40**		
		Investimentos Estruturados	**8,63**	**3,90**	**-0,26**	**4,00**	**5.784.686,82**	**1,40**		
		Total	**1,22**	**0,09**	**0,93**	**10,59**	**411.966.168,31**	**100,00**		

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea 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					

Diário Oficial assinado digitalmente conforme MP nº 2.200-2, de 2001, e Lei 14.063, de 2020, garantindo autenticidade, validade jurídica e integridade.

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,85 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	10,77 87,02	2,76 86,26	5,17 78,14	10,77 87,02	984.568,50	22.642.972,18
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 93,34	10,60 85,71	2,77 86,46	4,66 70,46	10,60 85,71	1.144.546,49	11.895.984,97
Artigo 10º I % do CDI	-0,26 -22,90	4,00 32,33	-3,59 -112,21	-0,01 -0,22	4,00 32,33	-14.918,40	-208.344,37
FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO (Total)						**3.760.414,30**	**38.729.663,69**

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150535 (5,810000%)	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$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3.998.784,69	0,00	-3.983.349,11	0,00	0,00	-15.435,58	269.887,15
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	772.332,17
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	376.320,11
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	1.387.034,83

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
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	4.008.506,03
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	2.157.594,52
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	730.786,80
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	929.221,38
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	3.050.290,08
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	3.461.293,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	714.894,50	0,00	0,00	0,00	723.039,09	8.144,59	598.184,84
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	777.925,64	0,00	0,00	0,00	775.048,99	-2.876,65	1.035.448,16
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	957.913,39
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	2.895.111,02	0,00	0,00	0,00	2.928.602,57	33.491,55	957.838,08
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	410.074,92
					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$)	Resultado Financ. Ano (R$)
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	3.406.001,15	0,00	0,00	0,00	3.443.572,68	37.571,53	378.508,90
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	1.434.899,93
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	4.305.248,83
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	4.460.913,83
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	10.372.541,22	0,00	0,00	0,00	10.451.512,11	78.970,89	1.267.112,52
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$)	Resultado Financ. Ano (R$)
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	5.799.605,22	0,00	0,00	0,00	5.784.686,82	-14.918,40	-215.313,18
					5.784.686,82	0,00	0,00

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
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	

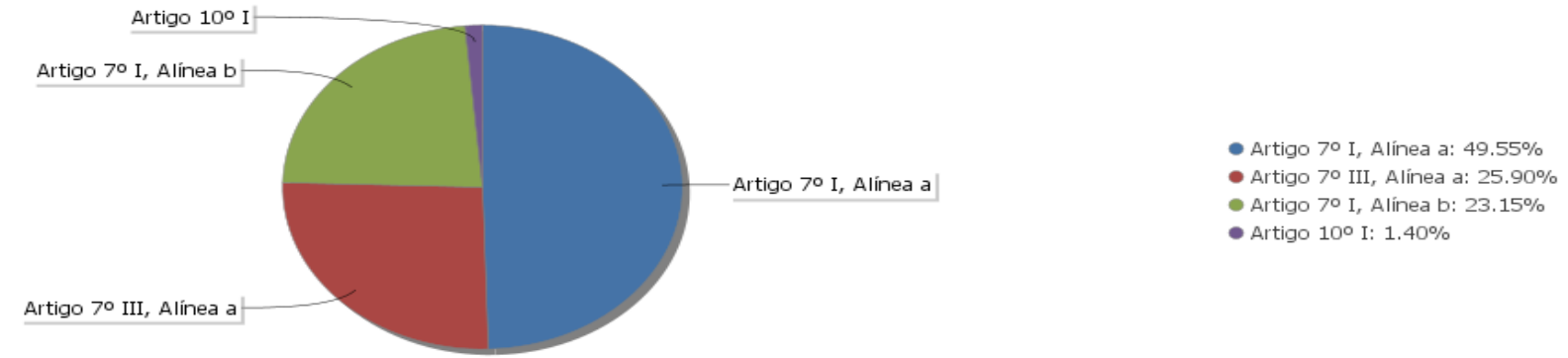
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

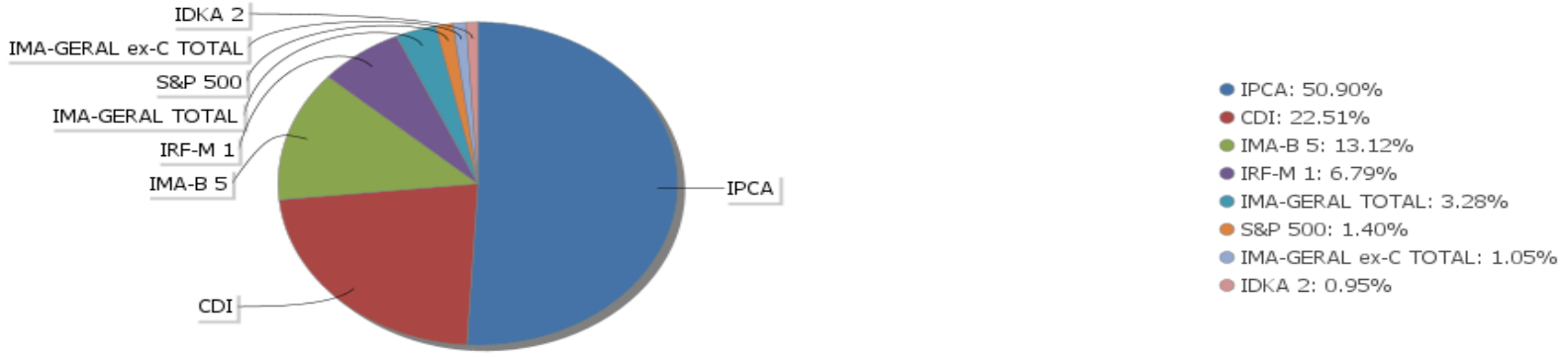
Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



8 de 22

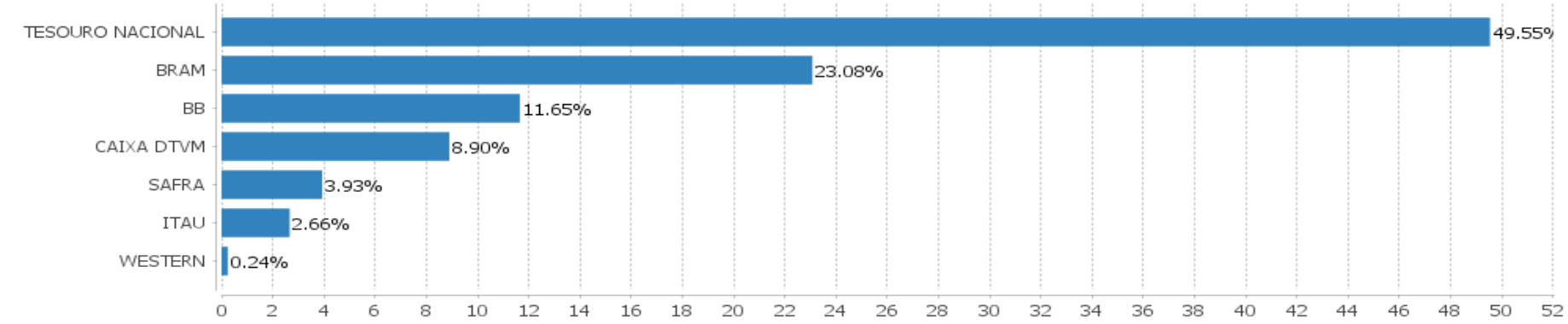
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	5	33,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	10	66,67

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,68	2021-11
Menor rentabilidade da Carteira	-0,89	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,64	2,86	-0,21	0,82
06 meses	4,88	2,78	2,10	1,10
12 meses	10,59	11,05	-0,47	1,22
24 meses				
Desde 30/09/2021	12,35	16,02	-3,67	1,46

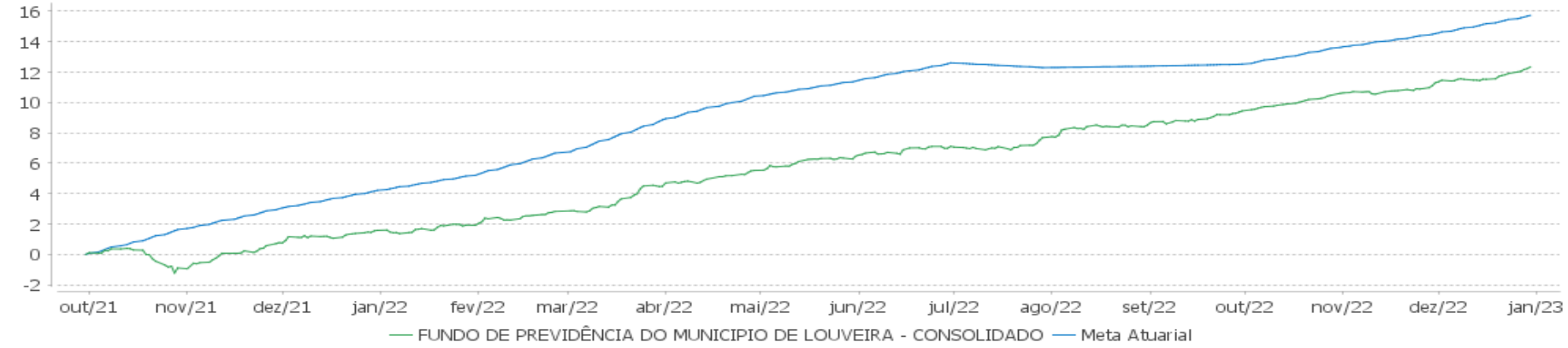
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido



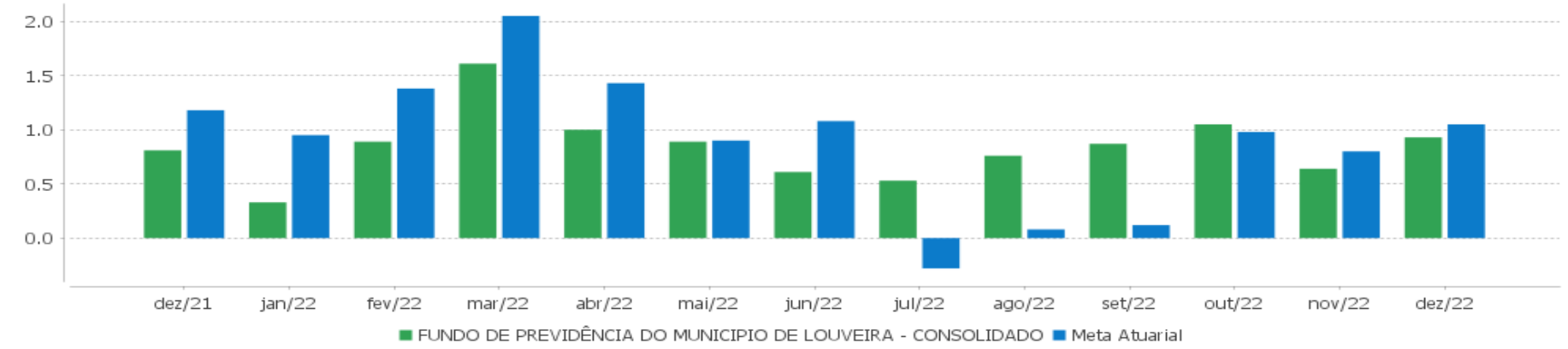
LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



12 de 22

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,52	4,91	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	9,04 -0,30	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	9,30 3,52	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	11,74 -0,28	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	9,52	1,90	5,17	9,52	9,78	14,74
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,93 -0,01	9,29 -0,49	2,41 -0,12	2,80 -0,17	9,29 -0,49	13,30 -1,49	22,20 -1,82
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,17 103,79	13,00 105,05	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	12,59 101,73	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	11,61 93,87	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	12,35 99,81	3,17 99,18	6,57 99,31	12,35 99,81	17,22 99,47	20,13 97,89
BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,76 -0,01	9,30 -0,36	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 MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,93 -0,12	10,59 -0,47	2,64 -0,21	4,88 2,10	10,59 -0,47		
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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

Renda Variável

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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	BRADESCO 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	BRADESCO 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	BRADESCO 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
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	BRADESCO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	Total		**27.027.680,08**	**25.815.904,13**		

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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 MUNICIPIO 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICIPIO DE LOUVEIRA - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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
BRADESCO 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
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,43	0,12	0,05			38.060.750,82	9,24
BRADESCO 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