



**LDB**  
EMPRESAS

**ESTADO DE SANTA CATARINA**  
AGOSTO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.08.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

98,73%

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	2,37	0,02	1,04	10,75	135.929.634,29	18,95	5.967.981.074,09	2,28
BB	BB	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	0,02	0,05	0,58	0,58	7.808.459,09	1,09	9.484.232.450,43	0,08
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,00	0,06	7,68	0,00	0,00	6.785.029.538,03	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,89	-0,64	-0,40	11,65	160.742.643,98	22,41	5.260.991.740,78	3,06
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,05	1,04	1,04	183.878.225,02	25,64	29.293.680.703,24	0,63
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,38	0,00	0,36	7,95	0,00	0,00	6.160.923.946,07	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,55	-1,00	-1,29	13,97	8.473.601,79	1,18	1.858.783.140,34	0,46
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,26	-0,24	0,58	8,63	85.834.283,80	11,97	5.437.581.646,17	1,58
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	4,93	-0,35	0,55	12,68	11.964.260,03	1,67	342.301.002,78	3,50
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,32</b>	<b>-0,21</b>	<b>0,67</b>	<b>10,29</b>	<b>594.631.108,00</b>	<b>82,90</b>		

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				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,00	0,10	7,68	0,00	0,00	14.734.335.445,36	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,05	8,15	113.511.609,47	15,83	3.554.344.878,79	3,19
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,46</b>	<b>0,05</b>	<b>1,06</b>	<b>8,42</b>	<b>113.511.609,47</b>	<b>15,83</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,49</b>	<b>-0,17</b>	<b>0,64</b>	<b>9,44</b>	<b>708.142.717,47</b>	<b>98,73</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**RENTA VARIÁVEL**

**1,27%**

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	<b>BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA</b>	19,59	-1,45	-4,02	6,01	9.126.985,26	1,27	319.333.302,91	2,86
		<b>Sub-total Artigo 8º I</b>	<b>19,59</b>	<b>-1,45</b>	<b>-4,02</b>	<b>6,01</b>	<b>9.126.985,26</b>	<b>1,27</b>		
		Renda Variável	19,59	-1,45	-4,02	6,01	9.126.985,26	1,27		
		Total	1,58	-0,19	0,58	9,36	717.269.702,73	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	594.631.108,00	82,90	0,00	44,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	113.511.609,47	15,83	0,00	43,00	70,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>708.142.717,47</b>	<b>98,73</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.126.985,26	1,27	0,00	3,00	40,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>9.126.985,26</b>	<b>1,27</b>					30,00
<b>Total</b>		<b>717.269.702,73</b>	<b>100,00</b>					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,67 58,70	10,29 116,01	3,37 101,62	8,15 122,10	13,62 100,51	2.493.972,26	42.633.039,25
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,06 92,83	8,42 94,91	3,15 94,98	6,36 95,22	12,61 93,05	2.121.016,13	21.010.130,99
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,02 1,06	6,01 0,54	7,81 0,97	9,63 -0,68	2,31 -3,37	-382.375,71	517.396,69
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	3,54 39,91	0,00 0,00	1,86 27,90	6,99 51,58	0,00	1.343.005,22
<b>ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)</b>						<b>4.232.612,68</b>	<b>65.503.572,15</b>

## RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IRF-M 1+	11.899.354,05	0,00	0,00	0,00	11.964.260,03	64.905,98	1.346.306,29
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	134.531.775,36	0,00	0,00	0,00	135.929.634,29	1.397.858,93	15.293.915,82
BB PREV RF IDKA2	47.296.062,35	0,00	-47.465.568,43	0,00	0,00	169.506,08	3.496.772,07
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	161.390.260,92	0,00	0,00	0,00	160.742.643,98	-647.616,94	9.755.518,98
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	39.200.961,44	46.484.743,04	0,00	0,00	85.834.283,80	148.579,32	3.054.406,43
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.584.102,28	0,00	0,00	0,00	8.473.601,79	-110.500,49	1.038.490,83
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	42.530.830,34	0,00	-42.554.880,79	0,00	0,00	24.050,45	2.189.387,75
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	0,00	7.763.479,89	0,00	0,00	7.808.459,09	44.979,20	44.979,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	182.476.015,29	0,00	0,00	183.878.225,02	1.402.209,73	1.402.209,73
					594.631.108,00	2.493.972,26	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	150.613.459,99	431.254.417,25	-470.342.278,73	0,00	113.511.609,47	1.986.010,96	11.598.699,14
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	129.915.965,21	0,00	-130.050.970,38	0,00	0,00	135.005,17	9.411.431,85

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					113.511.609,47	2.121.016,13	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	9.509.360,97	0,00	0,00	0,00	9.126.985,26	-382.375,71	517.396,69
					9.126.985,26	-382.375,71	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

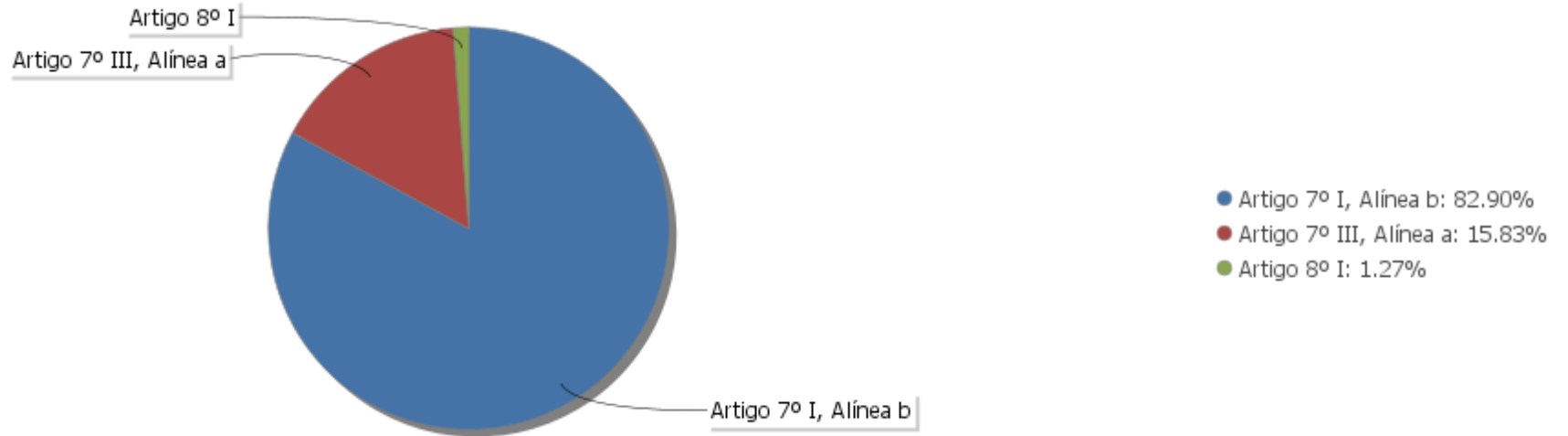
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	717.269.702,73	100,00	717.269.702,73	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	717.269.702,73	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	717.269.702,73	100,00	

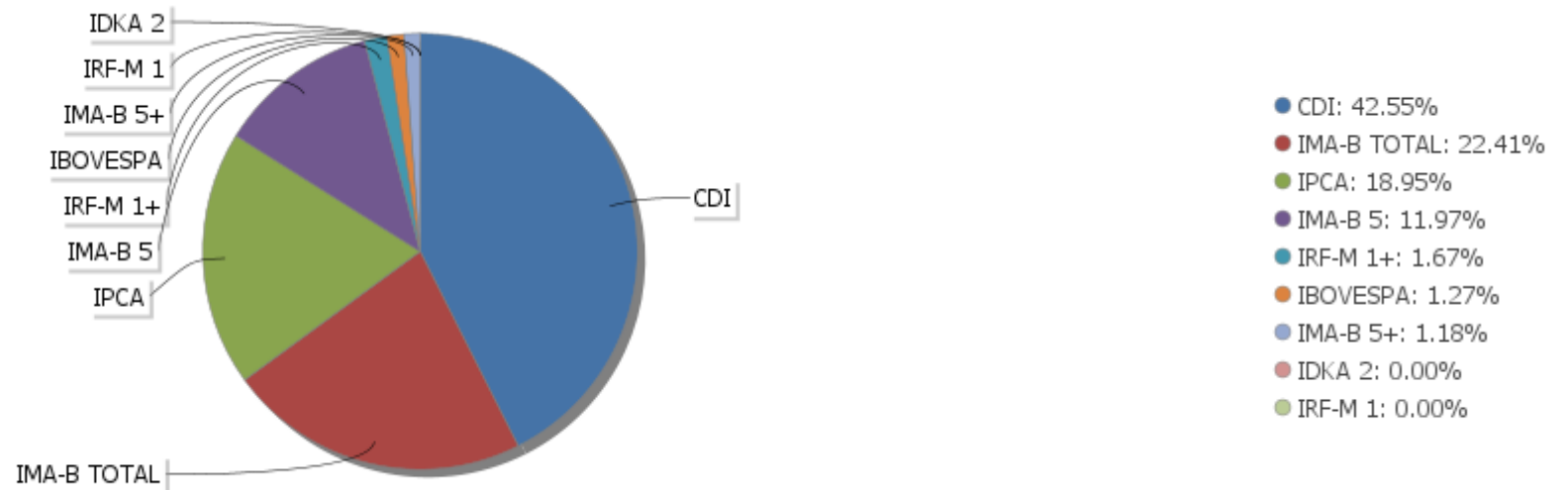


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

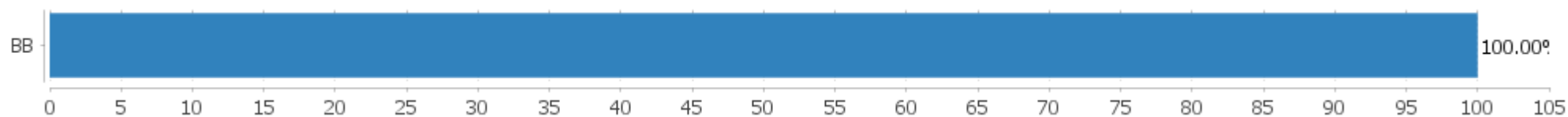


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	0,99	0,88	1,43	1,09	1,47	1,63	0,94	0,58					9,36
INPC + 1,72%	0,61	0,89	0,80	0,65	0,51	0,04	0,05	0,36					3,98
p.p. indexador	0,38	-0,02	0,63	0,44	0,96	1,59	0,88	0,22					5,38
2022	0,31	0,78	1,62	0,76	0,95	0,38	0,49	0,97	0,92	1,32	0,22	0,76	9,89
INPC + 1,55%	0,80	1,12	1,85	1,16	0,58	0,75	-0,47	-0,17	-0,19	0,59	0,50	0,83	7,57
p.p. indexador	-0,49	-0,33	-0,23	-0,40	0,36	-0,37	0,96	1,14	1,11	0,73	-0,28	-0,06	2,32
2021	-0,44	-0,71	-0,27	0,46	0,49	0,18	-0,09	-0,16	0,17	-0,87	1,43	0,77	0,94
IPCA + 2,89%	0,48	1,07	1,19	0,54	1,07	0,77	1,21	1,12	1,40	1,48	1,18	0,99	13,23
p.p. indexador	-0,91	-1,78	-1,46	-0,08	-0,58	-0,59	-1,31	-1,28	-1,23	-2,35	0,25	-0,22	-12,29
2020	0,46	0,40	-1,10	0,57	0,79	0,60	0,99	-0,41	-0,44	-0,00	0,62	2,20	4,74
IPCA + 3,16%	0,48	0,47	0,34	-0,06	-0,13	0,52	0,65	0,50	0,90	1,12	1,14	1,63	7,81
p.p. indexador	-0,02	-0,07	-1,44	0,63	0,92	0,08	0,34	-0,91	-1,34	-1,12	-0,52	0,57	-3,07

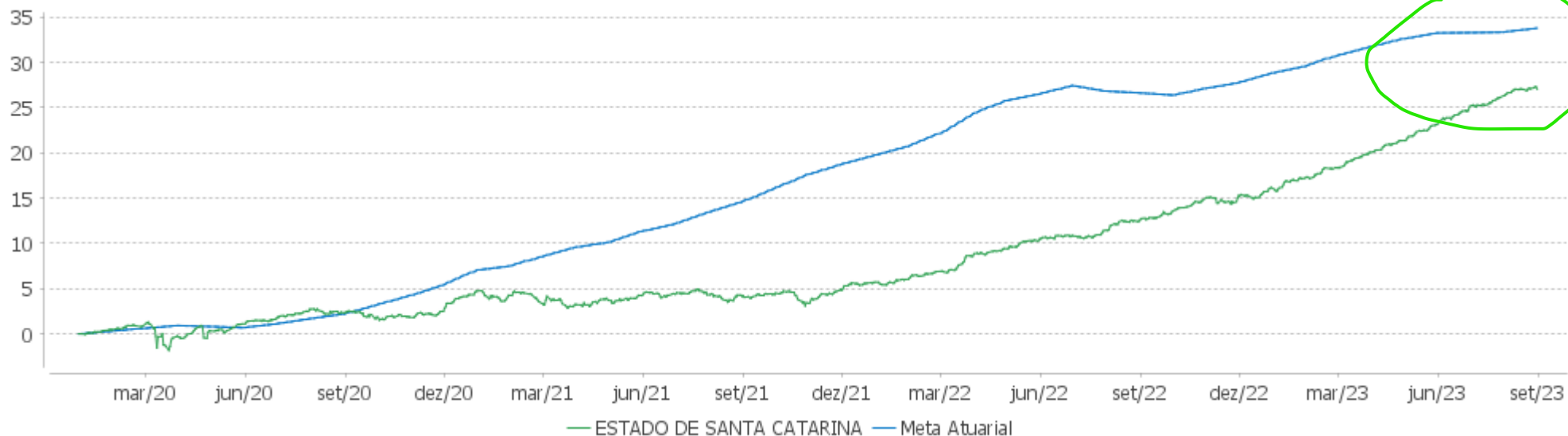
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

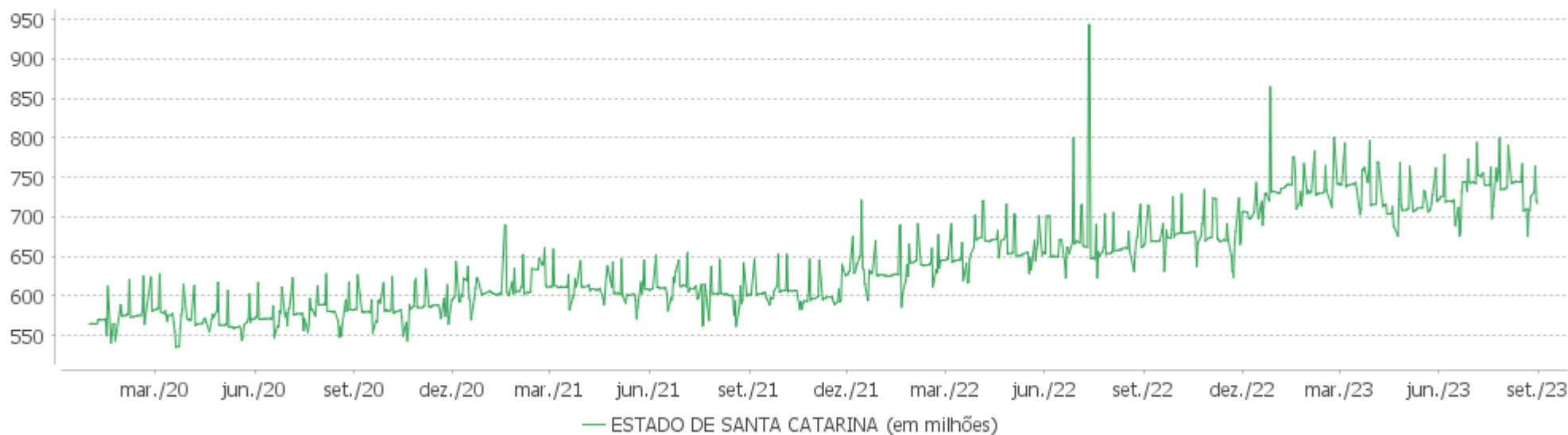
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	18	40,91	03 meses	3,17	0,45	2,72	1,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	59,09	06 meses	7,34	2,43	4,91	1,24
			12 meses	12,93	5,78	7,15	1,58
			24 meses	21,98	17,60	4,38	1,65
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12	36 meses	24,18	32,81	-8,63	1,88
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03	Desde 31/12/2019	27,05	36,53	-9,48	2,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

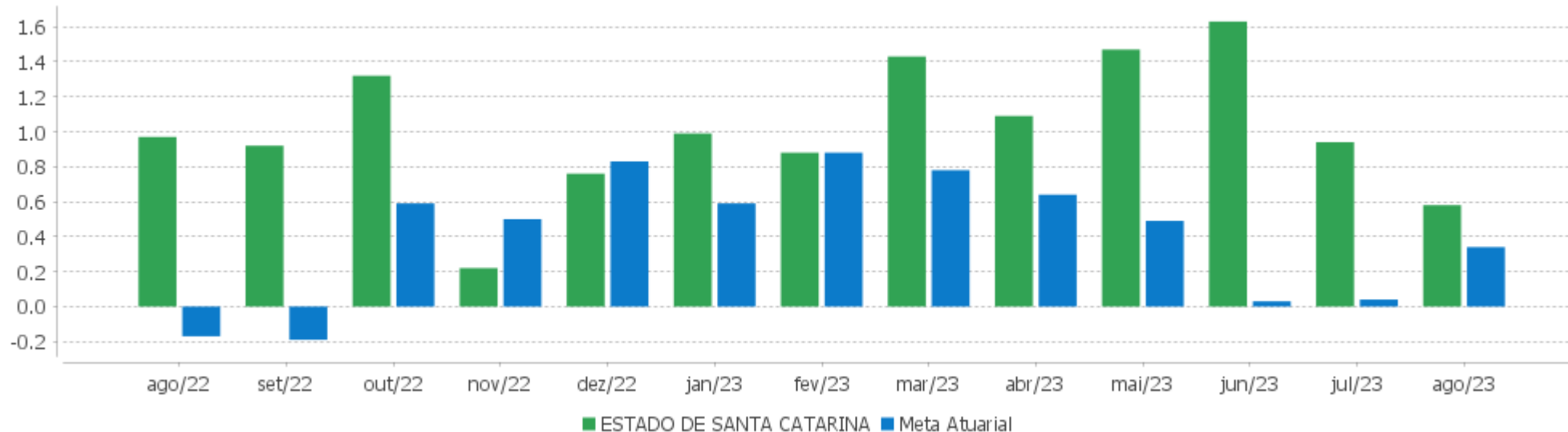


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,74 -0,03	8,36 -0,30	2,73 -0,02	5,26 -0,16	11,57 -0,23	21,91 -0,42	28,11 -0,44
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	0,55 -0,05	12,68 -0,31	4,02 -0,08	11,14 -0,17	15,43 -0,60	20,73 -0,88	16,33 -1,24
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,03	8,82 -0,23	3,37 -0,07	6,66 -0,16	13,40 -0,34	23,37 -0,66	25,63 -1,17
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,03	8,63 -0,11	2,58 -0,08	5,68 -0,08	11,73 -0,24	22,46 -0,57	27,99 -0,91
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI % do CDI	1,12 98,70	8,68 97,95	3,26 98,26	6,53 97,85	13,29 98,05	24,66 98,11	27,53 96,55
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	10,75 7,52	3,67 3,40	8,97 7,14	14,02 9,41	22,87 9,14	25,04 0,29
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,02	11,65 -0,20	2,71 -0,12	10,26 -0,17	13,45 -0,31	19,42 -0,65	23,03 -0,96
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	1,14 100,38	8,84 99,71	3,32 99,98	6,65 99,53	13,52 99,79	25,18 100,19	28,37 99,47
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,29 -0,02	13,97 -0,31	2,68 -0,12	14,11 -0,29	14,56 -0,44	15,81 -0,85	17,53 -1,23
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,16 101,39	8,81 99,38	3,35 100,89	6,69 100,21	13,54 99,91	25,45 101,24	28,93 101,46
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,05 92,46	8,15 91,91	3,06 92,33	6,14 91,93	12,44 91,82	22,65 90,13	24,53 86,01
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,02 1,06	6,01 0,54	7,81 0,97	9,63 -0,68	2,31 -3,37	-3,41 -0,85	14,24 -2,24
ESTADO DE SANTA CATARINA Var. INPC + 1,55% p.p.	0,58 0,22	9,36 5,38	3,17 2,72	7,34 4,91	12,93 7,09	21,98 4,81	24,18 -7,40
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV IRF-M 1+	D+0	D+0	D+1 du	D+1 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 FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA B 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 IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 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
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45



**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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3023	01/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	886.315,44	0,00	340.765,83237100	2,6009516090
3034	01/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.389.201,88	534.112,92820400	2,6009516090
2989	01/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	237.299,64	0,00	91.235,69972578	2,6009516090
3022	02/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.050.343,64	702.272,94633115	2,9195822660
3035	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	47.345,87	0,00	18.194,63402300	2,6021886420
3046	02/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	358,60	122,82613000	2,9195822660
3048	02/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	14.532.249,53	4.318.303,51414300	3,3652682080
3049	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	80.750.042,50	0,00	31.031.586,71768578	2,6021886420
3057	02/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	66.217.792,97	22.680.571,03276021	2,9195822660
3058	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	901.984,00	0,00	346.625,13910000	2,6021886420
2938	02/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.142.854,97	636.756,07391600	3,3652682080
2939	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.142.854,97	0,00	823.481,79352300	2,6021886420
2942	02/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	32.359,00	9.615,57813800	3,3652682080
2943	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	950.504,11	0,00	365.271,02403600	2,6021886420
2945	02/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	918.145,11	314.478,24620300	2,9195822660
2947	02/08/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	19.000.000,00	0,00	5.906.345,10012100	3,2168794200
2949	02/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	16.773.695,32	4.984.356,15792400	3,3652682080
2951	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	35.339.283,65	0,00	13.580.600,22229500	2,6021886420
2954	02/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	37.565.588,33	12.866.768,22484851	2,9195822660
2956	02/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	47.904,74	14.235,04564300	3,3652682080
2957	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.638.173,05	0,00	1.782.412,30291200	2,6021886420
2959	02/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.590.268,31	1.572.234,61844387	2,9195822660
2962	02/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	310.495,45	92.264,69684800	3,3652682080
2964	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	14.906.946,47	0,00	5.728.618,68251900	2,6021886420
2967	02/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	14.596.451,02	4.999.499,82228040	2,9195822660
2969	02/08/2023	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	8.715.321,78	2.589.785,19416700	3,3652682080
2970	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	12.845.740,38	0,00	4.936.513,89167800	2,6021886420
2988	02/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.112.022,40	1.408.428,33830200	2,9195822660

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2990	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	104.468,41	40.146,36307063	2,6021886420
3013	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.050.343,64	0,00	787.930,43936400	2,6021886420
2933	03/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.773,00	0,00	1.449,23345900	2,6034452730
2950	03/08/2023	BB PREV RF IDKA2	0,00	30.967.188,02	8.672.637,74948500	3,5706769860
2952	03/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	30.967.188,02	0,00	11.894.695,21067200	2,6034452730
2963	03/08/2023	BB PREV RF IDKA2	0,00	16.498.380,41	4.620.518,87450800	3,5706769860
2965	03/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	16.498.380,41	0,00	6.337.133,55955700	2,6034452730
2971	03/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.348,74	518,05967000	2,6034452730
2991	03/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	36.404,74	0,00	13.983,29374447	2,6034452730
3024	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	218,20	83,77310000	2,6046547280
3036	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.994,99	2.301,64479600	2,6046547280
2934	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	496,04	0,00	190,44366700	2,6046547280
2972	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.226,29	1.238,66321500	2,6046547280
2992	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	52.552.391,12	0,00	20.176.336,83077500	2,6046547280
3037	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	77.371,55	29.691,40984000	2,6058563880
2935	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	12.448.158,19	0,00	4.776.993,17864300	2,6058563880
2973	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	131.809,70	50.582,10445000	2,6058563880
2993	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	60.424.709,44	23.188.042,79401400	2,6058563880
3014	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	303.990,65	116.656,71654000	2,6058563880
2974	08/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	528,00	202,52607400	2,6070717140
2994	08/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	37.075,38	14.221,08176039	2,6070717140
2975	09/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.104,14	423,32450700	2,6082591060
2995	09/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	54.875,63	0,00	21.039,17891900	2,6082591060
3047	10/08/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	80.000.000,00	0,00	24.794.103,93431500	3,2265735520
3050	10/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	80.000.000,00	30.658.029,45054303	2,6094305940
2936	10/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	203,01	0,00	77,79858100	2,6094305940
2946	10/08/2023	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	30.000.000,00	0,00	1.169.423,27514200	25,6536710340
2948	10/08/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	36.476.015,29	0,00	11.304.876,42762405	3,2265735520
2953	10/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	66.476.015,29	25.475.295,43296700	2,6094305940
2960	10/08/2023	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	16.484.743,04	0,00	642.588,07319000	25,6536710340

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2961	10/08/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	15.000.000,00	0,00	4.648.894,48768400	3,2265735520
2966	10/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	31.484.743,04	12.065.752,24207600	2,6094305940
2968	10/08/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	32.000.000,00	0,00	9.917.641,57372600	3,2265735520
2976	10/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	32.000.000,00	12.263.211,78021700	2,6094305940
2996	10/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	15.128,65	0,00	5.797,68246500	2,6094305940
3015	11/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	198.135,59	0,00	75.896,43593000	2,6106046690
3026	11/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	59.624,56	22.839,36771700	2,6106046690
3038	11/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	282.612,93	0,00	108.255,73605837	2,6106046690
2997	11/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.323,13	0,00	6.635,67724585	2,6106046690
3016	14/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	99.161,87	0,00	37.967,24215500	2,6117743710
3027	14/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	190.470,02	0,00	72.927,44048400	2,6117743710
3039	14/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	467.911,55	179.154,66021701	2,6117743710
3051	14/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.964,23	0,00	1.517,83019300	2,6117743710
2932	14/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.517.233,99	4.792.616,90021400	2,6117743710
2998	14/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	12.172.986,56	0,00	4.660.810,93955200	2,6117743710
2937	15/08/2023	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	2.151.709,56	0,00	277.006,25973800	7,7677290110
2940	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.151.709,56	823.481,79352300	2,6129412640
2941	15/08/2023	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	954.431,73	0,00	122.871,39891800	7,7677290110
2944	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	954.431,73	365.271,02403600	2,6129412640
2955	15/08/2023	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	4.657.338,60	0,00	599.575,31904100	7,7677290110
2958	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.657.338,60	1.782.412,28158000	2,6129412640
2977	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	19.642,83	0,00	7.517,51685700	2,6129412640
2999	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	14.096,04	0,00	5.394,70220500	2,6129412640
3000	16/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	41.710,80	0,00	15.955,94828267	2,6141222860
2978	17/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	77.849,20	29.767,40081000	2,6152501690
3001	17/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	22.795.301,48	0,00	8.716.298,63567300	2,6152501690
3017	18/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	73.636,66	28.144,11337900	2,6164142750
3028	18/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	33.042.664,95	12.628.988,17886900	2,6164142750
3040	18/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.153,57	6.938,33930400	2,6164142750
2979	18/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	153.089,42	58.511,15454600	2,6164142750

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3002	18/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.208.208,87	10.016.842,17993345	2,6164142750
3041	21/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	12.948.700,17	0,00	4.946.934,76627800	2,6175198950
2980	21/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.774.470,80	3.734.248,90434309	2,6175198950
3003	21/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	154.405,62	0,00	58.989,28229541	2,6175198950
3018	22/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.335.435,23	7.765.387,23570300	2,6187277740
3042	22/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.429.736,19	3.982.749,29282600	2,6187277740
3052	22/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.625.984,56	1.384.635,92741500	2,6187277740
2981	22/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	310,39	118,52702000	2,6187277740
3004	22/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	21.752,64	0,00	8.306,56787400	2,6187277740
3029	23/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	39.042.275,79	0,00	14.902.278,54072800	2,6198863270
3053	23/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.695.661,78	2.937.402,93259700	2,6198863270
2982	23/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	110,00	41,98655400	2,6198863270
3005	23/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.572,53	0,00	981,92428100	2,6198863270
2983	24/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.104,00	1.565,80184400	2,6210213100
3006	24/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	131.159,93	0,00	50.041,53514400	2,6210213100
3019	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.967.298,63	0,00	2.275.675,03239100	2,6222103530
3030	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	72.649,91	0,00	27.705,59955900	2,6222103530
3054	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	11.752.060,19	0,00	4.481.738,15519900	2,6222103530
2984	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	107.783,76	41.104,16232500	2,6222103530
3007	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	10.795,63	0,00	4.116,99617700	2,6222103530
3043	28/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.728,86	0,00	1.040,20143500	2,6233957260
3008	28/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.021.070,57	0,00	1.913.958,50814100	2,6233957260
3009	28/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.743,07	1.807,98876500	2,6233957260
3020	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.001.709,18	381.661,83571700	2,6245987580
3031	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.526.192,36	2.867.559,21721700	2,6245987580
3044	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	423.442,07	161.335,92561884	2,6245987580
2985	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	776.407,34	295.819,44197506	2,6245987580
3010	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	41.303.024,77	0,00	15.736.891,07491300	2,6245987580
3021	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.564.407,77	976.619,45862900	2,6258004050
3032	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.604.853,44	611.186,37842500	2,6258004050

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3045	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.281.721,35	488.125,96249104	2,6258004050
3055	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	388.870,28	148.095,90220900	2,6258004050
2986	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	10.324.396,05	0,00	3.931.904,35584500	2,6258004050
3011	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	47.279.303,35	18.005.672,95974700	2,6258004050
3033	31/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.693.098,45	1.025.119,66534700	2,6271064160
3056	31/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	647,07	0,00	246,30521000	2,6271064160
2987	31/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	275,00	104,67790700	2,6271064160
3012	31/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	389.640,88	0,00	148.315,60595602	2,6271064160
<b>Total</b>			<b>667.978.655,47</b>	<b>690.413.698,33</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 5.001.044,69

Value-At-Risk: 0,70%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>ESTADO DE SANTA CATARINA</b>		<b>0,70</b>	0,70			717.269.702,73	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,66%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		<b>0,66</b>	0,11	0,67			135.929.634,29	18,95
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI		<b>0,01</b>	0,00	0,01			7.808.459,09	1,09
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		<b>1,86</b>	0,41	0,06			160.742.643,98	22,41
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		<b>0,01</b>	0,00	0,01			183.878.225,02	25,64
BB PREV RF IDKA2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		<b>2,87</b>	0,03	0,05			8.473.601,79	1,18
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		<b>0,72</b>	0,07	0,03			85.834.283,80	11,97
BB PREV IRF-M 1+		<b>1,48</b>	0,02	0,03			11.964.260,03	1,67
<b>Sub-total</b>	1,55	<b>0,79</b>	0,65		<b>-0,30</b>	<b>0,67</b>	594.631.108,00	82,90

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF FLUXO FIC		<b>0,01</b>	0,00	0,01			113.511.609,47	15,83
<b>Sub-total</b>	0,03	<b>0,01</b>	0,00		<b>-2,61</b>	<b>1,06</b>	113.511.609,47	15,83

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 7,08%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		7,08	0,05	1,13			9.126.985,26	1,27
<b>Sub-total</b>	13,00	7,08	0,05		-0,40	-4,02	9.126.985,26	1,27