



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA
DEZEMBRO 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 29.12.2023.

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 **98,62%**

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	1,58	0,04	0,95	14,99	127.609.938,30	17,01	6.297.472.287,75	2,03
BB	BB	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	0,04	0,04	0,88	4,34	8.161.358,64	1,09	11.119.001.429,69	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,45	0,09	2,74	15,77	167.418.267,17	22,32	5.283.374.941,87	3,17
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,04	0,04	0,90	4,89	181.833.898,43	24,24	31.713.195.919,09	0,57
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,98	0,09	3,93	18,87	8.837.913,85	1,18	1.649.727.443,32	0,54
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,10	1,44	11,93	88.441.220,65	11,79	5.230.672.087,91	1,69
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	3,92	0,04	1,69	18,06	12.535.226,56	1,67	393.124.777,08	3,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,98	0,07	1,56	14,49	594.837.823,60	79,30		

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 FLUXO FIC	0,04	0,04	0,82	11,93	144.911.495,81	19,32	4.049.178.389,19	3,58
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,04	0,04	0,82	12,21	144.911.495,81	19,32		
Renda Fixa			1,36	0,06	1,41	13,56	739.749.319,41	98,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,38%

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	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	16,24	-0,01	5,98	20,49	10.373.669,42	1,38	357.119.985,50	2,90
		Sub-total Artigo 8º I	16,24	-0,01	5,98	20,49	10.373.669,42	1,38		
		Renda Variável	16,24	-0,01	5,98	20,49	10.373.669,42	1,38		
		Total	1,44	0,06	1,47	13,62	750.122.988,83	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	594.837.823,60	79,30	0,00	44,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	144.911.495,81	19,32	0,00	43,00	70,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	739.749.319,41	98,62					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	10.373.669,42	1,38	0,00	3,00	40,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	10.373.669,42	1,38					30,00
Total		750.122.988,83	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,56 173,97	14,49 111,07	3,48 122,49	5,37 87,30	14,49 111,07	9.193.004,18	65.051.393,99
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 91,56	12,21 93,55	2,58 90,82	5,66 92,00	12,21 93,55	1.163.440,01	25.383.952,42
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,98 0,60	20,49 -1,79	12,86 -2,26	13,07 -0,56	20,49 -1,79	585.258,54	1.764.080,85
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	3,54 27,12	0,00 0,00	0,00 0,00	3,54 27,12	0,00	1.343.005,22
ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)						10.941.702,73	93.542.432,48

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+	12.326.678,27	0,00	0,00	0,00	12.535.226,56	208.548,29	1.917.272,82
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	126.411.238,75	0,00	0,00	0,00	127.609.938,30	1.198.699,55	20.206.936,18
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	162.947.756,53	0,00	0,00	0,00	167.418.267,17	4.470.510,64	16.474.721,48
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	87.181.856,56	0,00	0,00	0,00	88.441.220,65	1.259.364,09	5.661.343,28
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.503.590,98	0,00	0,00	0,00	8.837.913,85	334.322,87	1.402.802,89
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	8.090.276,99	0,00	0,00	0,00	8.161.358,64	71.081,65	333.222,23
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	189.183.421,34	0,00	-9.000.000,00	0,00	181.833.898,43	1.650.477,09	8.357.883,14
	594.644.819,42	0,00	-9.000.000,00	0,00	594.837.823,60	9.193.004,18	

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	127.853.744,39	287.196.791,87	-271.302.480,46	0,00	144.911.495,81	1.163.440,01	15.972.520,57
	127.853.744,39	287.196.791,87	-271.302.480,46	0,00	144.911.495,81	1.163.440,01	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	9.788.410,88	0,00	0,00	0,00	10.373.669,42	585.258,54	1.764.080,85
	9.788.410,88	0,00	0,00	0,00	10.373.669,42	585.258,54	

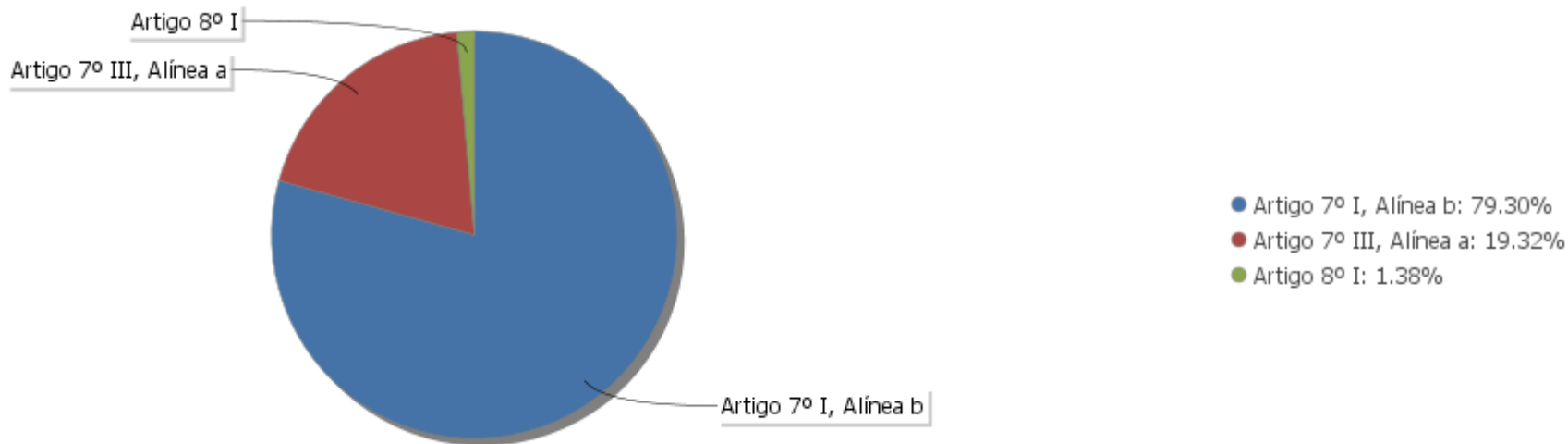
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

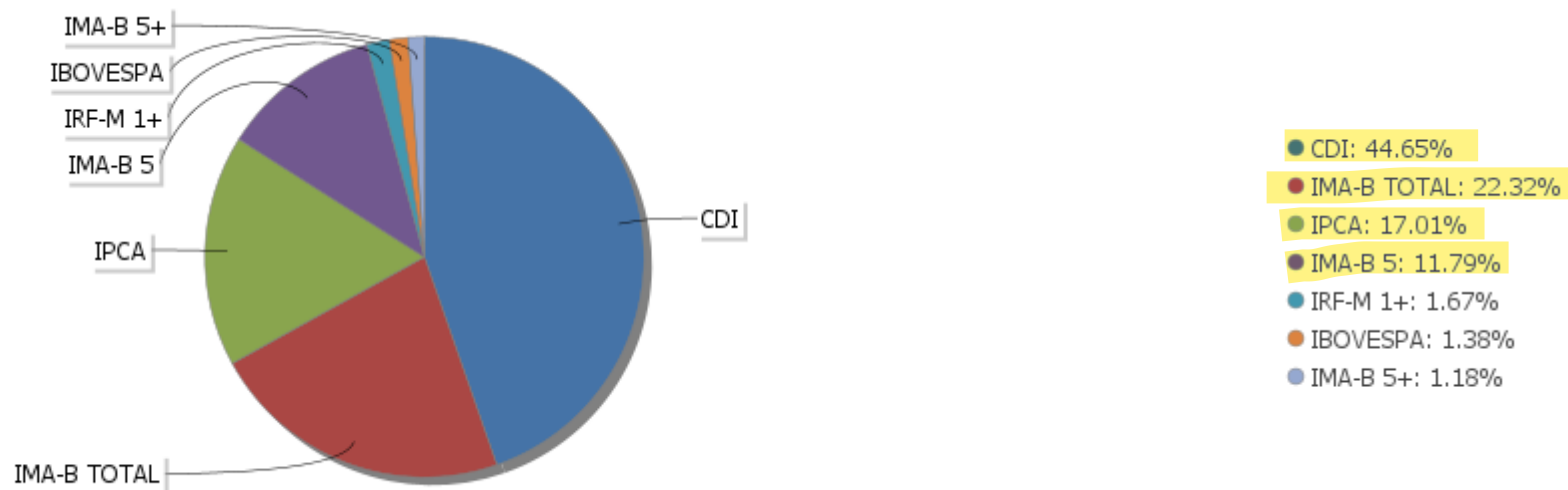
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	750.122.988,83	100,00	750.122.988,83	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	750.122.988,83	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	750.122.988,83	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

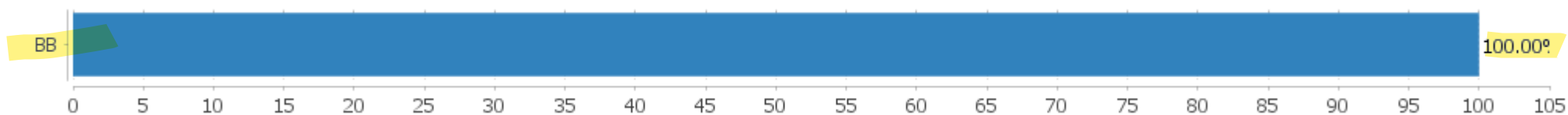


Alocação Por Estratégia



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	0,45	0,33	1,59	1,47	13,62
INPC + 1,72%	0,61	0,89	0,80	0,65	0,51	0,04	0,05	0,36	0,25	0,26	0,24	0,69	5,47
p.p. indexador	0,38	-0,02	0,63	0,44	0,96	1,59	0,88	0,22	0,20	0,07	1,36	0,79	8,15
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

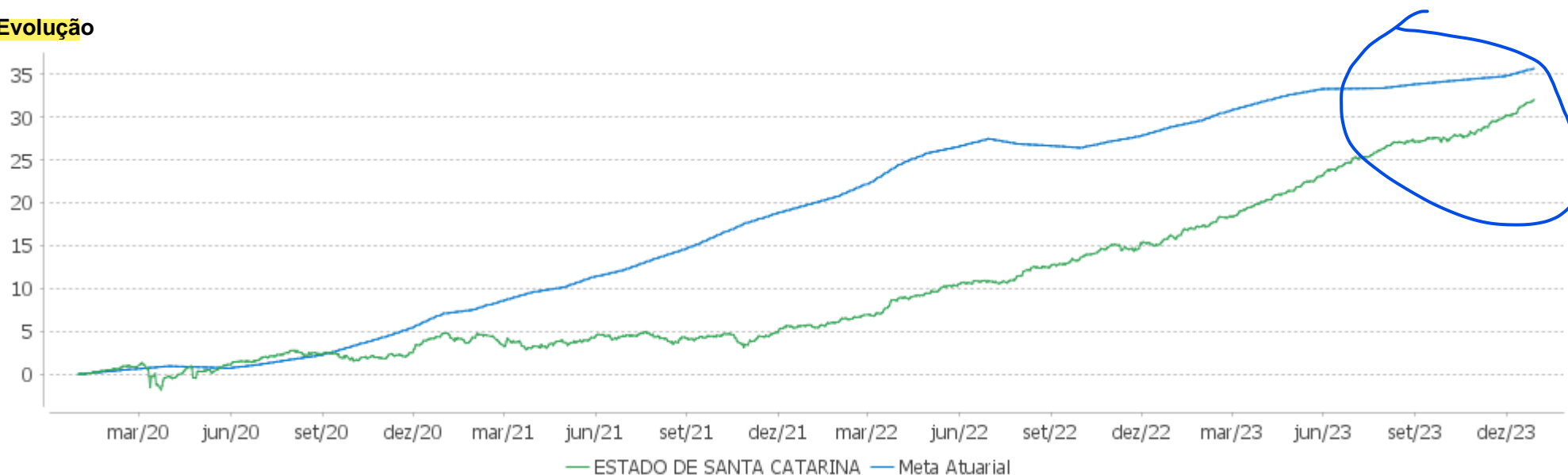
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

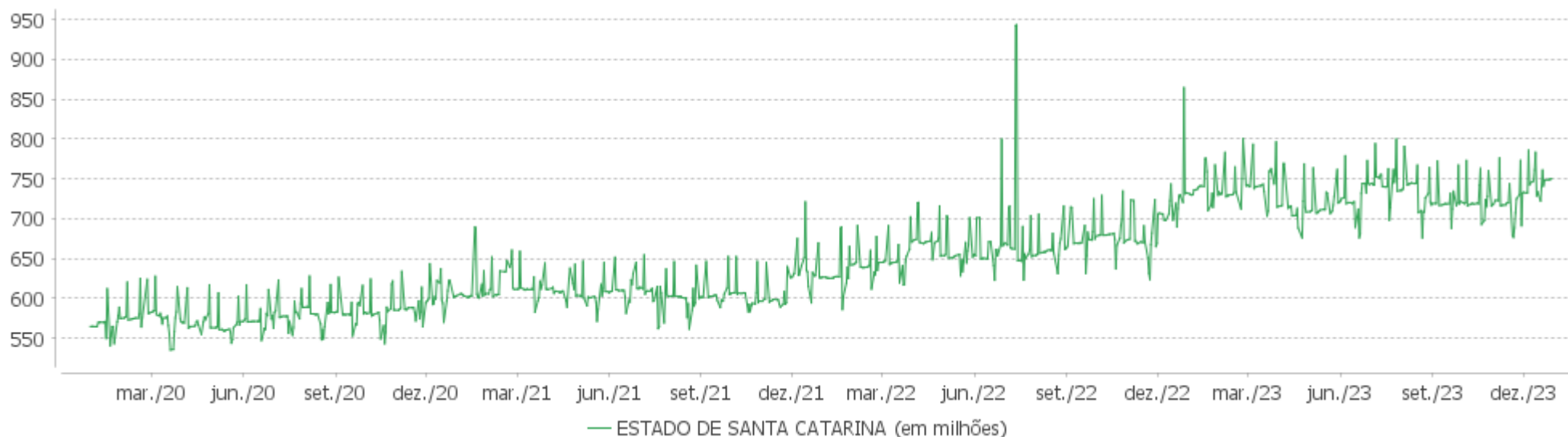
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	45,83	03 meses	3,43	1,19	2,24	1,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	54,17	06 meses	5,47	1,85	3,62	1,49
			12 meses	13,62	5,47	8,15	1,44
			24 meses	24,85	13,45	11,40	1,55
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12	36 meses	26,02	28,46	-2,43	1,84
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03	48 meses	32,00	38,49	-6,49	2,34
			Desde 31/12/2019	32,00	38,49	-6,49	2,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

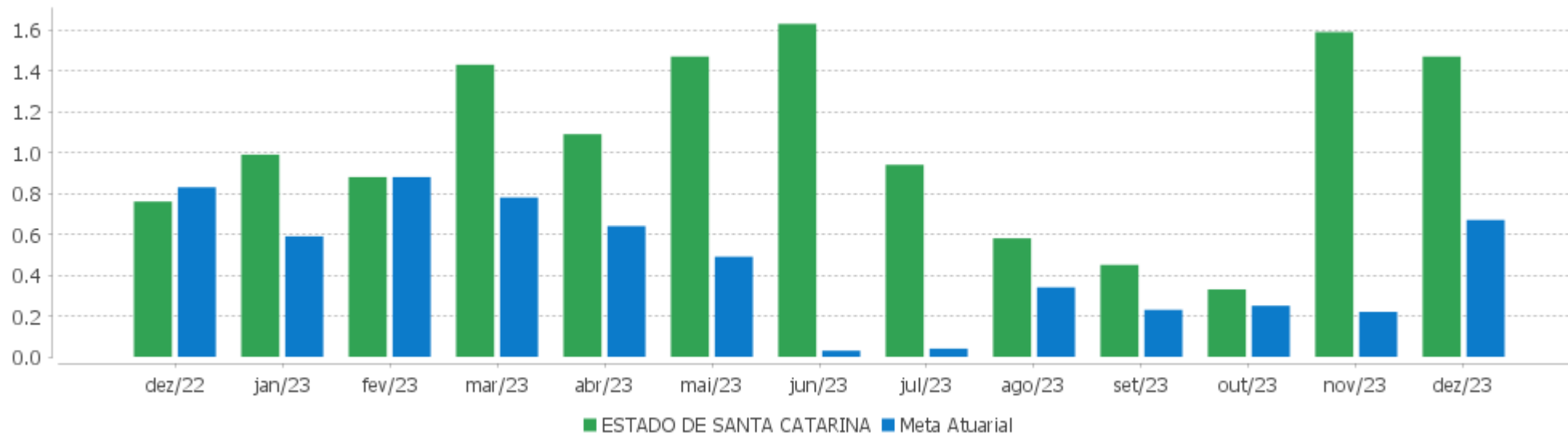


Patrimônio Líquido



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 IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	1,69 -0,04	18,06 -0,46	4,98 -0,07	6,19 -0,18	18,06 -0,46	26,40 -0,91	19,74 -1,21
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,93 -0,19	2,92 -0,05	4,62 -0,13	11,93 -0,19	22,58 -0,51	27,81 -0,90
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI % do CDI	0,88 98,02	12,75 97,69	2,75 96,96	5,99 97,45	12,75 97,69	26,46 97,87	31,73 97,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,95 0,39	14,99 10,37	2,92 1,84	5,73 4,03	14,99 10,37	25,68 15,01	26,35 4,54
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,74 -0,01	15,77 -0,28	4,71 -0,04	4,04 -0,17	15,77 -0,28	22,83 -0,62	20,97 -0,92
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,90 99,89	12,98 99,51	2,80 98,82	6,10 99,24	12,98 99,51	26,98 99,81	32,56 99,81
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	3,93 -0,01	18,87 -0,41	6,38 -0,04	3,67 -0,14	18,87 -0,41	22,37 -0,84	14,08 -1,06
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,82 91,56	11,93 91,44	2,58 90,82	5,62 91,31	11,93 91,44	24,53 90,75	28,60 87,69
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,98 0,60	20,49 -1,79	12,86 -2,26	13,07 -0,56	20,49 -1,79	24,89 -3,12	8,42 -4,32
ESTADO DE SANTA CATARINA Var. INPC + 1,55% p.p.	1,47 0,79	13,62 8,15	3,43 2,24	5,47 3,62	13,62 8,15	24,85 11,21	26,02 -1,31
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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 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 RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO 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	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	8,75	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3381	01/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	94,44	0,00	35,00349800	2,6980160390
3403	01/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	6.143,29	0,00	2.276,96570700	2,6980160390
3434	01/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	6.262,74	0,00	2.321,23898000	2,6980160390
3460	04/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	842.000,40	311.952,27451681	2,6991321070
3469	04/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	534.109,47	0,00	197.881,92975600	2,6991321070
3382	04/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	325,40	0,00	120,55727067	2,6991321070
3391	04/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.954,47	4.799,49461000	2,6991321070
3404	04/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.181,20	6.735,94299200	2,6991321070
3444	04/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.153,15	0,00	1.168,20884400	2,6991321070
3461	05/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	92.757,11	0,00	34.351,00077200	2,7002738760
3392	05/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.358,95	873,59657100	2,7002738760
3405	05/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	150,16	0,00	55,60917400	2,7002738760
3383	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.005,45	0,00	1.852,92648000	2,7013753940
3389	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	0,01	0,00486000	2,7013753940
3390	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	0,00	0,00370100	2,7013753940
3406	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	52.619.614,60	0,00	19.478.823,53443840	2,7013753940
3424	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.142,47	422,92159900	2,7013753940
3435	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	800,06	296,16764900	2,7013753940
3445	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	19.693,02	0,00	7.289,99754856	2,7013753940
3384	07/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.546.822,60	0,00	6.492.759,08286600	2,7025217440
3393	07/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	90.735,77	33.574,48287000	2,7025217440
3407	07/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	60.174.765,10	22.266.153,91110060	2,7025217440
3425	07/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	304.913,79	112.825,65651024	2,7025217440
3446	07/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	81.096,28	30.007,63275300	2,7025217440
3462	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.621.332,09	1.339.402,60382227	2,7036919890
3385	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.263,76	0,00	467,42010700	2,7036919890
3394	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	52,37	0,00	19,36980900	2,7036919890
3408	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.400,63	0,00	1.627,63732600	2,7036919890

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3447	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.567.885,50	0,00	2.059.363,83384300	2,7036919890
3463	11/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.959.270,49	3.682.028,51263500	2,7048325280
3409	11/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	61.287,85	0,00	22.658,64868363	2,7048325280
3426	11/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	7.505.743,01	0,00	2.774.938,16430400	2,7048325280
3448	11/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.472.995,24	0,00	1.653.705,06073700	2,7048325280
3410	12/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.258.330,84	0,00	834.585,35040100	2,7059315610
3427	12/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.334.618,44	0,00	6.406.155,53247500	2,7059315610
3449	12/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.580.885,83	2.432.022,27464000	2,7059315610
3459	13/12/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	9.000.000,00	2.680.231,18247100	3,3579192940
3464	13/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.110.722,41	0,00	1.518.523,75344600	2,7070517670
3395	13/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	780.937,48	288.482,65464300	2,7070517670
3411	13/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	40.081.715,33	0,00	14.806.408,88312900	2,7070517670
3428	13/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.282.146,19	7.861.743,33621452	2,7070517670
3436	13/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.531.088,99	0,00	565.592,80050148	2,7070517670
3450	13/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.158.916,03	0,00	1.905.732,31472300	2,7070517670
3465	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	31.880,98	0,00	11.772,07606600	2,7081867140
3386	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.597.185,71	6.497.774,18190229	2,7081867140
3396	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	350.852,89	129.552,69597412	2,7081867140
3412	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	24.687.365,67	9.115.828,51447300	2,7081867140
3429	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.673.378,23	3.202.651,49561600	2,7081867140
3437	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.323.618,55	1.227.248,67263300	2,7081867140
3451	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	499.378,99	184.396,07114918	2,7081867140
3397	15/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	24.408,62	0,00	9.009,25909359	2,7092816120
3413	15/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	376.572,99	0,00	138.993,66840718	2,7092816120
3438	15/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	307.256,33	0,00	113.408,78284454	2,7092816120
3452	15/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.412.679,10	0,00	1.259.625,09208500	2,7092816120
3466	18/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	22.892.635,07	0,00	8.446.398,61099700	2,7103427300
3414	18/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	35.417,01	0,00	13.067,35476900	2,7103427300
3430	18/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.483.916,05	0,00	2.023.329,37059900	2,7103427300
3439	18/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	30.023.609,69	11.077.421,81742400	2,7103427300

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3453	18/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.427.172,19	3.847.178,46735200	2,7103427300
3398	19/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.304.681,01	2.694.060,45169600	2,7114020420
3415	19/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	27.546.483,48	0,00	10.159.497,94729800	2,7114020420
3440	19/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.044.570,85	1.122.876,94810300	2,7114020420
3454	19/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	207.975,51	0,00	76.704,04712300	2,7114020420
3467	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	88.755,49	0,00	32.721,47205900	2,7124540680
3399	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.004.837,53	370.453,28872275	2,7124540680
3416	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.059.562,81	0,00	6.289.346,24599100	2,7124540680
3431	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.266.763,21	0,00	1.573.026,89853300	2,7124540680
3441	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	309.087,13	0,00	113.951,10193623	2,7124540680
3455	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	636.345,75	234.601,48413470	2,7124540680
3468	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	392.062,48	144.483,56165100	2,7135438490
3470	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	471.724,25	0,00	173.840,65865500	2,7135438490
3400	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	10.057.395,84	0,00	3.706.369,38249800	2,7135438490
3417	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	56.063.488,66	20.660.616,44099100	2,7135438490
3432	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.233.120,84	822.953,65922425	2,7135438490
3442	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	28.934.696,12	0,00	10.663.065,61829200	2,7135438490
3456	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.046.182,29	385.540,95611400	2,7135438490
3387	22/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	175,52	0,00	64,65817200	2,7145833940
3401	22/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.116,37	4.463,43627800	2,7145833940
3418	22/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	42.088,20	15.504,47854800	2,7145833940
3443	22/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	6.667.025,92	0,00	2.456.003,35386100	2,7145833940
3419	26/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	80.656,69	0,00	29.699,81303300	2,7157305640
3388	27/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.297,41	0,00	845,62769000	2,7168102770
3420	27/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	68.124,96	25.075,34684212	2,7168102770
3457	27/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.695,27	1.728,22888700	2,7168102770
3458	28/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	987,02	363,15773500	2,7178823530
3402	28/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.467,57	539,96818500	2,7178823530
3422	28/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	107.608,86	39.592,90580800	2,7178823530
3433	28/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.020,30	1.479,20309927	2,7178823530

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3423	29/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	16.274,50	0,00	5.985,55010800	2,7189647910
Total			287.196.791,87	280.302.480,46		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.929.721,74

Value-At-Risk: 0,79%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ESTADO DE SANTA CATARINA		0,79		0,79			750.122.988,83	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,74%

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		0,20	0,03	0,21			127.609.938,30	17,01
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI		0,02	-0,00	0,01			8.161.358,64	1,09
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,21	0,49	0,02			167.418.267,17	22,32
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,02	-0,00	0,01			181.833.898,43	24,24
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,34	0,04	0,04			8.837.913,85	1,18
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,26	0,14	0,02			88.441.220,65	11,79
BB PREV IRF-M 1+		1,95	0,03	0,03			12.535.226,56	1,67
Sub-total	1,11	0,92	0,73		0,60	1,56	594.837.823,60	79,30

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			144.911.495,81	19,32
Sub-total	0,02	0,01	-0,00		-3,05	0,82	144.911.495,81	19,32

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,41%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		6,41	0,06	1,28			10.373.669,42	1,38
Sub-total	12,31	6,41	0,06		0,41	5,98	10.373.669,42	1,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
- (2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
- (4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
- (5) Limite Política de Investimentos (%)