



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA - FUTURO
DEZEMBRO 2024



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 31.12.2024.

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 **100,00%**

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 RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	0,03	0,04	0,87	8,39	9.835.827,80	92,26	12.294.505.798,37	0,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,03	0,04	0,87	8,39	9.835.827,80	92,26		

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	0,36	1,50	825.107,35	7,74	4.174.516.271,82	0,02
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,04	0,04	0,36	1,50	825.107,35	7,74		
Renda Fixa			0,03	0,04	0,87	9,05	10.660.935,15	100,00		
Total			0,03	0,04	0,87	9,05	10.660.935,15	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	9.835.827,80	92,26	0,00	85,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	825.107,35	7,74	0,00	13,00	60,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	10.660.935,15	100,00					100,00
Total		10.660.935,15	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,87 94,06	8,39 97,34	2,59 96,96	5,23 97,43		77.403,62	0,85	267.475,45
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,36 39,03	1,50 15,99	0,52 19,40	0,59 11,00		1.791,12	0,02	2.271,92
ESTADO DE SANTA CATARINA - FUTURO (Total)						79.194,74	0,87	269.747,37

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 RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	8.275.454,82	1.482.969,36	0,00	0,00	9.835.827,80	77.403,62	267.475,45
	8.275.454,82	1.482.969,36	0,00	0,00	9.835.827,80	77.403,62	267.475,45

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	11.502,79	842.212,58	-30.399,14	0,00	825.107,35	1.791,12	2.271,92
	11.502,79	842.212,58	-30.399,14	0,00	825.107,35	1.791,12	2.271,92

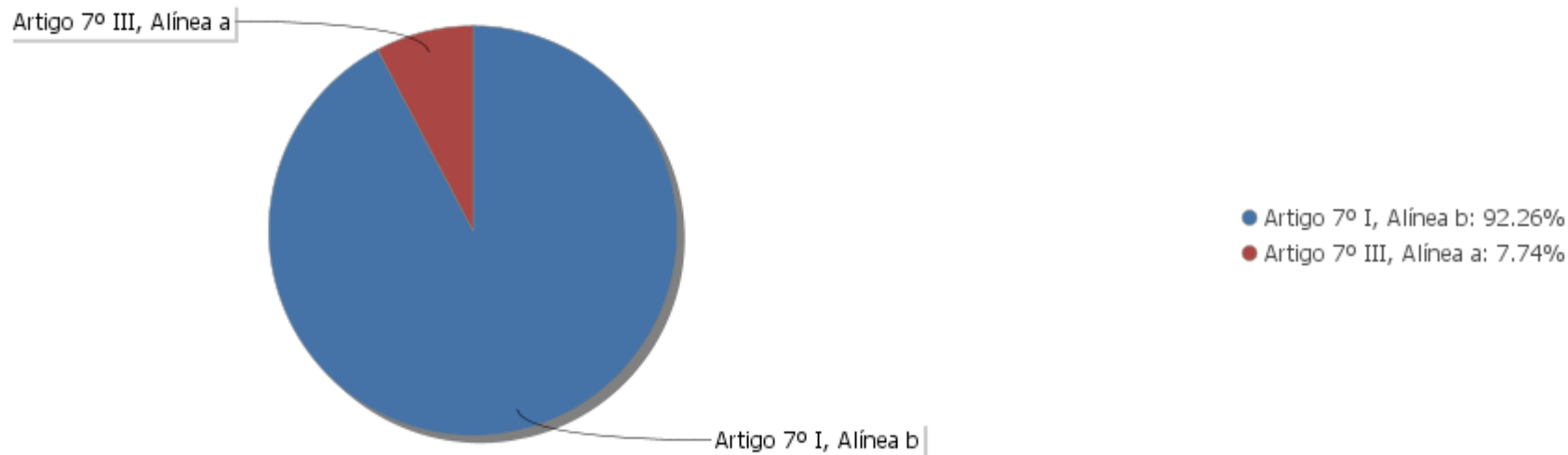
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

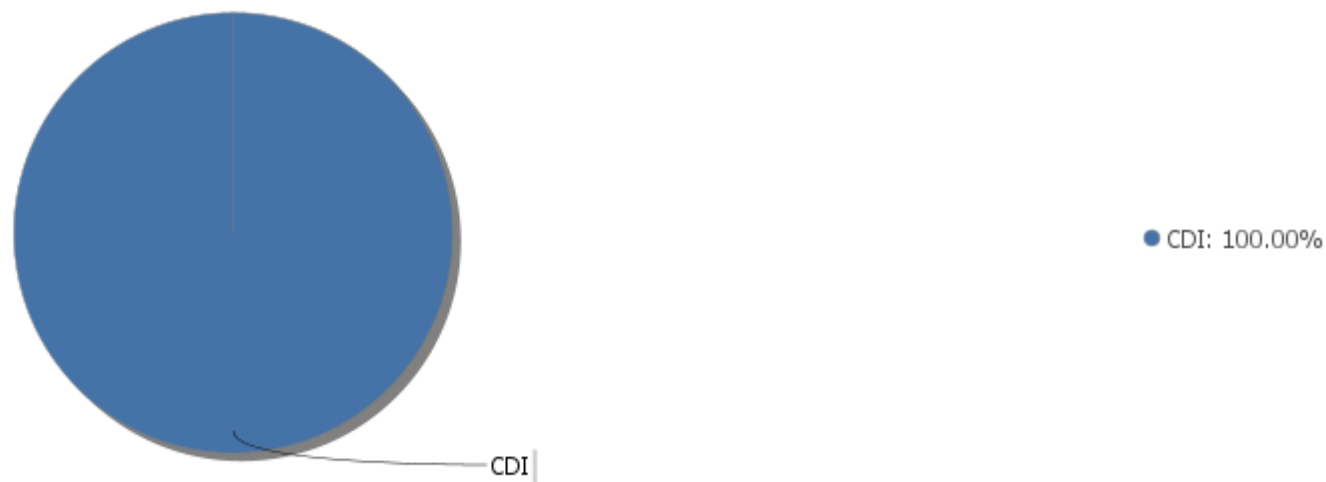
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	10.660.935,15	100,00	80,00	10.660.935,15	100,00	80,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	0,00	10.660.935,15	100,00	80,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	10.660.935,15	100,00	80,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

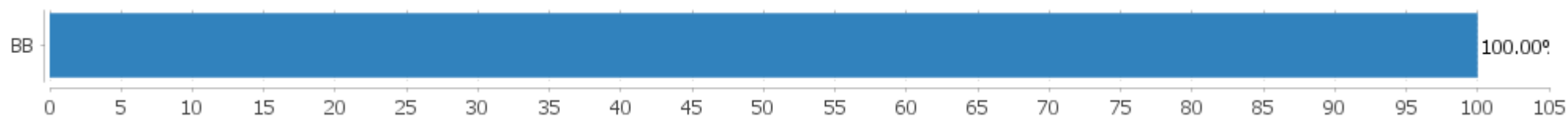


Alocação Por Estratégia



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
2024			0,79	0,86	0,81	0,77	0,89	0,85	0,82	0,91	0,78	0,87	9,05
INPC + 4,50%			0,54	0,76	0,83	0,60	0,66	0,24	0,85	1,02	0,66	0,85	7,82
p.p. indexador			0,25	0,11	-0,02	0,17	0,22	0,61	-0,03	-0,10	0,12	0,02	1,23

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	7	70,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	30,00

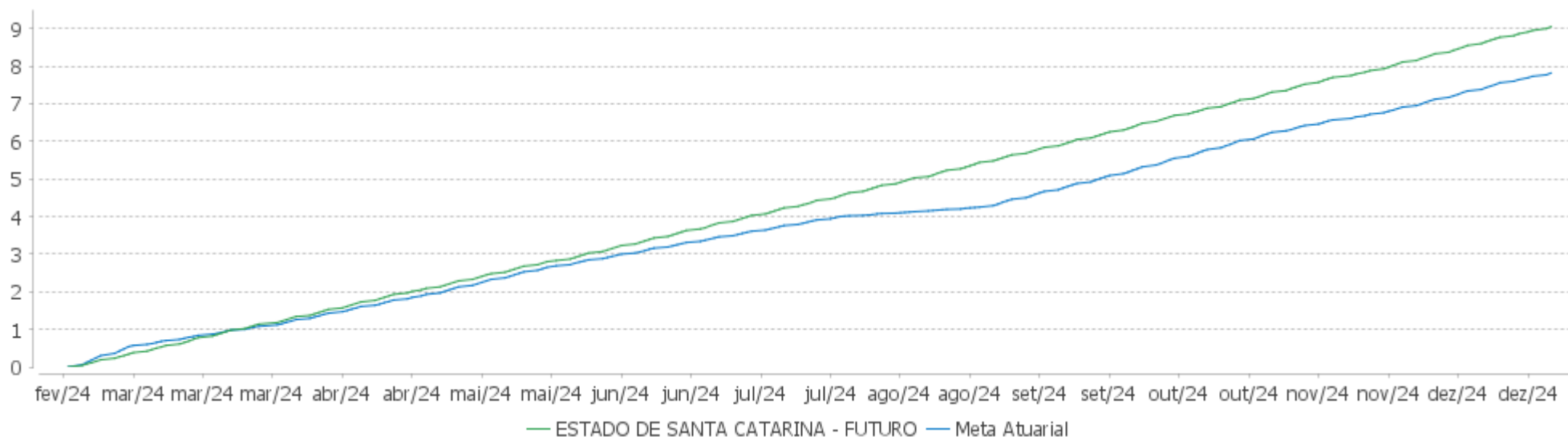
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,91	2024-10
Menor rentabilidade da Carteira	0,77	2024-06

Relatório

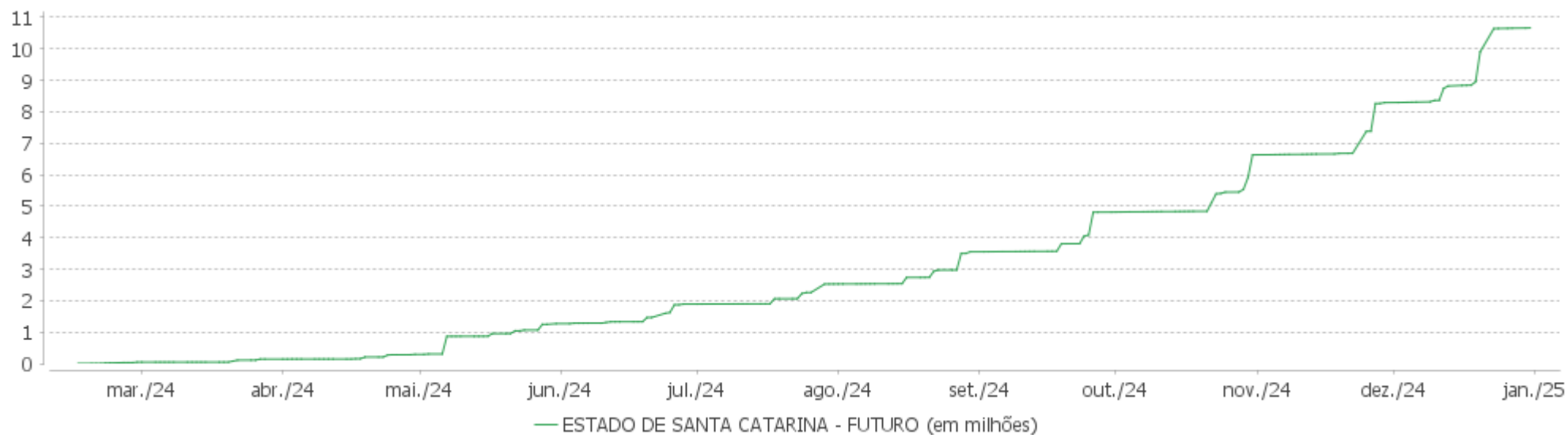
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,59	2,55	0,04	0,04
06 meses	5,23	4,36	0,87	0,03
12 meses				
24 meses				
Desde 16/02/2024	9,05	7,82	1,23	0,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

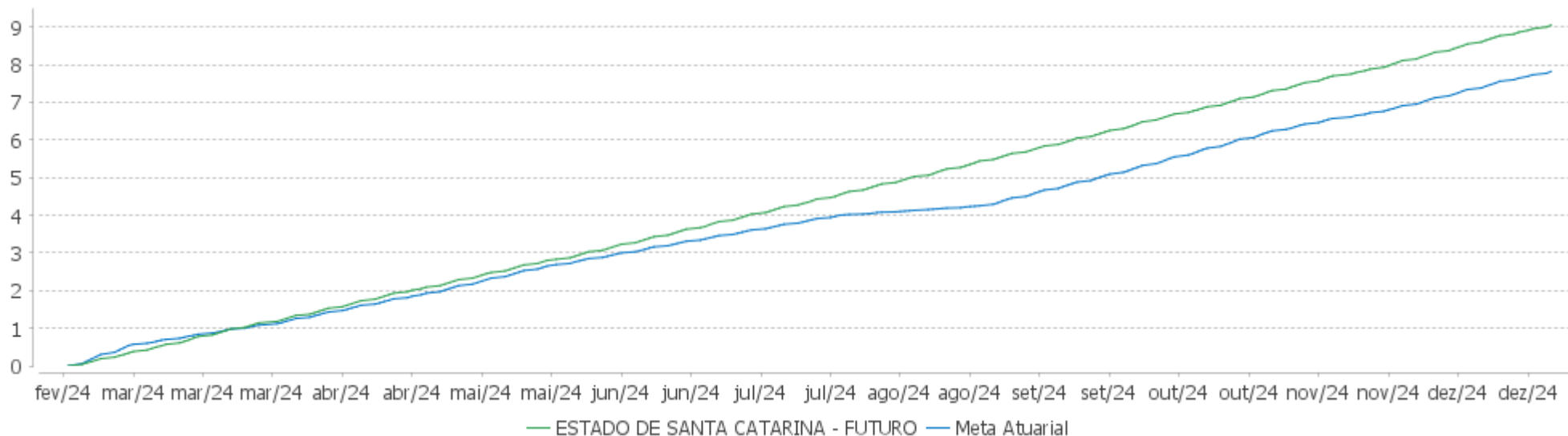


Patrimônio Líquido No Ano

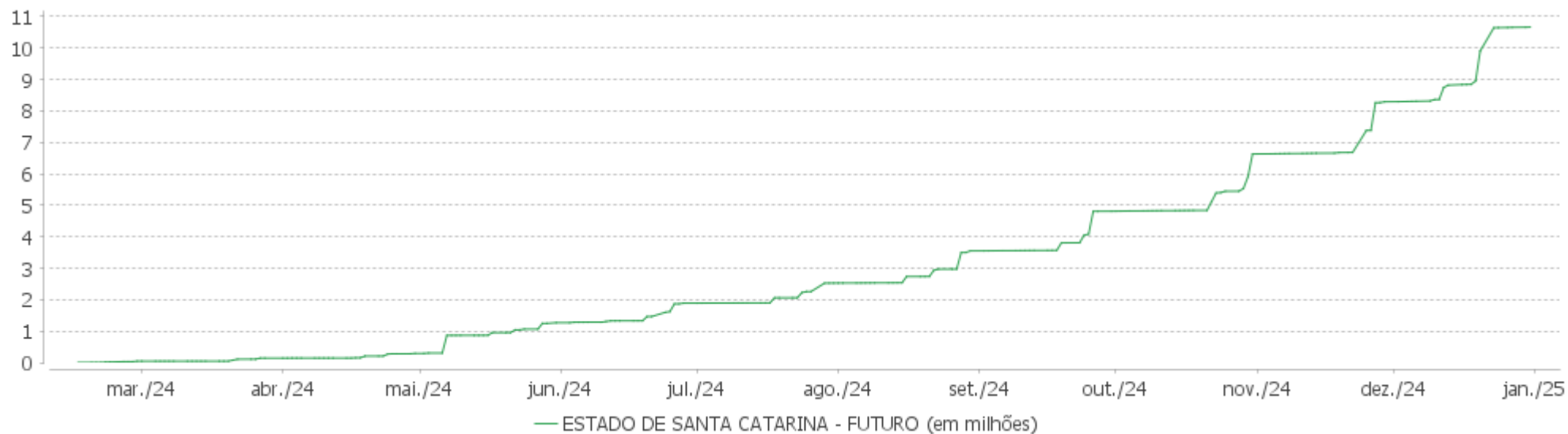


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

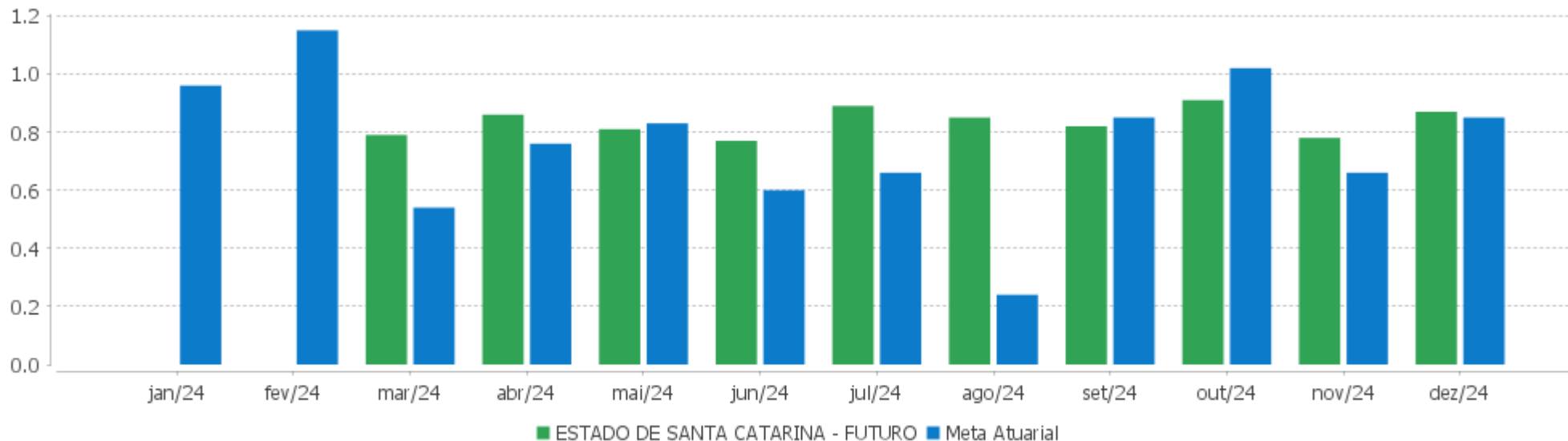


Patrimônio Líquido



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 RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI % do CDI	0,87 94,06	10,59 97,40	2,59 96,96	5,23 97,43	10,59 97,40	24,69 97,42	39,85 97,56
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,82 88,08	9,77 89,86	2,40 90,04	4,84 90,03	9,77 89,86	22,87 90,24	36,70 89,85
ESTADO DE SANTA CATARINA - FUTURO Var. INPC + 4,50% p.p.	0,87 0,02	9,05 1,23	2,59 0,04	5,23 0,87			
CDI	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85
IBOVESPA	-4,28	-10,36	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75
INPC + 6,00%	0,97	11,08	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99
IPCA + 6,00%	1,01	11,15	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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	0,70	9,46	2,13	4,74	9,46	23,96	38,86	42,92	48,41
IRF-M 1+	-2,96	-1,81	-4,20	-2,02	-1,81	16,38	25,01	18,77	28,81
IRF-M TOTAL	-1,66	1,86	-1,97	0,34	1,86	18,67	29,15	26,57	35,05
IMA-B 5	-0,28	6,16	0,82	2,75	6,16	19,03	30,68	36,64	47,63
IMA-B 5+	-4,37	-8,63	-6,17	-3,78	-8,63	8,98	12,58	5,20	10,99
IMA-B TOTAL	-2,62	-2,44	-3,23	-1,36	-2,44	13,22	20,43	18,91	26,53
IMA-GERAL TOTAL	-0,59	5,10	0,10	2,61	5,10	20,65	32,31	33,58	40,70
IDKA 2	-0,24	5,84	0,79	2,55	5,84	18,67	29,76	36,21	47,96
IDKA 20	-8,35	-20,91	-12,95	-10,03	-20,91	0,55	-1,38	-15,68	-13,82
CDI	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,28	-10,36	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75	1,06	4,01
IBRX 100	-4,38	-9,71	-8,59	-2,71	-9,71	9,50	13,89	1,17	4,71
IBRX 50	-4,02	-8,13	-7,92	-2,14	-8,13	10,30	16,61	4,32	8,10
SMALL CAP	-7,83	-25,03	-13,16	-11,95	-25,03	-12,20	-25,42	-37,50	-37,91
Índice Consumo - ICON	-7,28	-22,56	-12,77	-9,92	-22,56	-17,15	-38,16	-54,30	-53,93
Índice Dividendos - IDIV	-4,89	-2,62	-6,59	0,81	-2,62	23,51	39,14	30,22	28,91

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	-0,26	57,72	16,01	19,99	57,72	81,80	36,93	86,59	179,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,67	-5,89	-5,74	-6,90	-5,89	8,69	11,11	8,58	-2,54

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,22	48,02	12,27	16,86	48,02	64,93	23,68	55,12	128,67

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,52	4,83	1,48	2,29	4,83	9,68	16,02	27,69	33,46
INPC	0,48	4,77	1,43	2,04	4,77	8,65	15,10	26,79	33,70
IGPM	0,94	6,54	3,80	5,38	6,54	3,15	8,77	28,11	57,76
SELIC	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,85	9,04	2,48	4,36	9,04	18,59	30,45	49,29	62,25
IPCA + 5,00%	0,93	10,09	2,72	4,88	10,09	20,87	34,23	55,09	70,17
IPCA + 5,50%	0,97	10,62	2,84	5,13	10,62	22,02	36,15	58,05	74,24
IPCA + 5,89%	1,00	11,03	2,94	5,33	11,03	22,92	37,66	60,40	77,48
IPCA + 6,00%	1,01	11,15	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09	61,06	78,40
INPC + 4,00%	0,81	8,98	2,43	4,10	8,98	17,48	29,41	48,24	62,54
INPC + 6,00%	0,97	11,08	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99	59,92	78,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4979	02/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	11.507,46	0,00	1.294,54567805	8,8891880720
4982	02/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.507,46	3.885,47110644	2,9616640260
4975	09/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.251,62	0,00	1.769,82116000	2,9673167640
4968	10/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	42.194,03	0,00	4.734,99252324	8,9111080520
4973	10/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	5.253,63	0,00	589,55967800	8,9111080520
4976	10/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.253,63	1.769,82116000	2,9684546180
4969	12/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	377.765,32	0,00	42.358,61355944	8,9182645100
4966	13/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	42.451,42	0,00	4.757,95375040	8,9222010610
4970	13/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	26.353,25	0,00	2.953,67138891	8,9222010610
4977	16/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	13.632,40	0,00	4.585,21421600	2,9731217250
4974	17/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	13.638,05	0,00	1.527,22379300	8,9299617100
4978	17/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.638,05	4.585,21421600	2,9743532210
4971	19/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	102.594,24	0,00	11.479,85677869	8,9368919820
4967	20/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	87.570,72	0,00	29.411,15774482	2,9774659250
4972	20/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	848.267,78	0,00	94.887,04653479	8,9397637610
4980	20/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	12.944,18	0,00	1.447,93311614	8,9397637610
4981	23/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	735.757,84	0,00	247.038,50906383	2,9783123400
Total			2.325.181,94	30.399,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 2.154,16 Value-At-Risk: 0,02%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,07	0,02	5,00	0,02	-1,38	0,83	10.660.935,15	100,00
ESTADO DE SANTA CATARINA - FUTURO		0,02		0,02			10.660.935,15	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,02%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	0,05	0,02	0,02	0,02	-1,17	0,87	9.835.827,80	92,26
Sub-total	0,05	0,02	0,02		-1,17	0,87	9.835.827,80	92,26

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	0,02	0,00	0,03	-1,46	0,82	825.107,35	7,74
Sub-total	0,33	0,02	0,00		-1,73	0,36	825.107,35	7,74

(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 (%)