



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA - SEGURO
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

99,17%

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 IRF-M 1+	4,72	0,00	-0,59	0,18	0,00	0,00	135.611.569,63	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,82	0,05	0,17	8,12	113.205.693,66	15,22	5.307.578.902,09	2,13
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,62	0,05	-2,62	-2,69	54.902.589,59	7,38	3.482.330.917,61	1,58
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,10	0,05	-0,28	5,87	44.485.014,32	5,98	4.184.992.651,29	1,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,95	0,05	-4,30	-8,80	3.352.901,02	0,45	899.358.555,93	0,37
BB	BB	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	0,03	0,04	0,87	10,59	13.732.781,38	1,85	12.294.505.798,37	0,11
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,03	0,05	0,89	10,82	360.684.249,60	48,48	29.925.966.987,52	1,21
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,15	0,05	0,23	6,87	590.363.229,57	79,35		

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	9,77	147.422.009,40	19,82	4.174.516.271,82	3,53
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,04	0,04	0,82	9,77	147.422.009,40	19,82		
Renda Fixa			0,94	0,05	0,35	7,41	737.785.238,97	99,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

0,83%

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	11,67	-0,01	-1,11	-8,22	6.188.298,72	0,83	264.850.773,08	2,34
Sub-total Artigo 8º I			11,67	-0,01	-1,11	-8,22	6.188.298,72	0,83		
Renda Variável			11,67	-0,01	-1,11	-8,22	6.188.298,72	0,83		
Total			1,00	0,05	0,34	7,21	743.973.537,69	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	590.363.229,57	79,35	0,00	85,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	147.422.009,40	19,82	0,00	13,00	60,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	737.785.238,97	99,17					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	6.188.298,72	0,83	0,00	2,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	6.188.298,72	0,83					40,00
Total		743.973.537,69	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	0,23 24,87	6,87 63,17	1,39 52,21	3,90 72,58	6,87 63,17	1.493.523,10	0,18	40.842.059,82
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 88,08	9,77 89,86	2,40 90,04	4,84 90,03	9,77 89,86	1.334.203,53	0,16	12.955.441,44
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,11 3,17	-8,22 2,14	-3,40 5,35	1,25 4,18	-8,22 2,14	-40.935,25	-0,01	-786.946,12
ESTADO DE SANTA CATARINA - SEGURO (Total)						2.786.791,38	0,34	53.010.555,14

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+	12.631.544,33	0,00	-12.557.469,39	0,00	0,00	-74.074,94	22.242,83
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	137.743.979,04	0,00	-24.727.413,55	0,00	113.205.693,66	189.128,17	10.323.168,91
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	83.346.888,36	0,00	-27.001.555,95	0,00	54.902.589,59	-1.442.742,82	-1.721.612,07
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	46.970.066,48	0,00	-2.347.693,03	0,00	44.485.014,32	-137.359,13	3.764.928,78
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.210.877,00	0,00	-702.050,47	0,00	3.352.901,02	-155.925,51	-495.823,57
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	10.575.298,10	3.055.156,22	0,00	0,00	13.732.781,38	102.327,06	970.751,55
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	332.952.026,67	108.842.084,07	-84.122.031,41	0,00	360.684.249,60	3.012.170,27	27.978.403,39
	628.430.679,98	111.897.240,29	-151.458.213,80	0,00	590.363.229,57	1.493.523,10	40.842.059,82

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	143.204.959,56	601.139.910,87	-598.257.064,56	0,00	147.422.009,40	1.334.203,53	12.955.441,44
	143.204.959,56	601.139.910,87	-598.257.064,56	0,00	147.422.009,40	1.334.203,53	12.955.441,44

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	9.627.658,55	0,00	-3.398.424,58	0,00	6.188.298,72	-40.935,25	-786.946,12
	9.627.658,55	0,00	-3.398.424,58	0,00	6.188.298,72	-40.935,25	-786.946,12

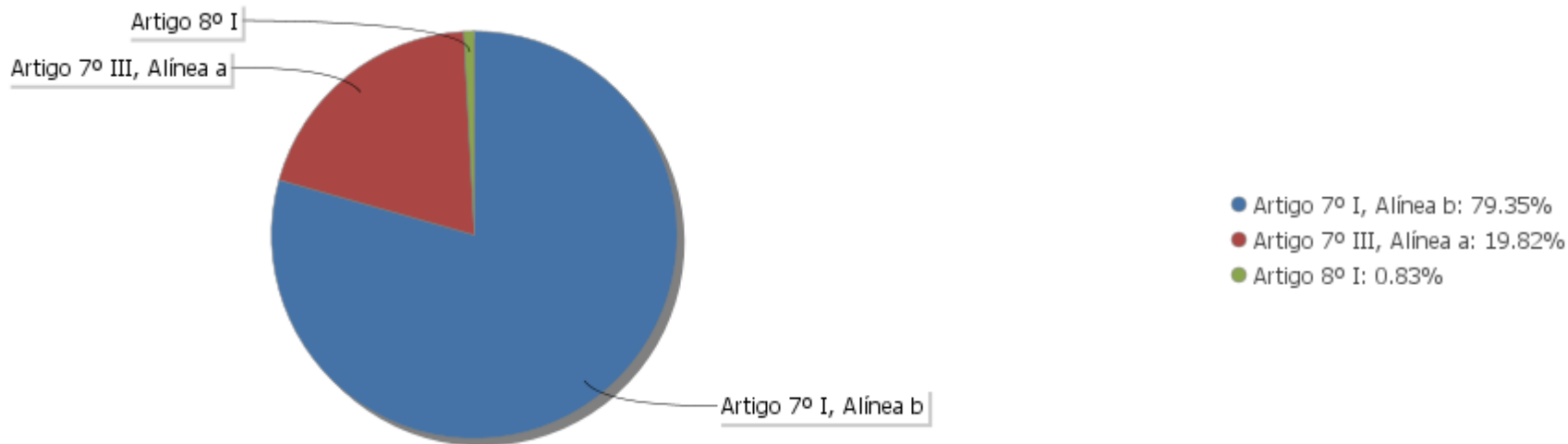
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

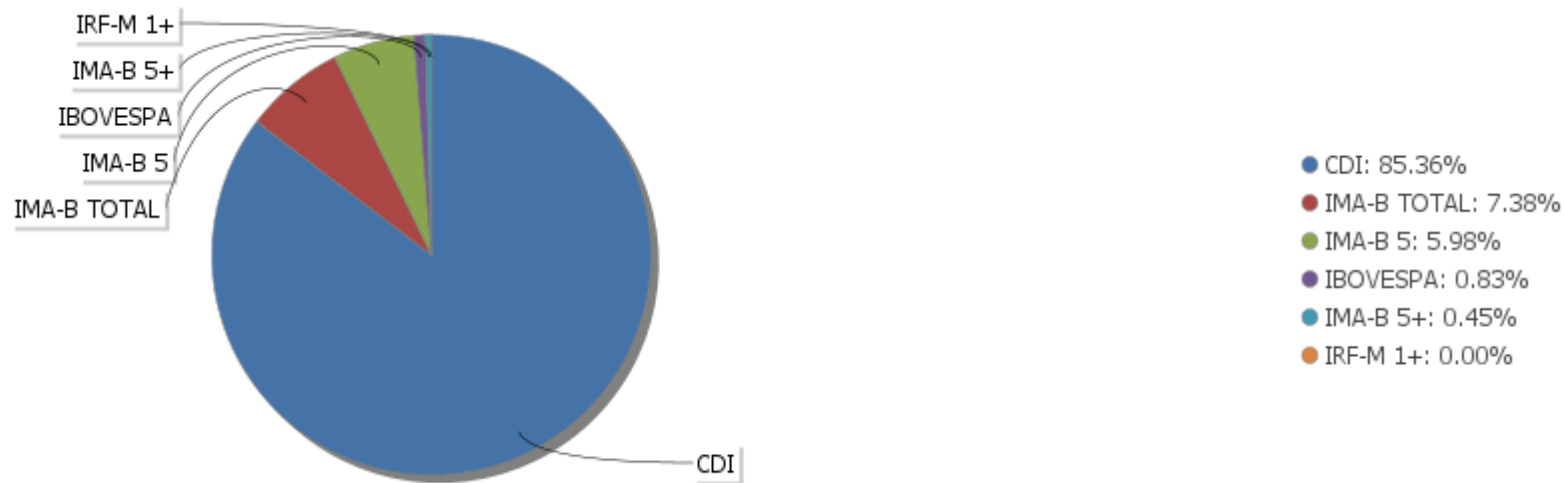
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	743.973.537,69	100,00	80,00	743.973.537,69	100,00	80,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	0,00	743.973.537,69	100,00	80,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	743.973.537,69	100,00	80,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

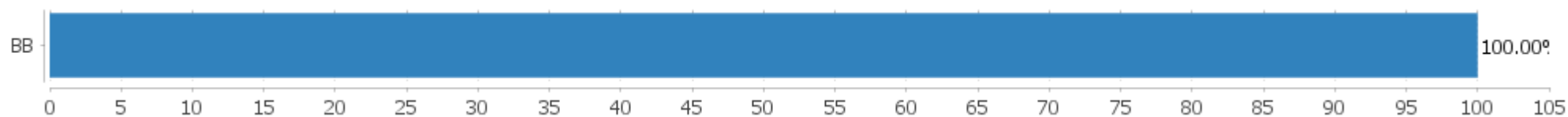


Alocação Por Estratégia



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	0,46	0,68	0,56	-0,08	0,92	0,44	1,07	0,87	0,53	0,63	0,56	0,34	7,21
INPC + 4,50%	0,96	1,15	0,54	0,76	0,83	0,60	0,66	0,24	0,85	1,02	0,66	0,85	9,50
p.p. indexador	-0,49	-0,47	0,02	-0,83	0,09	-0,16	0,41	0,62	-0,32	-0,38	-0,11	-0,51	-2,30
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	26	43,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	56,67

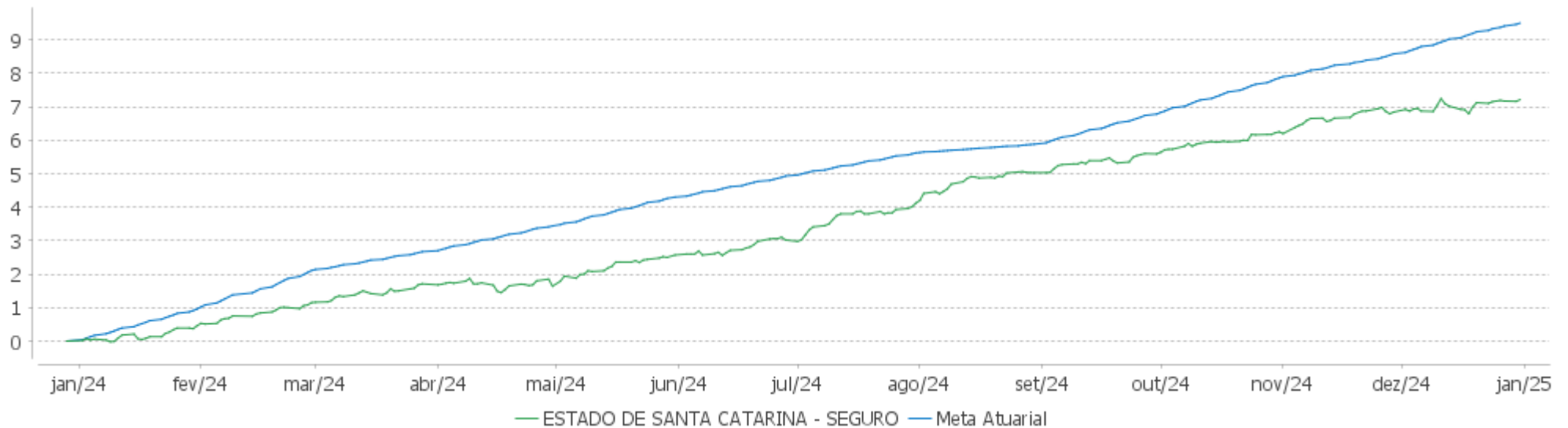
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03

Relatório

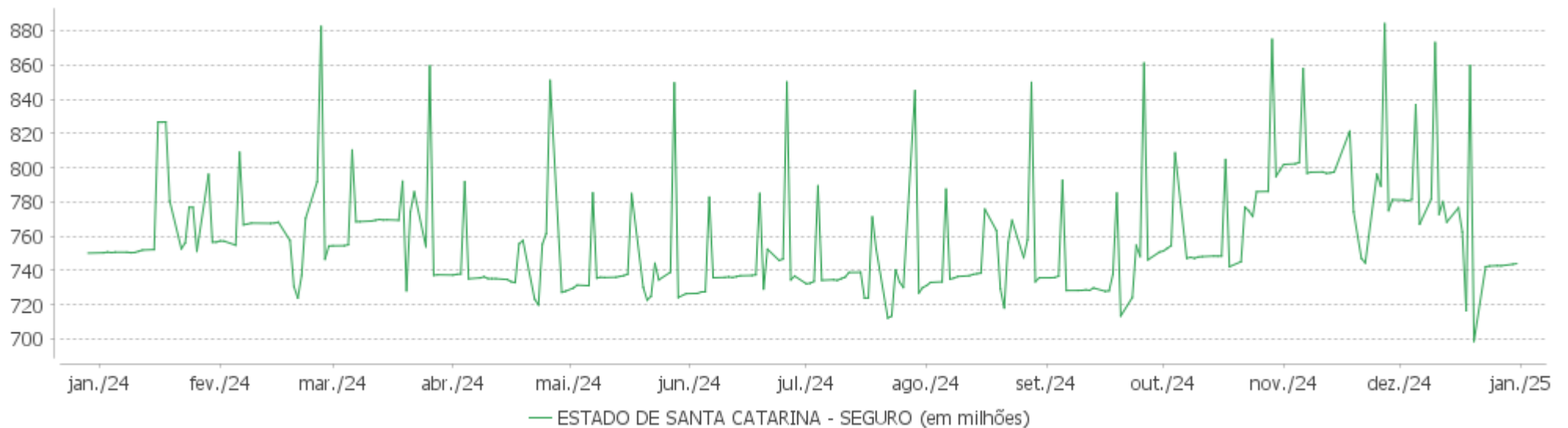
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,54	2,55	-1,01	1,13
06 meses	4,06	4,36	-0,30	1,03
12 meses	7,21	9,50	-2,30	1,00
24 meses	21,80	15,49	6,31	1,25
36 meses	33,85	24,23	9,62	1,39
48 meses	35,11	40,67	-5,56	1,67
60 meses	41,51	51,65	-10,14	2,13
Desde 31/12/2019	41,51	51,65	-10,14	2,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

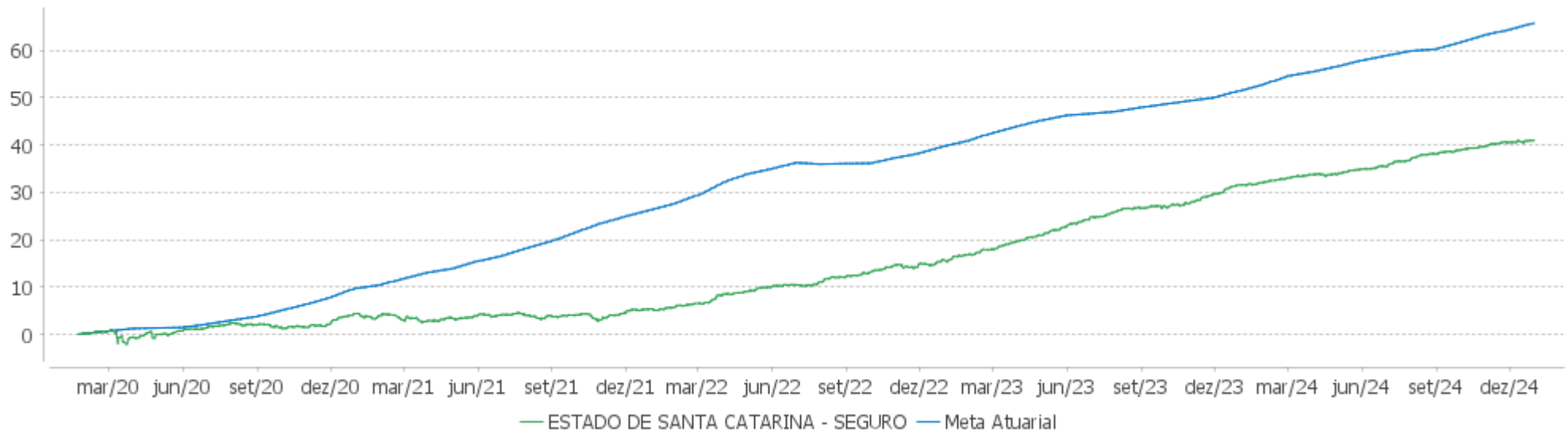


Patrimônio Líquido No Ano

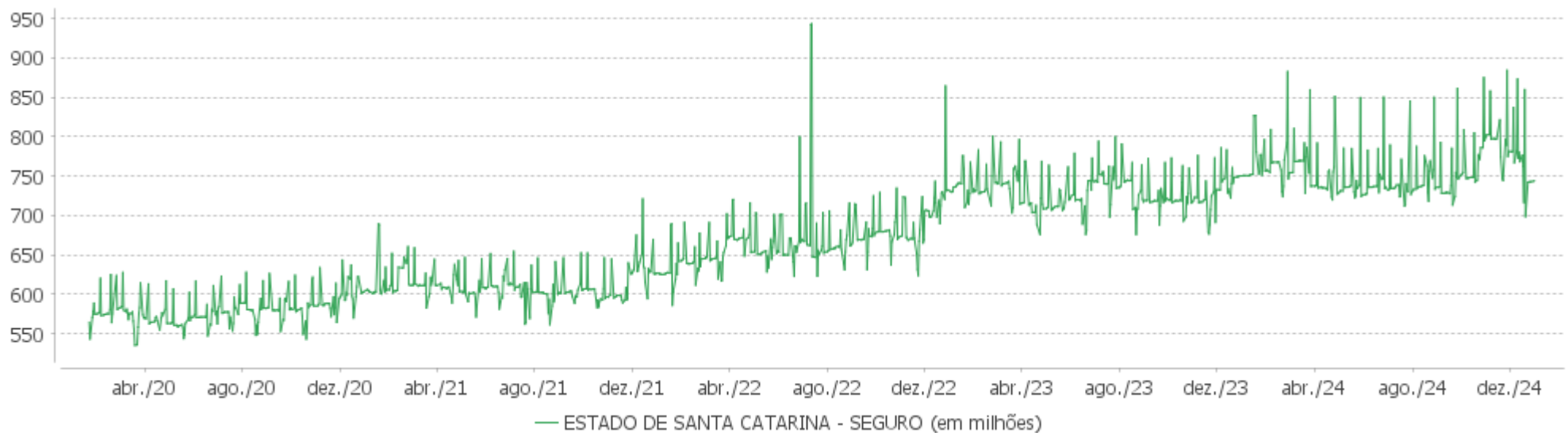


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

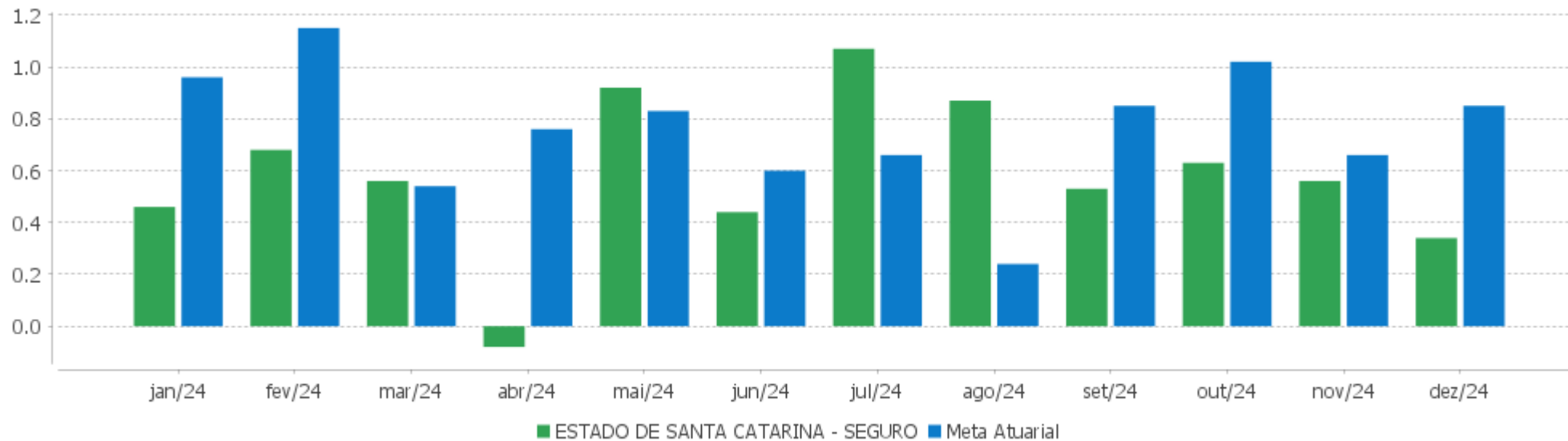


Patrimônio Líquido



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 PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	-2,96 0,00	-2,21 -0,41	-4,24 -0,04	-2,14 -0,13	-2,21 -0,41	15,44 -0,94	23,60 -1,41
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,28 -0,00	5,87 -0,29	0,77 -0,04	2,59 -0,16	5,87 -0,29	18,51 -0,53	29,78 -0,90
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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,62 0,00	-2,69 -0,25	-3,26 -0,03	-1,48 -0,12	-2,69 -0,25	12,66 -0,56	19,53 -0,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI % do CDI	0,17 18,27	8,12 74,71	1,38 51,61	4,13 76,85	8,12 74,71	24,33 96,00	35,89 87,86
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,89 95,66	10,82 99,51	2,64 98,98	5,35 99,51	10,82 99,51	25,21 99,48	40,72 99,69
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-4,30 0,08	-8,80 -0,17	-6,09 0,08	-3,79 -0,01	-8,80 -0,17	8,41 -0,58	11,60 -0,98
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
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,11 3,17	-8,22 2,14	-3,40 5,35	1,25 4,18	-8,22 2,14	10,58 0,97	14,62 -0,13
ESTADO DE SANTA CATARINA - SEGURO Var. INPC + 4,50% p.p.	0,34 -0,51	7,21 -2,30	1,54 -1,01	4,06 -0,30	7,21 -2,30	21,80 3,20	33,85 2,57
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 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	0,70	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
5023	02/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	886.217,37	299.229,54198000	2,9616640260
5058	02/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	92.836,62	0,00	31.346,10110500	2,9616640260
5089	02/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.141,31	4.437,13732707	2,9616640260
5090	02/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.290,08	0,00	1.786,18504700	2,9616640260
4984	03/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	168,10	0,00	56,73865559	2,9627067870
5059	03/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	11.640,12	0,00	3.928,88018800	2,9627067870
5091	03/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	293,04	0,00	98,90955100	2,9627067870
4985	04/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	9.461,64	0,00	3.192,21368096	2,9639745160
5000	04/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.368,84	4.847,82845500	2,9639745160
5024	04/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	282.965,35	0,00	95.468,21285800	2,9639745160
5060	04/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	37.351,22	0,00	12.601,73452800	2,9639745160
4986	05/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.444,88	0,00	13.977,66523231	2,9650788820
5061	05/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	35.187.302,10	0,00	11.867.239,79372300	2,9650788820
5092	05/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	20.036.024,38	0,00	6.757.332,66377200	2,9650788820
4987	06/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.659.126,06	0,00	2.245.001,68913541	2,9662009130
5001	06/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	130.713,20	44.067,54762536	2,9662009130
5012	06/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	281.488,94	94.898,81105700	2,9662009130
5025	06/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	512.406,10	172.748,27802600	2,9662009130
5043	06/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.351.903,89	3.827.085,29292400	2,9662009130
5062	06/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	40.285.108,70	13.581.382,34110900	2,9662009130
5080	06/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	313.307,31	105.625,78840400	2,9662009130
5093	06/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.021.929,08	7.761.419,32230600	2,9662009130
5026	09/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.164.645,46	0,00	4.099.543,94070200	2,9673167640
5039	09/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	2.300.000,00	619.010,65275700	3,7156064920
5040	09/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	5.000.000,00	1.345.675,33208000	3,7156064920
5044	09/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.300.000,00	0,00	2.460.135,05823300	2,9673167640
5063	09/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.592.818,49	0,00	873.792,28313400	2,9673167640
5094	09/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	401,40	0,00	135,27372700	2,9673167640

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5002	10/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	797.187,22	268.552,94171117	2,9684546180
5013	10/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.607.379,06	878.362,44630100	2,9684546180
5027	10/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.877.587,77	2.653.767,29097700	2,9684546180
5045	10/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.136.850,15	2.404.230,84345800	2,9684546180
5064	10/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	102.710.212,36	0,00	34.600.566,81924300	2,9684546180
5081	10/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	991.743,44	334.094,18961200	2,9684546180
5095	10/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.659.351,41	0,00	2.243.373,15774300	2,9684546180
5003	11/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	360.814,59	121.503,79762000	2,9695745900
5014	11/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.578.768,70	531.648,10384500	2,9695745900
5028	11/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	358.762,94	120.812,90741400	2,9695745900
5065	11/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	93.502.061,50	31.486.685,60637200	2,9695745900
5082	11/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	665.464,02	0,00	224.094,05786300	2,9695745900
5096	11/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.661.420,56	2.243.223,85517100	2,9695745900
5015	12/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.213.226,59	0,00	408.413,81013300	2,9705816990
5037	12/12/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	2.347.693,03	84.232,25768800	27,8716621630
5038	12/12/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	27.001.555,95	3.410.362,70157300	7,9175027140
5046	12/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.906.718,37	0,00	14.107.243,16523800	2,9705816990
5053	12/12/2024	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	3.398.424,58	1.579.280,70850600	2,1518812690
5054	12/12/2024	BB PREV IRF-M 1+	0,00	12.557.469,39	8.753.759,34681400	1,4345230310
5066	12/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.885,11	0,00	2.654,39930500	2,9705816990
5083	12/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	10.587.084,89	0,00	3.563.977,01284000	2,9705816990
5097	12/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.790,83	939,48939400	2,9705816990
5004	13/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.576,87	1.203,59278255	2,9718273920
5029	13/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.765,88	930,70008300	2,9718273920
5042	13/12/2024	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	702.050,47	182.271,33832000	3,8516777930
5047	13/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.086.114,23	0,00	4.066.896,43635900	2,9718273920
5067	13/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	765.274,96	257.509,89511000	2,9718273920
5084	13/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.963.902,64	7.390.706,03465200	2,9718273920
5098	13/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.487,56	3.192,50035400	2,9718273920
5005	16/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	485.934,08	163.442,37637966	2,9731217250

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5016	16/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.571.121,70	3.891.909,84099400	2,9731217250
5030	16/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	17.361.999,76	0,00	5.839.653,18809800	2,9731217250
5041	16/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	26.875.758,33	7.217.776,99124300	3,7235506670
5048	16/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	54.899.267,46	0,00	18.465.193,33479300	2,9731217250
5055	16/12/2024	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	24.727.413,55	17.001.142,58603600	1,4544559830
5068	16/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	438.710,40	0,00	147.558,84238100	2,9731217250
5099	16/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.726,39	0,00	1.589,70618600	2,9731217250
4995	17/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	6.188.435,13	1.661.250,04664200	3,7251677690
4996	17/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	8.459.862,63	2.271.001,77887300	3,7251677690
4997	17/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	35.297.975,32	9.475.539,76326700	3,7251677690
4998	17/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	96.863.893,47	32.566.372,00521700	2,9743532210
5006	17/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.562.404,35	2.206.329,86817674	2,9743532210
5017	17/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	52.748.787,06	0,00	17.734.540,29856700	2,9743532210
5031	17/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.398.543,93	3.496.068,94587400	2,9743532210
5049	17/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	96.863.893,47	0,00	26.002.558,67026400	3,7251677690
5069	17/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	142.650,04	0,00	47.960,02001100	2,9743532210
4988	18/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	246,40	0,00	82,80959516	2,9755005990
5007	18/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	99.276,41	33.364,60763400	2,9755005990
5011	18/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	2.726.534,49	0,00	305.195,79783100	8,9337222510
5018	18/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	55.759.501,28	18.739.536,23089100	2,9755005990
5022	18/12/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	328.621,73	0,00	36.784,41312200	8,9337222510
5032	18/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.622.404,04	545.254,14666200	2,9755005990
5050	18/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.021.372,74	343.260,80806100	2,9755005990
5057	18/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	11.978.190,60	0,00	3.214.105,35038000	3,7267573070
5070	18/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	924,57	310,72754600	2,9755005990
5071	18/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.135.947,08	2.398.234,12651900	2,9755005990
5085	18/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.595.742,70	0,00	1.880.605,46917000	2,9755005990
4989	19/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.664.181,50	2.238.812,97214086	2,9766584270
5008	19/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	926.087,86	311.116,60363845	2,9766584270
5019	19/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	278.789,16	0,00	93.658,43170600	2,9766584270

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5033	19/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	497.804,59	167.236,04747000	2,9766584270
5056	19/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	365.436,38	122.767,32079300	2,9766584270
5072	19/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	129.549.448,55	0,00	43.521.771,72056800	2,9766584270
5086	19/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.542.166,72	0,00	1.525.928,09399900	2,9766584270
5100	19/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	15.677.655,37	0,00	5.266.864,08752600	2,9766584270
4990	20/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	8.031,29	0,00	2.697,35748529	2,9774659250
5009	20/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	899.970,62	0,00	302.260,59430050	2,9774659250
5020	20/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.005.961,39	0,00	337.858,23762100	2,9774659250
5034	20/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.559.834,83	523.879,99369000	2,9774659250
5051	20/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.826.285,44	0,00	4.307.785,80278700	2,9774659250
5073	20/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	159.461.263,39	53.556.033,01824500	2,9774659250
5087	20/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.961.531,57	994.648,35017400	2,9774659250
5101	20/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.677.077,70	4.257.673,47782500	2,9774659250
5021	23/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	43.752.536,11	0,00	14.690.378,68271300	2,9783123400
5035	23/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.463,08	1.498,52651100	2,9783123400
5052	23/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	86.195,88	0,00	28.941,18217200	2,9783123400
5074	23/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	113.599,55	38.142,25542200	2,9783123400
5103	23/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	66.428,42	22.304,04753300	2,9783123400
4991	24/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	213,98	0,00	71,81195756	2,9797265980
5075	24/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	14.381,58	0,00	4.826,47636500	2,9797265980
4992	26/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.157,54	0,00	5.420,10830951	2,9810363700
5076	26/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	10.290,78	0,00	3.452,08133100	2,9810363700
4993	27/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.651,25	0,00	889,01019748	2,9822492560
5077	27/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	102,92	0,00	34,51086400	2,9822492560
4994	30/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.306,71	0,00	1.778,73606833	2,9834161990
5010	30/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.563,23	523,97315551	2,9834161990
5036	30/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.305,48	437,57890700	2,9834161990
5078	30/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	950.466,78	0,00	318.583,36772400	2,9834161990
5088	30/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.203,92	1.409,09605600	2,9834161990
5102	30/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	59.653,72	0,00	19.995,10494700	2,9834161990

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
5079	31/12/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.688,95	0,00	1.235,97128700	2,9846567120
Total			713.037.151,16	753.113.702,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 3.147.087,50 Value-At-Risk: 0,42%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,47	0,40	5,00	0,40	-0,39	0,35	737.785.238,97	99,17
Artigo 8º	13,87	6,14	20,00	0,03	-0,15	-1,11	6.188.298,72	0,83
ESTADO DE SANTA CATARINA - SEGURO		0,42		0,42			743.973.537,69	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,40%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV IRF-M 1+	9,77	NaN	0,00	NaN	-0,40	-2,96	0,00	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,62	0,45	0,07	0,46	-0,47	0,17	113.205.693,66	15,22
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	9,59	3,42	0,25	0,04	-0,37	-2,62	54.902.589,59	7,38
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,68	1,21	0,07	0,04	-0,26	-0,28	44.485.014,32	5,98
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	13,73	4,38	0,02	0,16	-0,38	-4,30	3.352.901,02	0,45
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	0,05	0,02	-0,00	0,02	-1,17	0,87	13.732.781,38	1,85
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,05	0,02	-0,00	0,02	-0,81	0,89	360.684.249,60	48,48
Sub-total	1,82	0,50	0,40		-0,38	0,23	590.363.229,57	79,35

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	147.422.009,40	19,82
Sub-total	0,08	0,02	-0,00		-1,46	0,82	147.422.009,40	19,82

Renda Variável Value-At-Risk: 6,14%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	13,87	6,14	0,03	2,04	-0,15	-1,11	6.188.298,72	0,83
Sub-total	13,87	6,14	0,03		-0,15	-1,11	6.188.298,72	0,83

(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 (%)