



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA
FEVEREIRO 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 25.02.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

 RENDA FIXA 91,44%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	3,55	0,57	0,44	44.990,64	0,01	4.398.251.592,64	0,00
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,70	0,74	1,36	26.559.552,06	4,10	5.025.689.167,39	0,53
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,63	0,53	-0,24	51.334.393,09	7,93	6.297.272.158,07	0,82
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	1,16	1,17	40.688.910,54	6,28	9.012.864.987,26	0,45
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,81	-0,02	-1,65	9.058.670,58	1,40	936.801.809,27	0,97
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,64	0,67	0,75	24.711.940,34	3,82	210.569.175,42	11,74
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,77	1,05	1,13	33.517.156,22	5,18	6.375.804.434,87	0,53
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,50	1,38	1,47	50.973.030,49	7,87	1.638.119.424,99	3,11
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,74	0,62	0,65	102.184.130,83	15,78	6.887.287.977,51	1,48
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,16	0,82	0,72	339.072.774,79	52,36		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,80	1,59	87.495.484,70	13,51	7.639.104.845,31	1,15
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,68	1,33	125.670.194,36	19,41	3.177.445.522,66	3,96
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,59	0,67	0,86	39.866.428,77	6,16	4.159.933.633,04	0,96
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,24	0,72	1,33	253.032.107,83	39,08		
Renda Fixa			2,10	0,78	0,94	592.104.882,62	91,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,38%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	18,54	0,56	7,33	8.915.361,29	1,38	470.291.721,53	1,90
Sub-total Artigo 8º I			18,54	0,56	7,33	8.915.361,29	1,38		
Renda Variável			7,02	0,56	7,33	8.915.361,29	1,38		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,18%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	1,26	0,73	1,64	11.948.718,93	1,85	315.747.307,37	3,78
BB	BB	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,31	0,71	1,42	17.939.949,39	2,77	15.963.711.155,73	0,11
BB	BB	BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	2,10	0,94	2,27	15.490.047,15	2,39	2.297.951.935,11	0,67
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	3,82	1,00	1,73	1.136.180,76	0,18	117.589.319,58	0,97
Sub-total Artigo 10º I			0,60	0,80	1,77	46.514.896,23	7,18		
Investimentos Estruturados			0,60	0,80	1,77	46.514.896,23	7,18		
Total			2,08	0,78	1,09	647.535.140,14	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	339.072.774,79	52,36	0,00	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	253.032.107,83	39,08	0,00	0,00	0,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	592.104.882,62	91,44					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	8.915.361,29	1,38	0,00	0,00	0,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	8.915.361,29	1,38					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	46.514.896,23	7,18	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	46.514.896,23	7,18					15,00

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	0,82 109,73	0,72 48,16	1,41 62,27	2,22 58,27	2,65 46,84	2.766.068,27	2.387.485,59
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,72 95,79	1,33 89,43				1.803.811,33	3.331.403,38
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,56 -0,33	7,33 -0,60				49.428,20	609.139,24
Artigo 10º I % do CDI	0,80 106,56	1,77 118,76				368.605,77	807.366,55
ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)						4.987.913,57	7.135.394,76

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 RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	101.558.517,77	0,00	0,00	0,00	102.184.130,83	625.613,06	664.178,39
BB PREV RF IDKA2	40.223.650,42	0,00	0,00	0,00	40.688.910,54	465.260,12	495.174,35
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	24.547.015,62	0,00	0,00	0,00	24.711.940,34	164.924,72	32.445,74
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	33.167.451,44	0,00	0,00	0,00	33.517.156,22	349.704,78	375.162,09
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	51.061.940,64	0,00	0,00	0,00	51.334.393,09	272.452,45	-122.679,92
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	9.060.562,47	0,00	0,00	0,00	9.058.670,58	-1.891,89	-151.835,09
BB PREV RF IPCA	50.277.634,45	0,00	0,00	0,00	50.973.030,49	695.396,04	739.580,21
BB PREV RF IRF-M	44.736,58	0,00	0,00	0,00	44.990,64	254,06	197,05
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	26.365.197,13	0,00	0,00	0,00	26.559.552,06	194.354,93	355.262,77
					339.072.774,79	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	39.601.507,25	0,00	0,00	0,00	39.866.428,77	264.921,52	340.333,57
BB PREV RF FLUXO FIC	124.824.264,50	0,00	0,00	0,00	125.670.194,36	845.929,86	1.623.420,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	86.802.524,75	0,00	0,00	0,00	87.495.484,70	692.959,95	1.367.649,10
					253.032.107,83	0,00	0,00

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	8.865.933,09	0,00	0,00	0,00	8.915.361,29	49.428,20	609.139,24
					8.915.361,29	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	17.812.883,11	0,00	0,00	0,00	17.939.949,39	127.066,28	251.761,39
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	15.345.935,79	0,00	0,00	0,00	15.490.047,15	144.111,36	343.836,88
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.124.971,72	0,00	0,00	0,00	1.136.180,76	11.209,04	19.365,67
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	11.862.499,84	0,00	0,00	0,00	11.948.718,93	86.219,09	192.402,61
					46.514.896,23	0,00	0,00

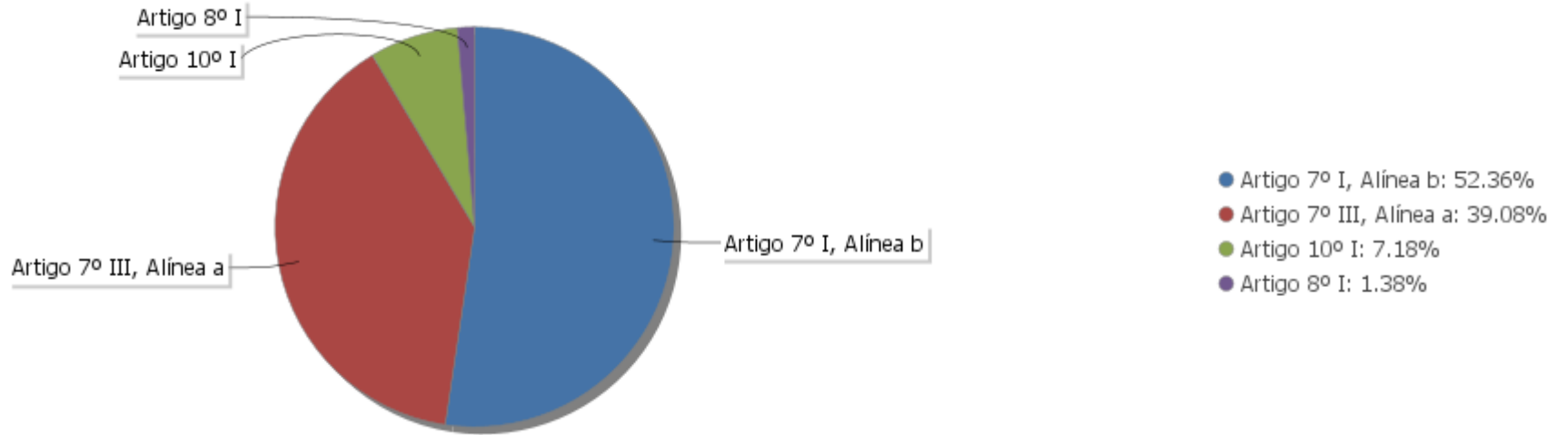
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

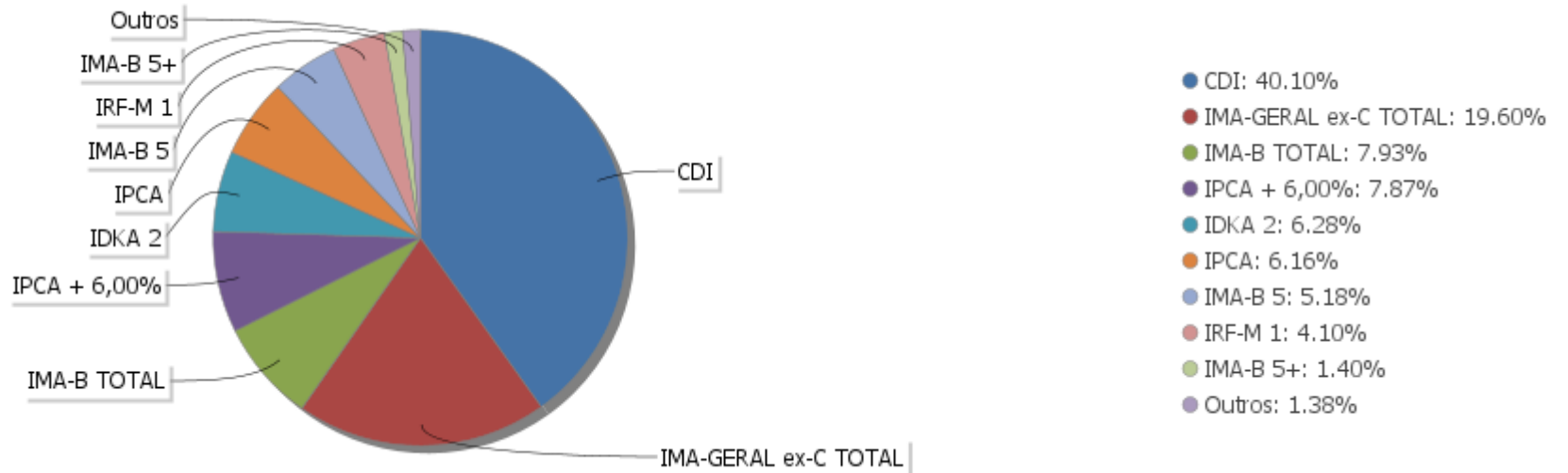
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	596.562.109,65	92,13	596.562.109,65	92,13
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	596.562.109,65	92,13
acima de 365 dias	50.973.030,49	7,87	647.535.140,14	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

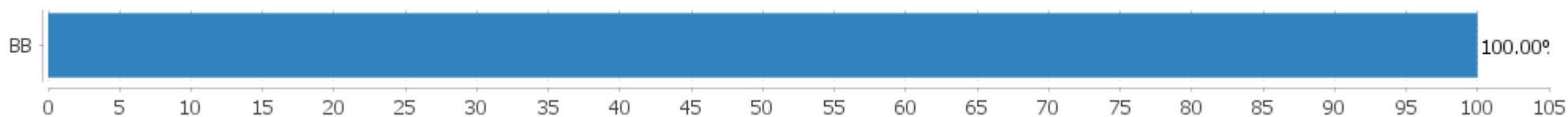


Alocação Por Estratégia



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
2022	0,31	0,78											1,09
IPCA + 3,16%	0,80	1,06											1,87
p.p. indexador	-0,49	-0,28											-0,78
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

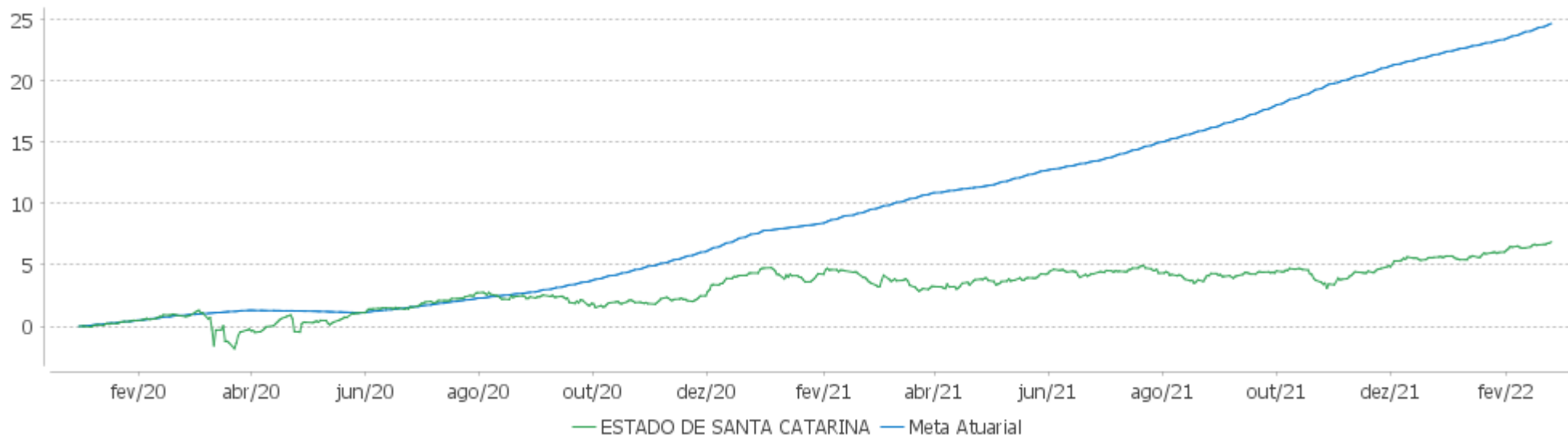
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

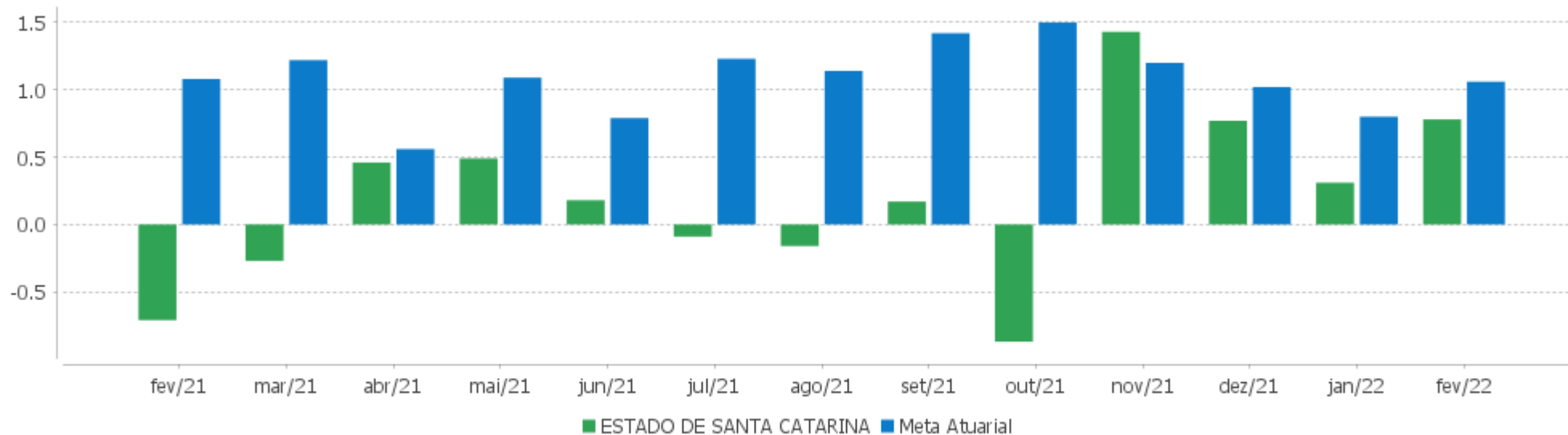
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	6	23,08	03 meses	1,86	2,88	-1,02	1,34
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	76,92	06 meses	2,60	7,11	-4,51	1,85
			12 meses	3,22	13,59	-10,37	2,08
			24 meses	5,96	23,17	-17,21	2,91
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12	Desde 31/12/2019	6,87	24,35	-17,48	2,81
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



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.	1,16 -0,10	1,17 -0,14	1,88 -0,27	4,11 -0,20	6,26 -0,44	13,10 -1,02	24,76 -2,13
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,38 0,12	1,47 -0,84	2,03 -1,57	4,19 -4,45	6,58 -10,41	13,51 -16,84	30,04 -13,64
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62	0,65	1,57	1,65	1,74	4,37	16,33
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,01	1,36 -0,02	2,21 -0,05	2,84 -0,09	4,00 -0,26	6,81 -0,65	13,48 -1,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,01	1,13 -0,04	1,90 -0,07	4,10 -0,17	6,00 -0,32	12,29 -0,65	25,72 -0,96
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,57 -0,02	0,44 -0,06	2,32 -0,07	1,00 -0,16	0,13 -0,35	2,89 -0,62	14,85 -0,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,01	-0,24 -0,04	-0,04 -0,07	0,58 -0,15	0,65 -0,27	3,56 -0,56	21,95 -0,91
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,67	0,75	1,67	2,06	2,29	4,60	15,92
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02 -0,03	-1,65 -0,05	-1,97 -0,04	-2,92 -0,17	-4,52 -0,28	-4,01 -0,68	17,00 -0,99
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 106,50	1,59 106,76	2,40 106,07	4,02 105,65	6,01 106,40	8,16 100,10	13,93 98,13
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,68 90,41	1,33 89,71	2,01 88,96	3,29 86,49	4,51 79,90	5,83 71,53	10,54 74,29
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,67 -0,15	0,86 -0,51	1,63 -0,48	2,38 -3,20	2,83 -7,51		
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,56 -0,33	7,33 -0,60	10,66 -0,36	-5,65 -0,90	-0,38 -3,21	1,38 -7,23	12,23 -6,14
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	1,00 132,93	1,73 116,58	3,10 136,85	2,94 77,29	3,80 67,36		
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	0,73 96,96	1,64 110,03	2,83 124,91	3,63 95,27	5,65 100,03	7,03 86,18	15,41 108,58
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,71 95,17	1,42 95,70	2,17 95,77	3,74 98,22	5,48 97,05	9,75 119,55	15,83 111,55
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	0,94	2,27	3,45	3,11	4,87	8,71	15,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	125,28	152,63	152,45	81,71	86,31	106,83	111,27
ESTADO DE SANTA CATARINA	0,78	1,09	1,86	2,60	3,22	5,96	
Var. IPCA + 3,16% p.p.	-0,28	-0,78	-1,04	-4,60	-10,62	-17,54	
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%							
IPCA + 6,00%	1,27	2,31	3,61	8,65	16,99	30,36	43,68

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 MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI			D+1 du	D+1 du		0,50
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+1 du		1,00
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	D+1 du	D+0		D+4 du	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com baseno resultado do fundo, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do Certificado de Depósito Interfinanceiro - CDI, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	D+0	D+0	D+0	D+4 du		0,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0		D+3 du		
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 GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS 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 IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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

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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,82	1,37	2,11	5,58	10,34	16,07	20,72	25,42	28,98
INPC									
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,00	3,11	7,63	14,77	25,50	35,73	46,65	56,78
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,36	8,14	15,88	27,92	39,67	52,36	64,43
IPCA + 5,50%	1,23	2,23	3,48	8,39	16,43	29,13	41,66	55,27	68,36
IPCA + 5,89%	1,26	2,29	3,58	8,59	16,86	30,09	43,23	57,57	71,48
IPCA + 6,00%	1,27	2,31	3,61	8,65	16,99	30,36	43,68	58,22	72,37
INPC + 4,00%									
INPC + 6,00%									

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	Total					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.016.677,16

Value-At-Risk: 0,77%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ESTADO DE SANTA CATARINA		0,77	0,77			647.535.140,14	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,79%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,77	0,00	0,02			44.990,64	0,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,57	0,02	0,02			26.559.552,06	4,10
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,16	0,02			51.334.393,09	7,93
BB PREV RF IDKA2		1,35	0,08	0,37			40.688.910,54	6,28
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,60	0,04	0,08			9.058.670,58	1,40
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,16	0,04	2,04			24.711.940,34	3,82
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,16	0,06	0,03			33.517.156,22	5,18
BB PREV RF IPCA		1,33	0,08	1,34			50.973.030,49	7,87
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,12	0,17	2,02			102.184.130,83	15,78
Sub-total	2,08	1,27	0,65		0,04	0,82	339.072.774,79	52,36

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,06	0,00	0,03			87.495.484,70	13,51
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,00			125.670.194,36	19,41
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,85	0,05	0,87			39.866.428,77	6,16
Sub-total	0,19	0,15	0,06		-0,16	0,72	253.032.107,83	39,08

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,48%

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV MULTIMERCADO FI LP		0,66	0,01	0,65			11.948.718,93	1,85
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI		0,12	0,00	0,11			17.939.949,39	2,77
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI		0,91	0,01	0,91			15.490.047,15	2,39
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI		1,57	0,00	1,57			1.136.180,76	0,18
Sub-total	0,61	0,48	0,02		0,08	0,80	46.514.896,23	7,18

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,19%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		10,19	0,05	1,56			8.915.361,29	1,38
Sub-total	12,47	10,19	0,05		-0,02	0,56	8.915.361,29	1,38