



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA
JULHO 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 29.07.2022.

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 91,48%

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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,75	1,04	5,95	15.683.333,64	2,40	4.977.668.769,91	0,32
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,48	-0,89	3,29	53.151.165,48	8,13	5.189.858.068,29	1,02
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,68	-0,22	6,22	42.722.081,22	6,53	9.515.072.681,60	0,45
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,83	-1,86	-0,04	7.219.707,30	1,10	749.544.414,58	0,96
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,64	-0,00	6,47	35.286.058,45	5,40	6.564.821.510,69	0,54
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,28	0,08	7,21	92.064.259,07	14,08	3.068.003.584,32	3,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,55	0,41	4,13	69.503.688,81	10,63	4.928.627.960,16	1,41
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	5,33	1,18	1,02	10.102.262,58	1,54	125.992.531,63	8,02
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,78	-0,07	4,81	325.732.556,55	49,82		

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	1,04	6,64	104.228.505,44	15,94	10.247.937.610,00	1,02
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,17	0,95	5,87	97.906.250,40	14,97	3.157.315.937,43	3,10
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,99	0,64	4,97	70.318.136,38	10,75	3.323.314.760,57	2,12
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,33	0,89	5,93	272.452.892,22	41,67		
Renda Fixa			1,78	0,39	5,40	598.185.448,77	91,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,27%

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 PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	19,80	5,13	-0,15	8.293.463,26	1,27	414.827.443,90	2,00
Sub-total Artigo 8º I			19,80	5,13	-0,15	8.293.463,26	1,27		
Renda Variável			13,96	5,13	-0,15	8.293.463,26	1,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,25%

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	1,13	0,89	5,86	11.360.325,96	1,74	312.814.154,14	3,63
BB	BB	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,40	0,78	6,08	18.764.059,28	2,87	20.361.441.454,37	0,09
BB	BB	BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	2,19	0,64	6,22	16.088.776,47	2,46	2.239.554.170,24	0,72
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	3,00	0,65	5,78	1.181.409,64	0,18	119.066.875,94	0,99
Sub-total Artigo 10º I			0,76	0,75	6,06	47.394.571,35	7,25		
Investimentos Estruturados			0,76	0,75	6,06	47.394.571,35	7,25		
Total			1,75	0,49	5,39	653.873.483,38	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	325.732.556,55	49,82	0,00	44,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	272.452.892,22	41,67	0,00	47,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	598.185.448,77	91,48					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	8.293.463,26	1,27	0,00	4,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	8.293.463,26	1,27					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	47.394.571,35	7,25	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	47.394.571,35	7,25					15,00
Total		653.873.483,38	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	-0,07 -6,41	4,81 74,04	0,92 29,51	4,92 86,00	6,02 64,06	-161.184,78	15.605.696,22
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,89 86,13	5,93 91,32	2,79 89,55	5,29 92,50		2.906.064,75	16.244.173,07
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,13 0,44	-0,15 1,43	-3,11 1,25	-6,46 1,55		404.751,64	-12.758,79
Artigo 10º I % do CDI	0,75 72,79	6,06 93,35	2,11 67,84	5,05 88,35		354.346,68	2.761.977,42
ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)						3.503.978,29	34.599.087,92

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+	9.984.627,30	0,00	0,00	0,00	10.102.262,58	117.635,28	102.262,58
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	69.223.292,62	0,00	0,00	0,00	69.503.688,81	280.396,19	3.683.736,37
BB PREV RF IDKA2	42.816.660,30	0,00	0,00	0,00	42.722.081,22	-94.579,08	2.528.345,03
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	53.626.046,11	0,00	0,00	0,00	53.151.165,48	-474.880,63	1.694.092,47
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	35.287.121,09	0,00	0,00	0,00	35.286.058,45	-1.062,64	2.144.064,32
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7.356.188,45	0,00	0,00	0,00	7.219.707,30	-136.481,15	66.466,90
BB PREV RF IPCA	91.992.655,31	0,00	0,00	0,00	92.064.259,07	71.603,76	3.791.147,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.607.150,15	10.000.000,00	0,00	0,00	15.683.333,64	76.183,49	1.499.035,07
					325.732.556,55	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	72.868.449,36	0,00	-3.000.000,00	0,00	70.318.136,38	449.687,02	2.592.041,18
BB PREV RF FLUXO FIC	120.416.693,87	496.548.889,72	-520.446.757,37	0,00	97.906.250,40	1.387.424,18	7.551.462,05
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	103.159.551,89	0,00	0,00	0,00	104.228.505,44	1.068.953,55	6.100.669,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					272.452.892,22	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 PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	7.888.711,62	0,00	0,00	0,00	8.293.463,26	404.751,64	-12.758,79
					8.293.463,26	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	18.619.344,45	0,00	0,00	0,00	18.764.059,28	144.714,83	1.075.871,28
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	15.987.036,46	0,00	0,00	0,00	16.088.776,47	101.740,01	942.566,20
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.173.785,18	0,00	0,00	0,00	1.181.409,64	7.624,46	64.594,55
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	11.260.058,58	0,00	0,00	0,00	11.360.325,96	100.267,38	678.945,39
					47.394.571,35	0,00	0,00

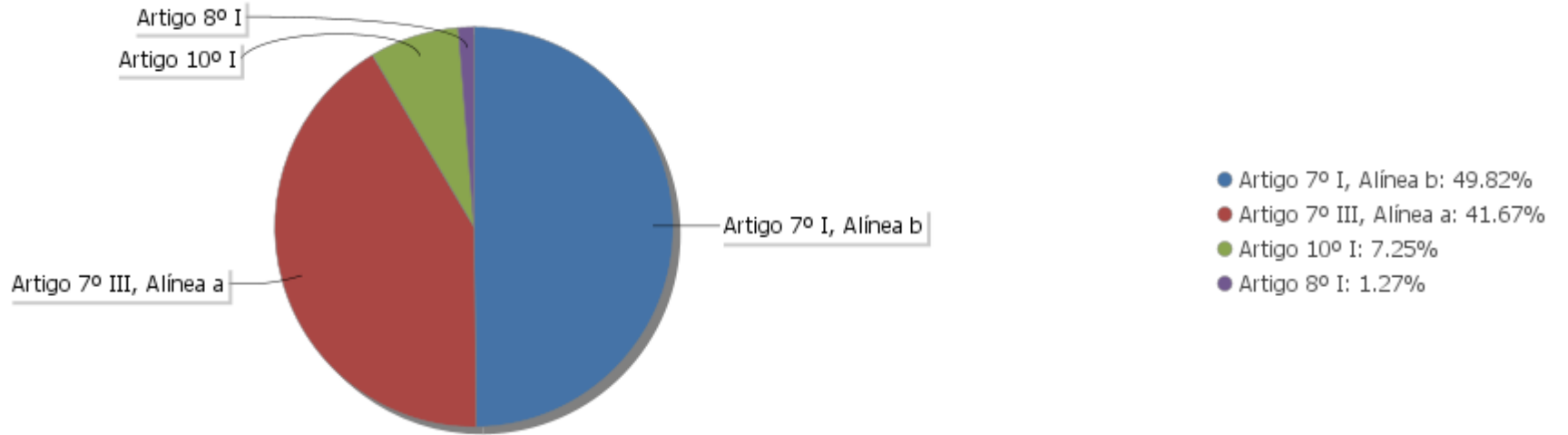
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

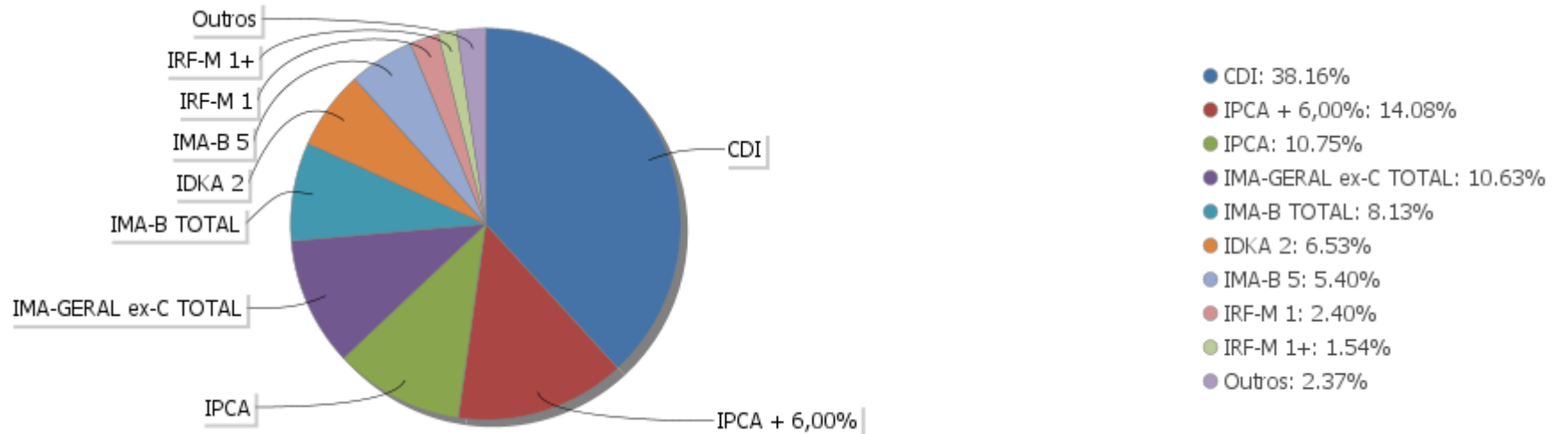
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	561.809.224,31	85,92	561.809.224,31	85,92
de 31 a 365 dias	92.064.259,07	14,08	653.873.483,38	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	653.873.483,38	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

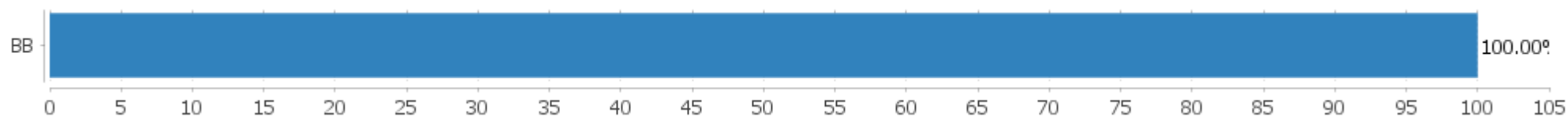


Alocação Por Estratégia



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	1,62	0,76	0,95	0,38	0,49						5,39
INPC + 1,55%	0,80	1,12	1,85	1,16	0,58	0,75	-0,47						5,91
p.p. indexador	-0,49	-0,33	-0,23	-0,40	0,36	-0,37	0,96						-0,52
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

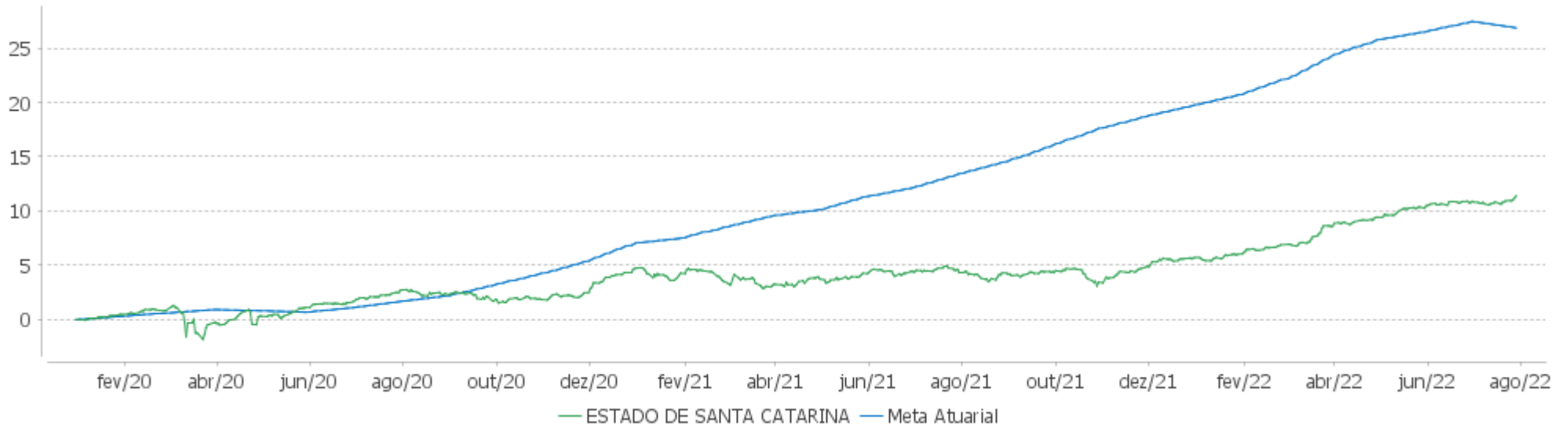
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

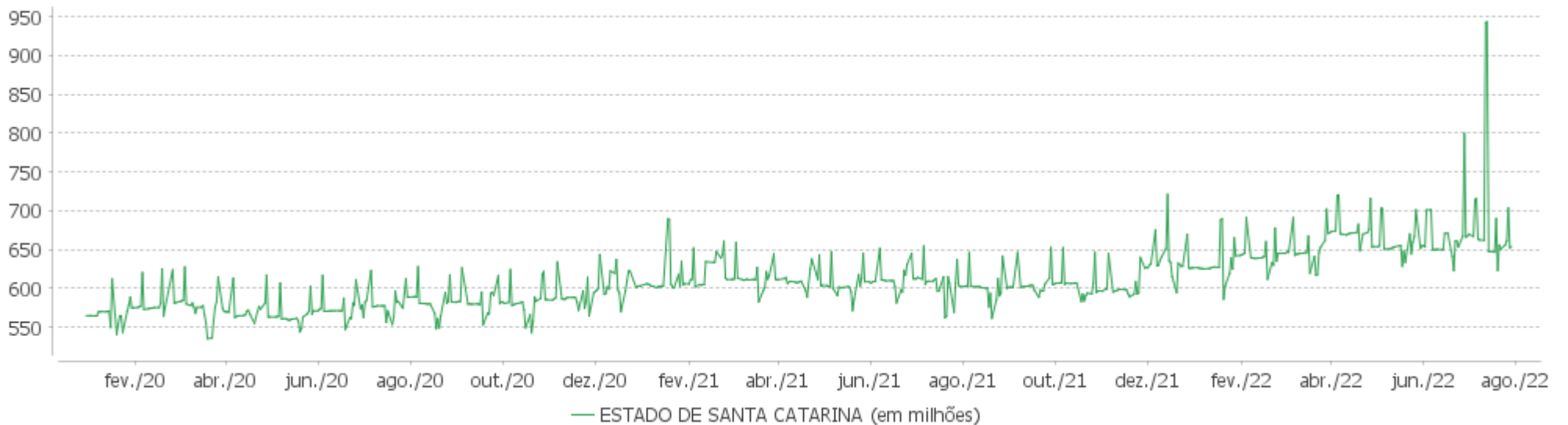
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	25,81	03 meses	1,82	0,86	0,96	1,37
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	74,19	06 meses	5,07	5,07	-0,00	1,45
			12 meses	6,80	12,61	-5,81	1,75
			24 meses	8,47	26,40	-17,93	2,01
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12	Desde 31/12/2019	11,42	29,28	-17,86	2,64
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

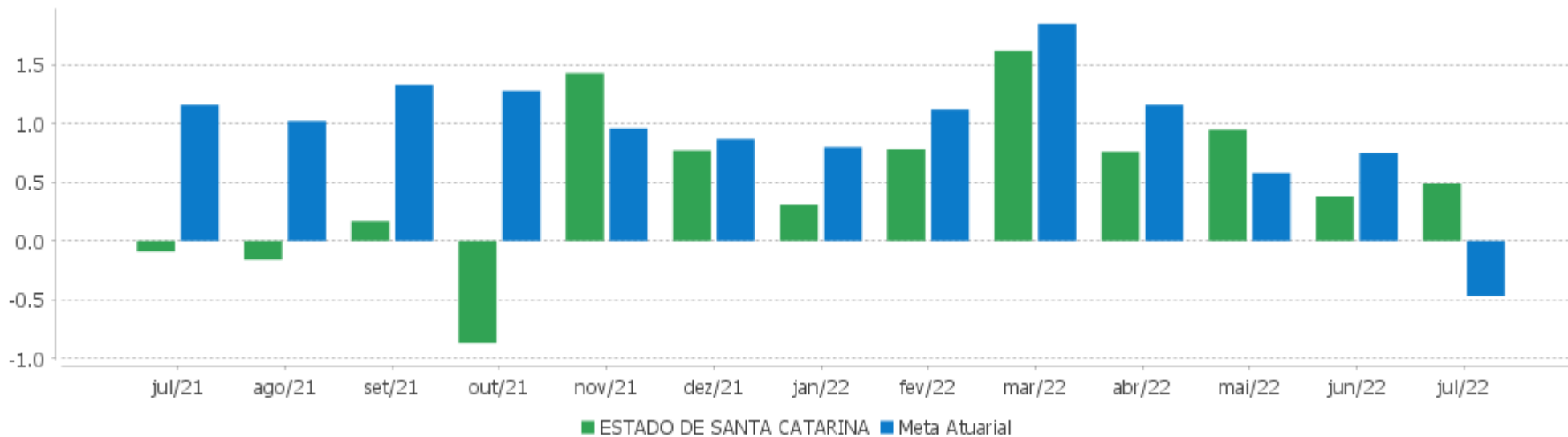


Patrimônio Líquido



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.	-0,22 -0,05	6,22 -0,44	0,82 -0,33	6,21 -0,40	9,51 -0,60	15,66 -0,93	24,90 -1,81
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,41	4,13	1,56	4,09	4,69	5,26	12,73
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	1,18 -0,02	1,86 -0,08	1,59 -0,09	2,46 0,01	0,73 -0,27	-3,00 -0,64	8,12 -1,24
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,08 0,27	7,21 -1,13	0,92 -1,04	7,11 -0,12	10,41 -6,24	15,65 -19,05	27,48 -18,64
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,04 -0,01	5,95 -0,14	2,91 -0,05	5,30 -0,13	7,86 -0,25	9,57 -0,69	15,29 -1,04
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,00 -0,01	6,47 -0,15	1,09 -0,04	6,39 -0,11	9,71 -0,33	14,96 -0,65	24,84 -0,98
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,89 -0,01	3,29 -0,14	-0,29 -0,00	4,09 -0,10	2,96 -0,29	5,30 -0,56	13,66 -0,83
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,86 -0,02	-0,04 -0,19	-1,86 -0,07	1,62 -0,17	-3,54 -0,32	-3,55 -0,67	3,86 -0,84
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,04 100,13	6,64 102,22	3,16 101,60	5,81 101,57	9,68 103,11	12,43 103,16	16,64 99,06
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,95 91,86	5,87 90,37	2,86 91,99	5,18 90,61	8,24 87,71	9,65 80,03	13,07 77,84
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,64 1,32	4,97 0,20	2,04 1,59	4,77 0,56	6,06 -4,01	7,29 -12,68	
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST Var. IBOVESPA p.p.	5,13 0,44	-0,15 1,43	-3,11 1,25	-6,46 1,55	-15,16 0,14	0,40 0,15	-1,90 -3,23
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	0,65 62,77	5,78 89,09	1,77 56,78	5,02 87,74	6,86 73,04	9,09 75,46	
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	0,89 86,05	5,86 90,33	2,19 70,39	4,92 85,99	8,17 86,97	10,38 86,11	16,56 98,60
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,78 75,11	6,08 93,69	2,74 87,92	5,34 93,38	8,97 95,54	12,52 103,88	18,17 108,19
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI % do CDI	0,64 61,50	6,22 95,85	1,37 44,07	4,84 84,65	7,36 78,42	10,51 87,24	16,52 98,38
ESTADO DE SANTA CATARINA	0,49	5,39	1,82	5,07	6,80	8,47	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. INPC + 1,55% p.p.	0,96	-0,52	0,96	-0,00	-5,02	-16,27	
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 IRF-M 1+	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
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 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 IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
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

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00

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	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26	16,33	24,81	34,03
IRF-M 1+	1,20	1,94	1,68	2,45	1,01	-2,37	9,37	29,67	40,37
IRF-M TOTAL	1,15	3,36	2,11	3,45	3,42	1,97	11,97	29,08	39,48
IMA-B 5	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61	25,82	43,53	55,41
IMA-B 5+	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89	4,70	45,06	51,68
IMA-B TOTAL	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86	14,50	45,94	55,35
IMA-GERAL TOTAL	0,47	4,98	1,83	4,76	5,95	7,72	15,62	33,41	43,39
IDKA 2	-0,17	6,66	1,15	6,61	10,11	16,59	26,71	42,67	55,48
IDKA 20	-3,59	-6,10	-5,30	-3,27	-15,47	-16,49	-12,36	41,45	43,04
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33	30,22	56,50
IBRX 100	4,40	-1,57	-4,69	-7,90	-16,32	1,03	3,22	35,06	60,67
IBRX 50	4,54	-1,43	-4,61	-8,44	-15,95	2,74	2,97	30,16	56,41
SMALL CAP	5,16	-15,55	-13,62	-18,34	-32,57	-19,00	-12,63	25,78	39,30
IFIX	0,66	0,33	0,04	1,34	-0,35	2,96	5,81	30,62	36,20
Índice Consumo - ICON	9,18		-9,26	-19,73	-38,06	-36,23	-28,49	-1,52	0,77
Índice Dividendos - IDIV	1,98	6,66	-2,58	-0,76	-0,49	13,65	17,63	66,49	85,47

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	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97	22,74	26,69	32,37
INPC	-0,60	4,98	0,47	4,28	10,12	20,98	24,23	28,16	32,79
IGPM	0,21	8,39	1,32	6,45	10,08	47,31	60,97	71,26	85,37
SELIC	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,03

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	8,08	-19,43	5,43	-11,42	-4,80	25,90	90,98	102,65	177,09
MSCI ACWI	5,85	-21,45	2,90	-13,91	-10,79	15,22	67,60	69,52	121,29

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,35	7,16	1,46	6,24	14,45	29,70	38,02	48,12	60,90
IPCA + 5,00%	-0,28	7,75	1,71	6,74	15,55	32,19	42,03	53,87	68,75
IPCA + 5,50%	-0,24	8,05	1,83	6,99	16,10	33,44	44,06	56,81	72,78
IPCA + 5,89%	-0,21	8,28	1,93	7,18	16,53	34,43	45,66	59,14	75,99
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11	59,80	76,90
INPC + 4,00%	-0,27	7,37	1,47	6,31	14,51	30,79	39,70	49,84	61,41
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90	61,65	77,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1711	01/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.905.308,41	0,00	1.268.313,55346400	2,2906862440
1666	01/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.695,39	8.161,48001500	2,2906862440
1698	04/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	302.638,23	132.056,76290500	2,2917283700
1712	04/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.905.308,41	1.267.736,80861700	2,2917283700
1732	04/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	312.578,07	0,00	136.394,03085100	2,2917283700
1649	04/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.021,85	0,00	882,23806300	2,2917283700
1667	04/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	307.312,93	0,00	134.096,57707300	2,2917283700
1713	05/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	694.579,97	0,00	302.944,08073200	2,2927662700
1650	05/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.034,00	887,13796400	2,2927662700
1668	05/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	47.065.737,52	0,00	20.527.926,52083100	2,2927662700
1710	06/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.072.939,03	0,00	467.753,29930100	2,2938139220
1733	06/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	239.984,59	0,00	104.622,51872200	2,2938139220
1651	06/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	608,18	265,13920500	2,2938139220
1669	06/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.980,88	0,00	2.171,44030300	2,2938139220
1688	07/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	296.194,16	129.068,85523700	2,2948538550
1699	07/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	352.914,54	153.785,19169400	2,2948538550
1714	07/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.135.058,11	494.610,19381600	2,2948538550
1724	07/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	125.261,02	54.583,44100100	2,2948538550
1646	07/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.047.253,11	0,00	1.327.863,69091000	2,2948538550
1652	07/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	108.637,49	47.339,61152400	2,2948538550
1670	07/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	53.838.908,79	23.460.713,48844100	2,2948538550
1653	08/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	967,68	0,00	421,48336700	2,2958913090
1671	08/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	30.207,13	0,00	13.157,03835000	2,2958913090
1654	11/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	17.645,94	0,00	7.682,44400100	2,2969174910
1672	11/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	5.193,05	0,00	2.260,87790200	2,2969174910
1689	12/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	531.018,07	0,00	231.083,07935000	2,2979530630
1673	12/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	279.262.496,88	0,00	121.526.632,27830200	2,2979530630
1715	13/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	7.744,47	0,00	3.368,63252900	2,2989951950

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1655	13/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	5.366,90	0,00	2.334,45463900	2,2989951950
1674	13/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.541,61	0,00	4.150,33925200	2,2989951950
1690	14/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.328.600,35	1.012.423,75718400	2,3000253930
1700	14/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.281.968,04	1.426.926,87219400	2,3000253930
1716	14/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	853.782,05	371.205,48868700	2,3000253930
1725	14/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.413.248,20	614.448,95534700	2,3000253930
1656	14/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	718.118,77	312.222,10510600	2,3000253930
1675	14/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	286.926.240,40	124.749.162,01936000	2,3000253930
1657	15/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	14.725,50	0,00	6.399,44002700	2,3010607080
1676	15/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	378.550,13	164.511,14422300	2,3010607080
1658	18/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	19.923,50	0,00	8.654,47662700	2,3021033920
1677	18/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.141,39	0,00	495,80310000	2,3021033920
1701	19/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	21.489.448,52	0,00	9.330.551,46027600	2,3031273780
1717	19/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.241.243,32	0,00	973.130,42318400	2,3031273780
1659	19/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	71.229,07	30.927,10836600	2,3031273780
1678	19/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	19.858.649,07	0,00	8.622.471,01905600	2,3031273780
1691	20/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	61.319,03	26.612,40419800	2,3041522120
1702	20/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	29.894.161,72	12.974.039,45985500	2,3041522120
1718	20/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.028.004,10	880.151,96628000	2,3041522120
1726	20/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.536.272,17	2.836.736,27808100	2,3041522120
1660	20/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.641.731,22	2.882.505,41149600	2,3041522120
1679	20/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.748.290,22	9.872.737,61756200	2,3041522120
1692	21/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	20.022.302,28	0,00	8.685.763,23699800	2,3051862840
1703	21/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.549.950,62	0,00	1.973.788,69186400	2,3051862840
1709	21/07/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	3.000.000,00	2.679.590,29253800	1,1195741410
1719	21/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	10.890.076,06	0,00	4.724.163,13405400	2,3051862840
1680	21/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	21.542,52	0,00	9.345,24040400	2,3051862840
1693	22/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.022.302,28	8.681.835,61326400	2,3062291400
1704	22/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	12.748.273,10	0,00	5.527.756,49170700	2,3062291400
1720	22/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.442.212,16	3.660.612,90856700	2,3062291400

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1727	22/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.974.754,55	0,00	4.325.135,94464400	2,3062291400
1681	22/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	52.681,63	22.843,18981400	2,3062291400
1694	25/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	5.558.247,90	0,00	2.409.018,10439700	2,3072669690
1661	25/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	378.304,59	163.962,20943800	2,3072669690
1682	25/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	11.243,35	0,00	4.873,01649500	2,3072669690
1705	26/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	591.450,45	0,00	256.228,19379500	2,3082957470
1647	26/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	143,36	0,00	62,10642600	2,3082957470
1662	26/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	495,00	214,44392500	2,3082957470
1683	26/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.798.119,13	0,00	2.078.641,41162800	2,3082957470
1695	27/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.105.429,93	478.679,65973700	2,3093313190
1706	27/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.200.827,13	0,00	519.989,10685500	2,3093313190
1721	27/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	486.576,10	210.699,99614000	2,3093313190
1728	27/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	754.217,81	326.595,75687300	2,3093313190
1731	27/07/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	10.000.000,00	0,00	3.380.491,34192900	2,9581498630
1734	27/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.000.000,00	4.330.257,81867000	2,3093313190
1663	27/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	866.827,36	375.358,59530800	2,3093313190
1684	27/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	43.547.470,45	0,00	18.857.177,43994200	2,3093313190
1696	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.351.830,98	1.017.948,56041400	2,3103632850
1707	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.146.165,66	3.093.091,76889900	2,3103632850
1722	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.139.626,40	493.267,18763200	2,3103632850
1729	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.566.026,47	677.826,93750700	2,3103632850
1735	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.043,33	0,00	1.317,25171500	2,3103632850
1664	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.126.702,28	487.673,21023300	2,3103632850
1685	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.447,10	7.118,83715700	2,3103632850
1686	28/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	38.869.420,09	16.823.942,94540600	2,3103632850
1697	29/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.212,57	0,00	1.822,51330300	2,3114069960
1708	29/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	300.611,11	0,00	130.055,46427700	2,3114069960
1723	29/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	16.303,46	0,00	7.053,47869400	2,3114069960
1730	29/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	15.843,41	0,00	6.854,44407900	2,3114069960
1648	29/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.047.396,47	1.318.416,21803300	2,3114069960

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1665	29/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	106.321,27	45.998,50661700	2,3114069960
1687	29/07/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.146.465,55	0,00	1.361.277,15951500	2,3114069960
Total			506.548.889,72	523.446.757,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.636.998,92

Value-At-Risk: 0,71%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ESTADO DE SANTA CATARINA		0,71	0,71			653.873.483,38	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,71%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,24	0,00	0,02			15.683.333,64	2,40
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,16	0,03			53.151.165,48	8,13
BB PREV RF IDKA2		1,34	0,08	0,29			42.722.081,22	6,53
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,64	0,04	0,08			7.219.707,30	1,10
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,24	0,06	0,06			35.286.058,45	5,40
BB PREV RF IPCA		0,97	0,09	0,93			92.064.259,07	14,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,02	0,10	1,02			69.503.688,81	10,63
BB PREV IRF-M 1+		2,43	0,03	0,08			10.102.262,58	1,54
Sub-total	2,51	1,15	0,56		-0,44	-0,07	325.732.556,55	49,82

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		0,04	0,00	0,03			104.228.505,44	15,94
BB PREV RF FLUXO FIC		0,03	-0,00	0,01			97.906.250,40	14,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,78	0,08	0,80			70.318.136,38	10,75
Sub-total	0,34	0,20	0,08		-0,43	0,89	272.452.892,22	41,67

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,38%

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		0,43	0,01	0,43			11.360.325,96	1,74
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI		0,23	-0,00	0,24			18.764.059,28	2,87
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI		0,90	0,01	0,91			16.088.776,47	2,46
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI		0,75	0,00	0,75			1.181.409,64	0,18
Sub-total	0,71	0,38	0,01		-0,40	0,75	47.394.571,35	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,56%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST		9,56	0,06	1,98			8.293.463,26	1,27
Sub-total	16,72	9,56	0,06		0,24	5,13	8.293.463,26	1,27