



**LDB**  
EMPRESAS

**ESTADO DE SANTA CATARINA**  
JULHO 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 31.07.2023.

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

98,73%

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	2,46	0,06	0,79	9,61	134.531.775,35	17,94	5.898.923.569,05	2,28
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,36	0,06	1,06	7,62	42.530.830,35	5,67	7.147.233.323,14	0,60
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,15	0,26	0,73	12,10	161.390.260,93	21,52	4.905.523.474,02	3,29
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,48	0,09	0,94	7,57	47.296.062,35	6,31	6.277.767.899,83	0,75
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,02	0,38	0,69	15,45	8.584.102,28	1,14	1.449.653.568,31	0,59
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,34	0,12	0,95	8,01	39.200.961,44	5,23	5.434.496.212,00	0,72
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	5,07	0,19	0,81	12,07	11.899.354,05	1,59	339.500.701,57	3,50
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,41</b>	<b>0,15</b>	<b>0,82</b>	<b>9,55</b>	<b>445.433.346,75</b>	<b>59,40</b>		

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 REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,06	7,57	129.915.965,23	17,33	14.673.774.494,53	0,89
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,98	7,02	165.003.807,25	22,00	3.542.574.797,77	4,66
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,49</b>	<b>0,05</b>	<b>1,02</b>	<b>7,28</b>	<b>294.919.772,48</b>	<b>39,33</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,54</b>	<b>0,11</b>	<b>0,90</b>	<b>8,74</b>	<b>740.353.119,23</b>	<b>98,73</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**RENDA VARIÁVEL**

1,27%

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	20,13	1,59	3,65	10,45	9.509.360,96	1,27	335.529.912,90	2,83
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>20,13</b>	<b>1,59</b>	<b>3,65</b>	<b>10,45</b>	<b>9.509.360,96</b>	<b>1,27</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>20,13</b>	<b>1,59</b>	<b>3,65</b>	<b>10,45</b>	<b>9.509.360,96</b>	<b>1,27</b>		
<b>Total</b>			<b>1,62</b>	<b>0,13</b>	<b>0,93</b>	<b>8,73</b>	<b>749.862.480,19</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	445.433.346,75	59,40	0,00	44,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	294.919.772,48	39,33	0,00	43,00	70,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>740.353.119,23</b>	<b>98,73</b>					<b>100,00</b>
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.509.360,96	1,27	0,00	3,00	40,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>9.509.360,96</b>	<b>1,27</b>					<b>30,00</b>
<b>Total</b>		<b>749.862.480,19</b>	<b>100,00</b>					

**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 76,76	9,55 125,04	4,33 130,98	8,60 133,41	13,51 99,43	3.635.230,22	40.139.067,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,02 95,07	7,28 95,29	3,19 96,73	6,14 95,29	12,70 93,48	2.975.157,50	18.857.346,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,65 0,38	10,45 -0,67	16,02 -0,75	6,90 -0,61	14,66 -3,54	334.689,47	899.772,39
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	3,54 46,32	0,00 0,00	2,44 37,92	8,53 62,78	0,00	1.343.005,22
<b>ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)</b>						<b>6.945.077,19</b>	<b>61.239.190,63</b>

**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+	11.804.088,91	0,00	0,00	0,00	11.899.354,05	95.265,14	1.281.400,31
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	133.481.847,55	0,00	0,00	0,00	134.531.775,35	1.049.927,80	13.896.056,88
BB PREV RF IDKA2	46.854.086,44	0,00	0,00	0,00	47.296.062,35	441.975,91	3.327.265,99
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	160.215.376,72	0,00	0,00	0,00	161.390.260,93	1.174.884,21	10.403.135,93
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	38.832.002,02	0,00	0,00	0,00	39.200.961,44	368.959,42	2.905.827,11
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.525.370,26	0,00	0,00	0,00	8.584.102,28	58.732,02	1.148.991,32
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	42.085.344,63	0,00	0,00	0,00	42.530.830,35	445.485,72	2.165.337,31
					445.433.346,75	3.635.230,22	

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	163.397.079,89	0,00	0,00	0,00	165.003.807,25	1.606.727,36	9.580.919,32
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	128.547.535,09	0,00	0,00	0,00	129.915.965,23	1.368.430,14	9.276.426,70
					294.919.772,48	2.975.157,50	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	9.174.671,49	0,00	0,00	0,00	9.509.360,96	334.689,47	899.772,39
					9.509.360,96	334.689,47	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

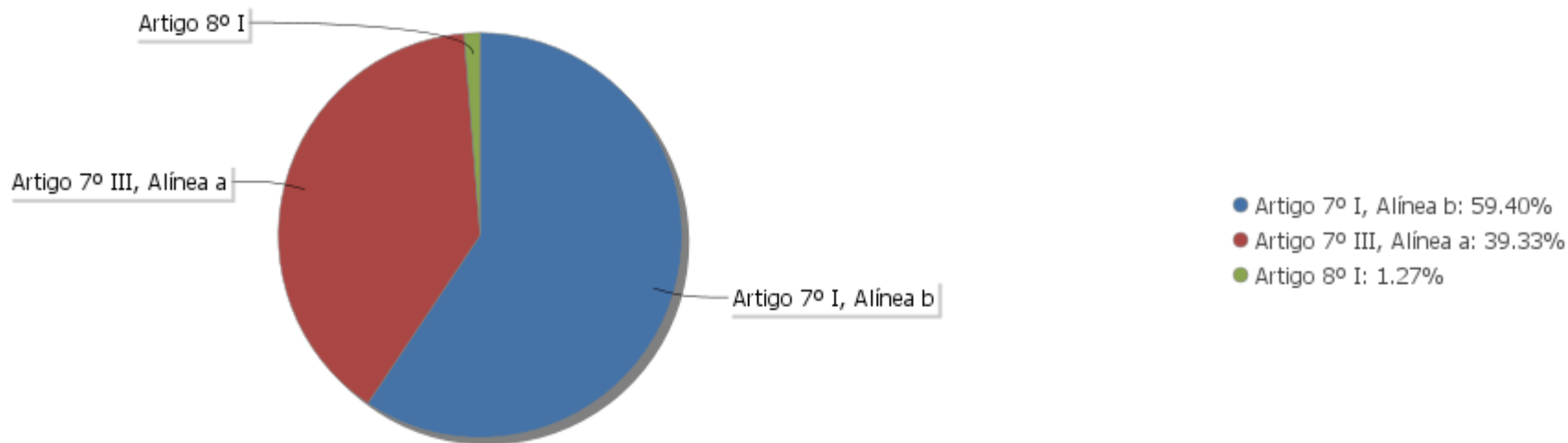
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	749.862.480,19	100,00	749.862.480,19	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	749.862.480,19	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	749.862.480,19	100,00	

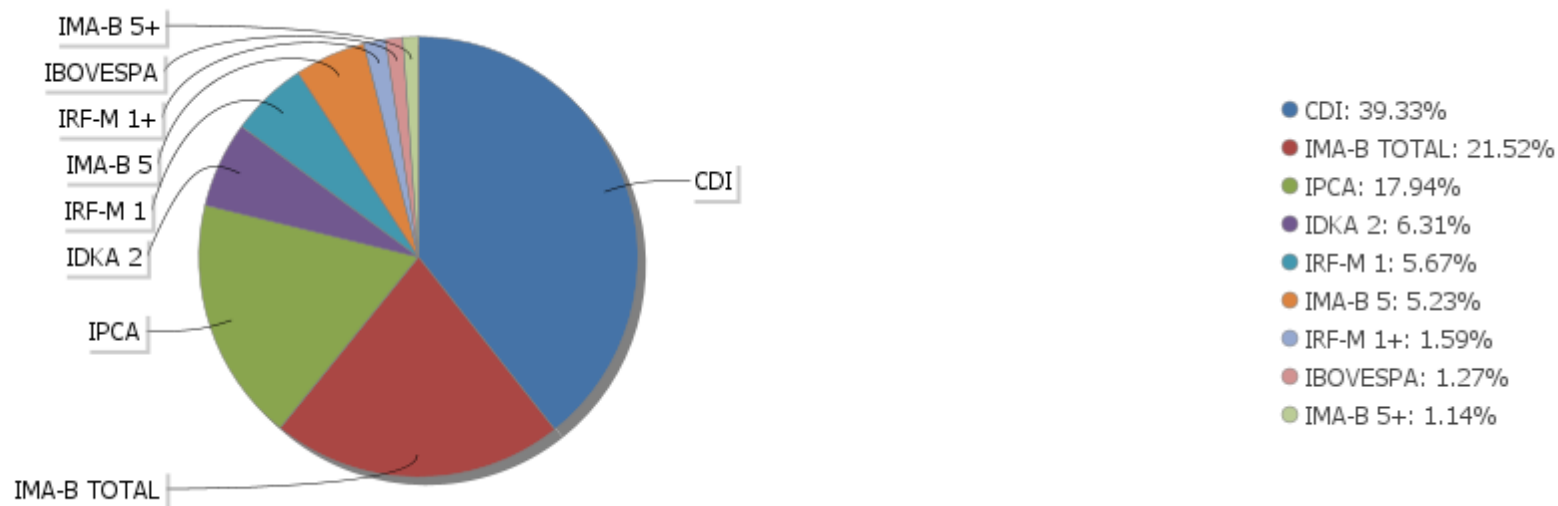


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

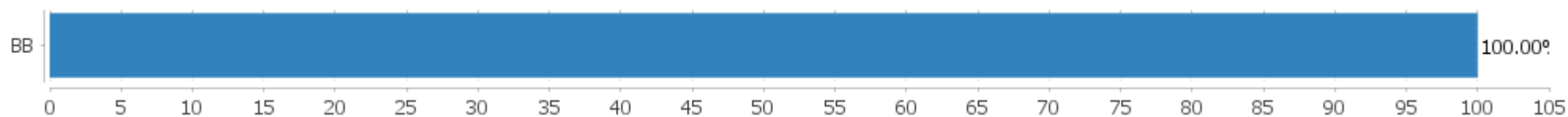


Alocação Por Estratégia



## 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
<b>2023</b>	0,99	0,88	1,43	1,09	1,47	1,63	0,93						8,73
INPC + 1,72%	0,61	0,89	0,80	0,65	0,51	0,04	0,05						3,61
p.p. indexador	0,38	-0,02	0,63	0,44	0,96	1,59	0,88						5,12
<b>2022</b>	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
<b>2021</b>	-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
<b>2020</b>	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

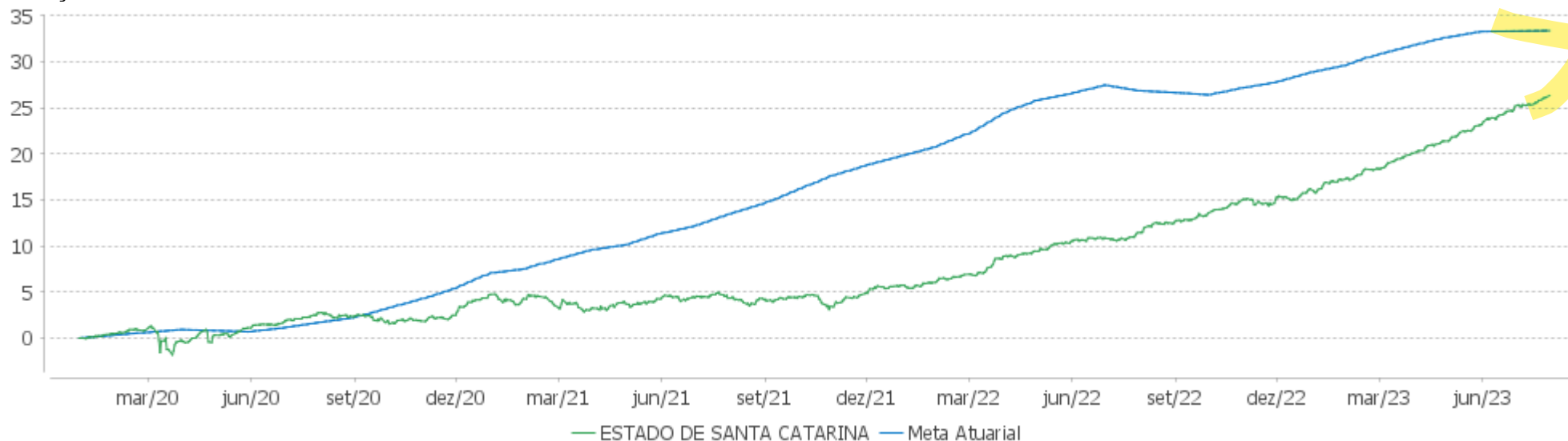
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

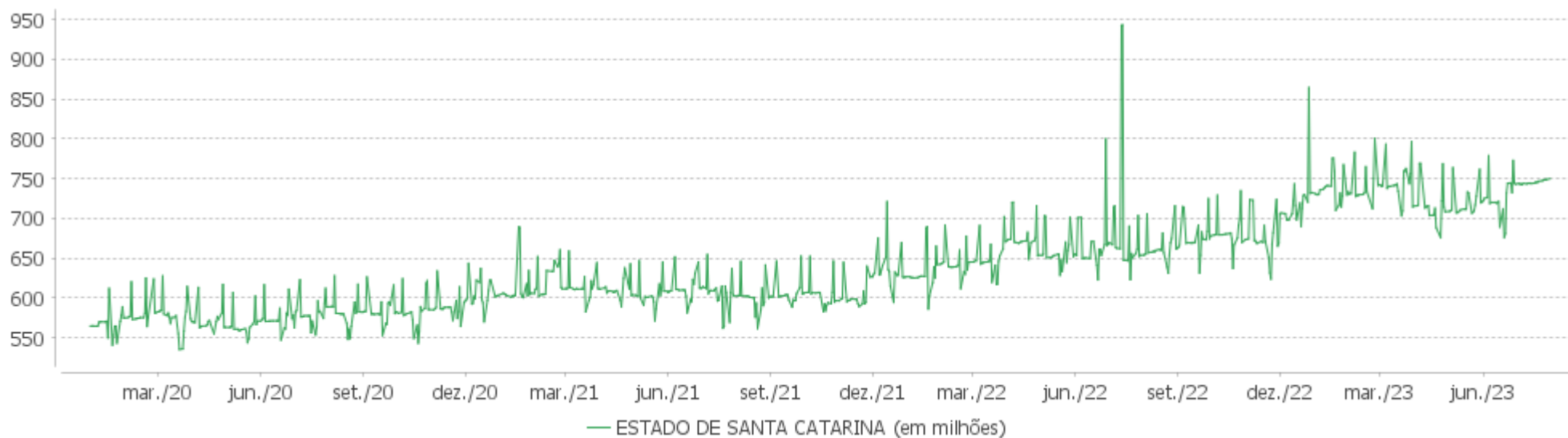
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	39,53	03 meses	4,09	0,60	3,48	1,35
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	60,47	06 meses	7,66	2,98	4,68	1,27
			12 meses	13,37	5,23	8,14	1,62
			24 meses	21,08	18,50	2,58	1,70
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12	36 meses	22,96	33,00	-10,04	1,90
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03	Desde 31/12/2019	26,32	36,04	-9,73	2,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

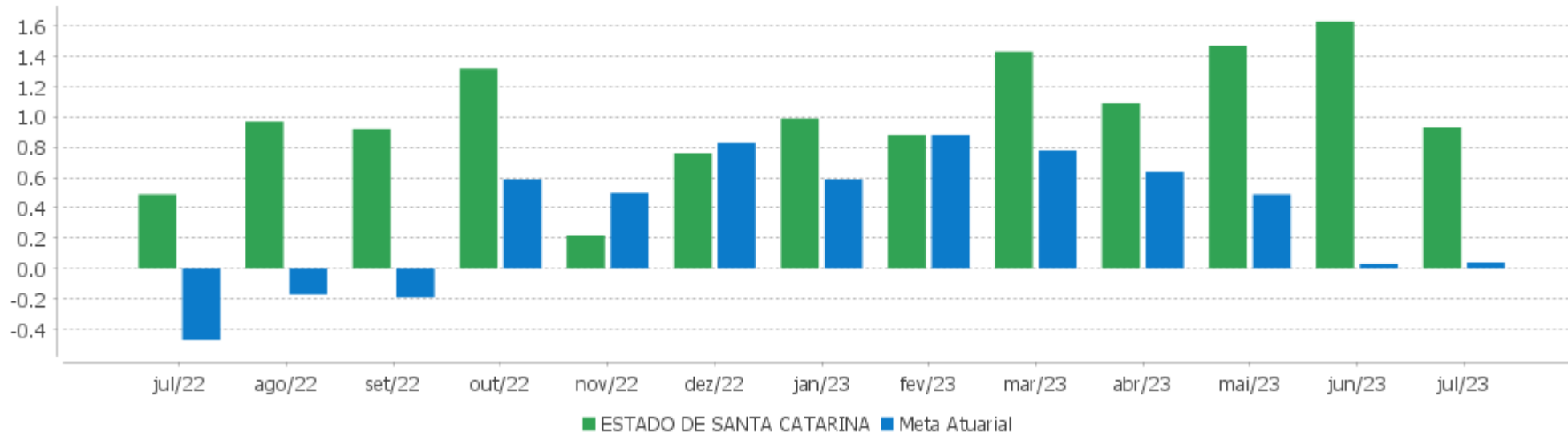


Patrimônio Líquido



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.	0,94 -0,04	7,57 -0,27	2,37 0,11	6,04 -0,26	10,71 0,16	21,24 -0,49	28,04 -0,84
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	0,81 -0,01	12,07 -0,26	6,39 -0,04	11,32 -0,20	17,79 -0,57	18,65 -0,90	14,25 -1,30
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,06 -0,01	7,62 -0,19	3,38 -0,06	6,49 -0,15	13,50 -0,34	22,42 -0,66	24,35 -1,16
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,02	8,01 -0,08	2,61 -0,01	6,54 -0,05	11,09 -0,19	21,88 -0,59	27,72 -0,94
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,73 -0,08	12,10 -0,17	5,78 -0,05	12,11 -0,16	15,14 -0,32	18,55 -0,66	21,24 -0,98
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,79 0,67	9,61 6,62	4,54 4,27	8,91 6,45	14,14 10,15	21,06 6,59	22,46 -2,30
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,69 -0,04	15,45 -0,29	8,30 -0,12	16,93 -0,29	18,90 -0,48	14,69 -0,85	14,67 -1,25
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,06 99,30	7,57 99,07	3,34 101,26	6,37 98,91	13,57 99,91	24,57 101,31	27,69 101,54
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,98 91,73	7,02 91,90	3,06 92,50	5,93 91,96	12,47 91,82	21,74 89,64	23,32 85,51
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,65 0,38	10,45 -0,67	16,02 -0,75	6,90 -0,61	14,66 -3,54	-2,73 -2,84	15,12 -3,38
ESTADO DE SANTA CATARINA Var. INPC + 1,55% p.p.	0,93 0,88	8,73 5,12	4,09 3,48	7,66 4,68	13,37 8,07	21,08 3,13	22,96 -8,82
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

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 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 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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67



**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	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	<b>Total</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 4.848.224,03

Value-At-Risk: 0,65%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>ESTADO DE SANTA CATARINA</b>		<b>0,65</b>	0,65			749.862.480,19	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,62%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		<b>0,71</b>	0,12	0,71			134.531.775,35	17,94
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		<b>0,16</b>	0,01	0,01			42.530.830,35	5,67
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		<b>1,65</b>	0,35	0,05			161.390.260,93	21,52
BB PREV RF IDKA2		<b>0,77</b>	0,04	0,19			47.296.062,35	6,31
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		<b>2,48</b>	0,03	0,06			8.584.102,28	1,14
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		<b>0,79</b>	0,04	0,03			39.200.961,44	5,23
BB PREV IRF-M 1+		<b>1,75</b>	0,02	0,03			11.899.354,05	1,59
<b>Sub-total</b>	1,91	<b>1,02</b>	0,60		<b>-0,13</b>	<b>0,82</b>	445.433.346,75	59,40

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		<b>0,02</b>	0,00	0,02			129.915.965,23	17,33
BB PREV RF FLUXO FIC		<b>0,01</b>	0,00	0,01			165.003.807,25	22,00
<b>Sub-total</b>	0,02	<b>0,01</b>	0,00		<b>-3,02</b>	<b>1,02</b>	294.919.772,48	39,33

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,65%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		<b>7,65</b>	0,04	1,70			9.509.360,96	1,27

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	15,64	7,65	0,04		0,16	3,65	9.509.360,96	1,27