



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA
JUNHO 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 30.06.2022.

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 91,77%

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	3,67	0,09	1,86	0,00	0,00	3.520.668.596,00	0,00
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,74	0,92	4,85	5.607.150,15	0,84	5.103.254.867,87	0,11
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,42	-0,35	4,22	53.626.046,11	8,04	5.700.982.768,47	0,94
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,27	6,46	42.816.660,30	6,42	9.717.321.383,29	0,44
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,70	-1,10	1,85	7.356.188,45	1,10	753.533.957,67	0,98
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,61	0,32	6,47	35.287.121,09	5,29	6.996.220.208,06	0,50
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,29	0,33	7,12	91.992.655,31	13,79	2.872.769.394,76	3,20
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,59	0,33	3,71	69.223.292,62	10,37	5.102.683.195,98	1,36
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	5,25	-0,15	-0,15	9.984.627,30	1,50	124.625.163,72	8,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,77	0,19	4,88	315.893.741,33	47,34		

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	0,18	1,03	5,54	103.159.551,89	15,46	9.838.414.136,64	1,05
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,18	0,93	4,87	120.416.693,87	18,05	3.467.595.820,39	3,47
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,07	0,46	4,30	72.868.449,36	10,92	3.751.851.953,61	1,94
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,33	0,86	4,99	296.444.695,12	44,43		
Renda Fixa			1,80	0,54	4,99	612.338.436,45	91,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,18%

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	19,84	-11,05	-5,03	7.888.711,62	1,18	395.433.404,84	1,99
Sub-total Artigo 8º I			19,84	-11,05	-5,03	7.888.711,62	1,18		
Renda Variável			13,18	-11,05	-5,03	7.888.711,62	1,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,05%

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	1,19	0,21	4,93	11.260.058,58	1,69	318.857.158,09	3,53
BB	BB	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,36	1,05	5,26	18.619.344,45	2,79	20.583.570.437,89	0,09
BB	BB	BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	2,20	-0,06	5,55	15.987.036,46	2,40	2.439.219.467,98	0,66
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	3,18	0,03	5,10	1.173.785,18	0,18	118.016.991,27	0,99
Sub-total Artigo 10º I			0,77	0,44	5,27	47.040.224,67	7,05		
Investimentos Estruturados			0,77	0,44	5,27	47.040.224,67	7,05		
Total			1,78	0,38	4,88	667.267.372,74	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	315.893.741,33	47,34	0,00	44,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	296.444.695,12	44,43	0,00	47,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	612.338.436,45	91,77					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	7.888.711,62	1,18	0,00	4,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	7.888.711,62	1,18					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	47.040.224,67	7,05	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	47.040.224,67	7,05					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	0,19 18,54	4,88 90,28	2,03 70,00	4,88 90,28	5,91 68,33	650.803,69	15.766.881,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,86 85,11	4,99 92,44	2,62 89,99	4,99 92,44		2.565.555,33	13.338.108,32
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-11,05 0,45	-5,03 0,97	-15,73 2,15	-5,03 0,97		-980.242,13	-417.510,43
Artigo 10º I % do CDI	0,44 43,38	5,27 97,52	2,28 78,52	5,27 97,52		210.631,87	2.407.630,74
ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)						2.446.748,76	31.095.109,63

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+	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	9.984.627,30	-15.372,70	-15.372,70
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	73.481.387,69	0,00	-4.500.000,00	0,00	69.223.292,62	241.904,93	3.403.340,18
BB PREV RF IDKA2	42.703.024,99	0,00	0,00	0,00	42.816.660,30	113.635,31	2.622.924,11
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	53.815.873,43	0,00	0,00	0,00	53.626.046,11	-189.827,32	2.168.973,10
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	35.175.372,63	0,00	0,00	0,00	35.287.121,09	111.748,46	2.145.126,96
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	10.521.223,68	0,00	-3.085.748,61	0,00	7.356.188,45	-79.286,62	202.948,05
BB PREV RF IPCA	52.143.232,86	39.541.910,95	0,00	0,00	91.992.655,31	307.511,50	3.719.543,24
BB PREV RF IRF M	8.639.167,76	0,00	-8.646.724,57	0,00	0,00	7.556,81	136.846,98
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	35.939.291,55	0,00	-30.485.074,72	0,00	5.607.150,15	152.933,32	1.422.851,58
					315.893.741,33	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	72.532.893,46	0,00	0,00	0,00	72.868.449,36	335.555,90	2.142.354,16
BB PREV RF FLUXO FIC	110.927.707,04	334.665.806,52	-326.359.240,67	0,00	120.416.693,87	1.182.420,98	6.164.037,87

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	102.111.973,44	0,00	0,00	0,00	103.159.551,89	1.047.578,45	5.031.716,29
					296.444.695,12	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	8.868.953,75	0,00	0,00	0,00	7.888.711,62	-980.242,13	-417.510,43
					7.888.711,62	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	18.425.613,89	0,00	0,00	0,00	18.619.344,45	193.730,56	931.156,45
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	15.995.959,68	0,00	0,00	0,00	15.987.036,46	-8.923,22	840.826,19
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.173.478,58	0,00	0,00	0,00	1.173.785,18	306,60	56.970,09
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	12.309.476,40	0,00	-1.074.935,75	0,00	11.260.058,58	25.517,93	578.678,01
					47.040.224,67	0,00	0,00

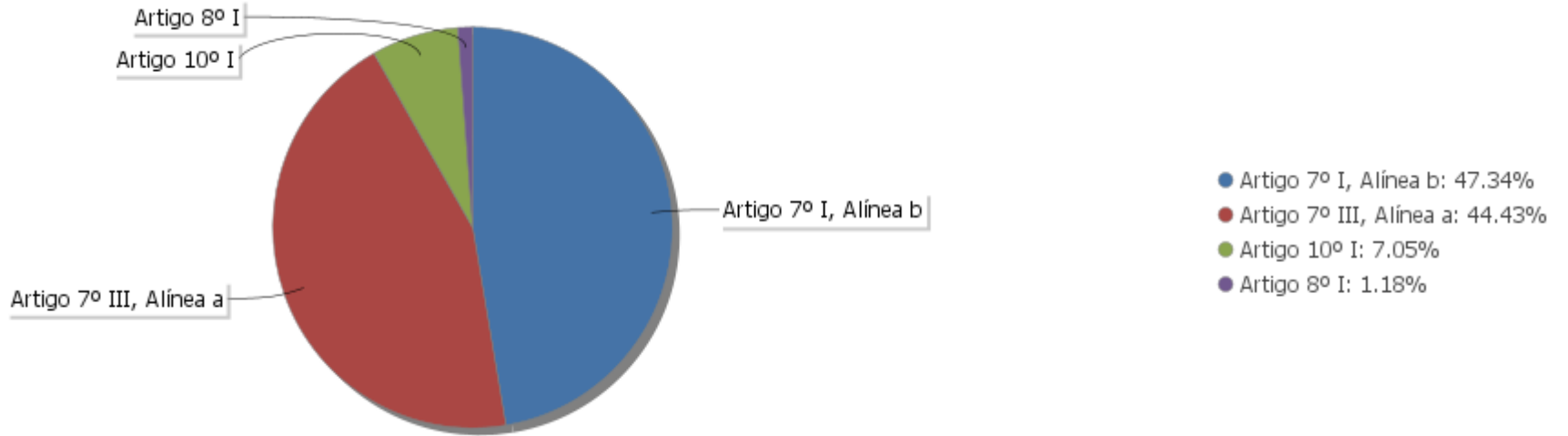
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

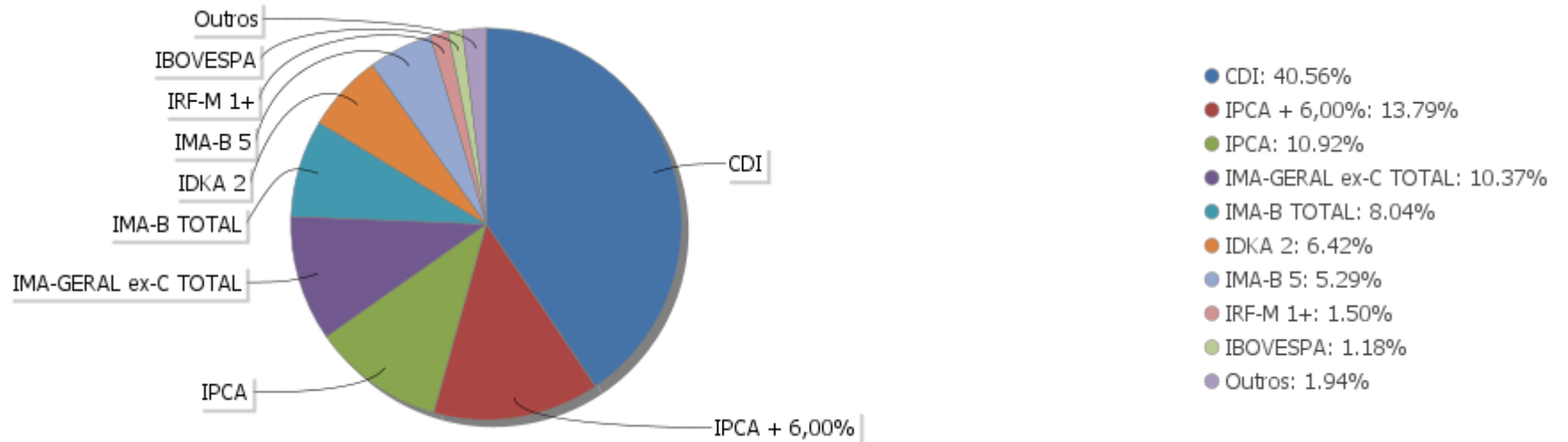
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	575.274.717,43	86,21	575.274.717,43	86,21
de 31 a 365 dias	91.992.655,31	13,79	667.267.372,74	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	667.267.372,74	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

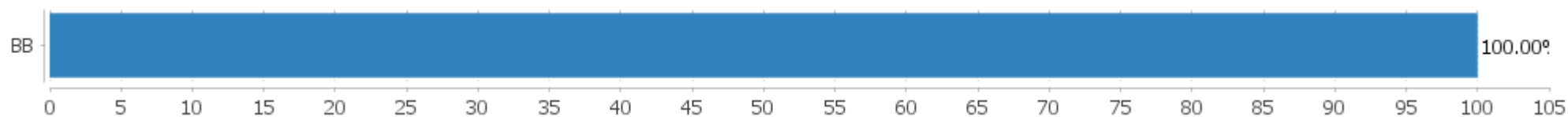


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

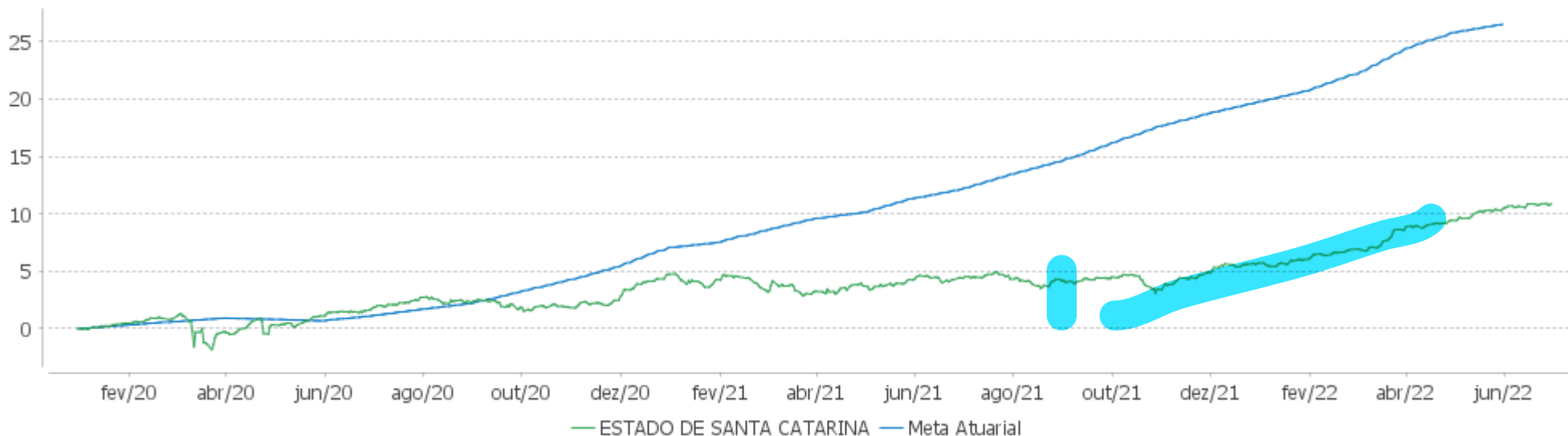
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	0,31	0,78	1,62	0,76	0,95	0,38							4,88
INPC + 1,55%	0,80	1,12	1,85	1,16	0,58								
p.p. indexador	-0,49	-0,33	-0,23	-0,40	0,36								
2021	-0,44	-0,71	-0,27	0,46	0,49	0,18	-0,09	-0,16	0,17	-0,87	1,43	0,77	0,94
IPCA + 2,89%	0,48	1,07	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

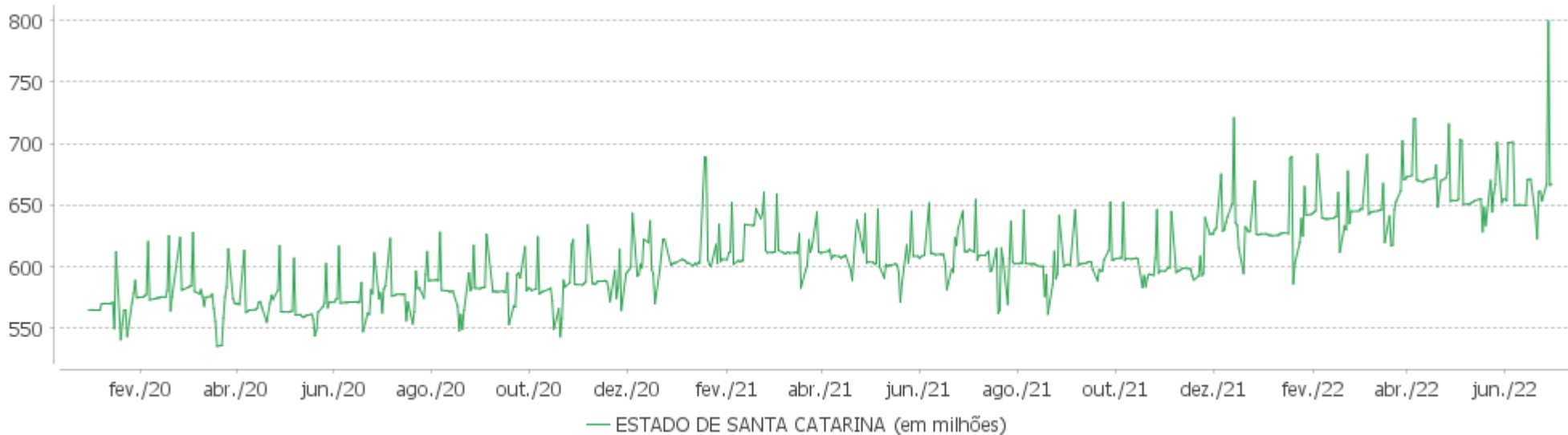
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	24,14	03 meses	2,10			1,39
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	75,86	06 meses	4,88			1,44
			12 meses	6,19			1,78
			24 meses	9,01			2,00
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12	Desde 31/12/2019	10,88			2,67
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

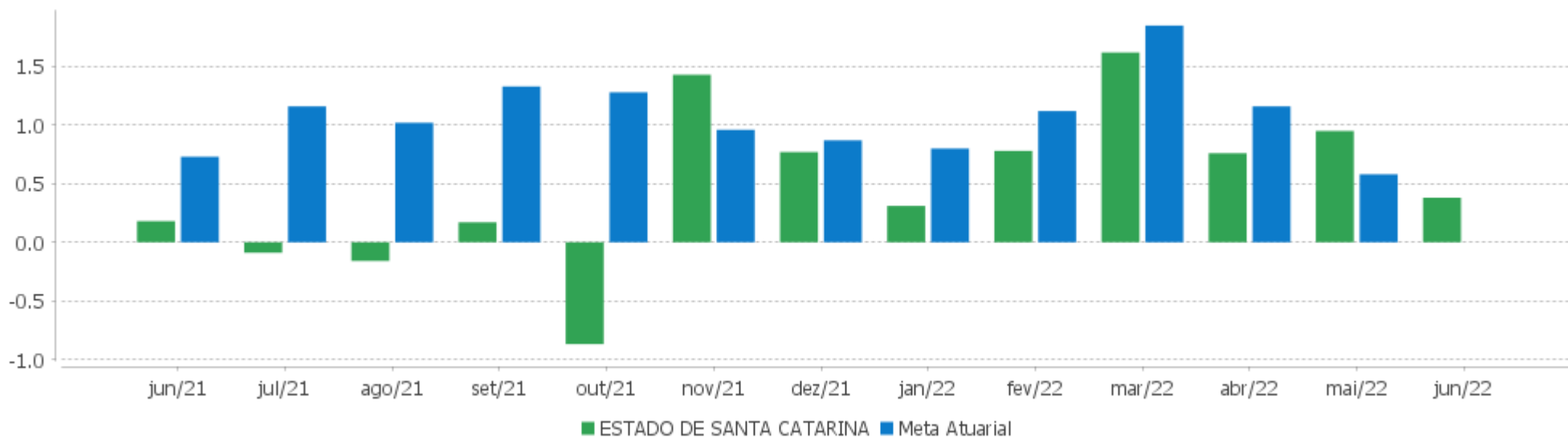


Patrimônio Líquido



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.	0,27 -0,21	6,46 -0,39	2,54 -0,31	6,46 -0,39	9,84 -0,26	16,85 -1,03	26,41 -1,81
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	0,01 -0,08	0,68 -0,06	-0,13 -0,07	0,68 -0,06	-1,28 -0,26	-2,63 -0,52	8,24 -1,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,33	3,71	1,67	3,71	4,01	6,69	13,42
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,33 -0,58	7,12 -1,16	3,08 -0,35	7,12 -1,16	10,31 -8,00	16,86 -18,99	28,75 -18,34
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,01	4,85 -0,14	2,56 -0,09	4,85 -0,14	6,92 -0,27	8,69 -0,68	14,89 -1,05
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,02	6,47 -0,14	2,63 -0,06	6,47 -0,14	9,74 -0,33	16,08 -0,66	26,05 -0,98
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,35 0,01	4,22 -0,13	1,41 -0,02	4,22 -0,13	3,48 -0,29	10,88 -0,60	16,14 -0,86
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,34 -0,03	2,11 -0,08	0,81 -0,02	2,11 -0,08	1,51 -0,25	1,42 -0,49	11,06 -0,85
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,10 -0,00	1,85 -0,18	0,04 -0,08	1,85 -0,18	-2,48 -0,32	5,42 -0,75	7,40 -0,87
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,03 101,22	5,54 102,62	2,90 99,83	5,54 102,62	8,98 103,80	11,54 103,80	16,07 98,90
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,93 91,99	4,87 90,16	2,63 90,64	4,87 90,16	7,48 86,44	8,72 78,45	12,53 77,09
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,46 0,04	4,30 -0,93	2,02 0,06	4,30 -0,93	5,27 -6,34	8,66 -12,27	
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-11,05 0,45	-5,03 0,97	-15,73 2,15	-5,03 0,97	-22,86 -0,58	2,62 -1,04	-6,35 -3,95
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	0,03 2,58	5,10 94,44	1,73 59,50	5,10 94,44	5,87 67,82	9,14 82,15	
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	0,21 21,19	4,93 91,27	2,03 69,86	4,93 91,27	7,29 84,23	9,81 88,20	16,00 98,46
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	1,05 103,74	5,26 97,46	2,81 96,69	5,26 97,46	8,48 98,02	12,36 111,17	17,79 109,44
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	-0,06	5,55	1,91	5,55	6,73	10,54	16,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-5,50	102,78	65,82	102,78	77,74	94,79	99,57
ESTADO DE SANTA CATARINA Var. INPC + 1,55% p.p.	0,38	4,88	2,10	4,88	6,19	9,01	
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%							
IPCA + 6,00%	0,91	8,29	3,44	8,29	18,31	35,84	47,10

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 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 base no 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 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	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	0,73	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	2,19	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	2,03	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	4,49	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	6,85	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,61	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-5,72	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-5,71	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-19,69	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
IFIX	-0,88	-0,33	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78
Índice Consumo - ICON	-14,29		-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	4,58	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

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	0,42	5,23	1,96	5,23	11,61	20,93	23,51	27,66	33,27
INPC									
IGPM	0,59	8,16	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

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	1,47	-25,45	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-25,79	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,75	7,28	2,95	7,28	16,08	30,78	38,93	49,28	61,99
IPCA + 5,00%	0,83	7,78	3,20	7,78	17,19	33,30	42,97	55,09	69,89
IPCA + 5,50%	0,87	8,04	3,32	8,04	17,75	34,57	45,03	58,05	73,96
IPCA + 5,89%	0,90	8,23	3,41	8,23	18,19	35,56	46,64	60,40	77,18
IPCA + 6,00%	0,91	8,29	3,44	8,29	18,31	35,84	47,10	61,06	78,10
INPC + 4,00%									
INPC + 6,00%									

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1566	01/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.155,44	0,00	1.390,37030000	2,2694961190
1581	01/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.031,27	8.385,68078600	2,2694961190
1567	02/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.464,90	1.526,06211200	2,2704842570
1582	02/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	159.208,92	70.121,12923000	2,2704842570
1612	02/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	22.288,26	0,00	9.816,52259000	2,2704842570
1633	02/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.375.266,35	1.046.149,66726900	2,2704842570
1645	02/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	848.122,14	0,00	373.542,40065000	2,2704842570
1568	03/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.238.264,09	1.425.632,28510000	2,2714581620
1583	03/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	49.974.466,77	0,00	22.001.050,95750300	2,2714581620
1569	06/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	25,45	0,00	11,19932700	2,2724579600
1584	06/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	325.011,93	0,00	143.022,19698700	2,2724579600
1613	06/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	284.291,85	125.103,23843400	2,2724579600
1545	07/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.342.567,15	0,00	1.470.269,13915800	2,2734389650
1570	07/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	110.319,85	48.525,53849000	2,2734389650
1585	07/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	53.108.856,83	23.360.581,76516800	2,2734389650
1603	07/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	282.083,90	124.078,06162500	2,2734389650
1614	07/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	322.477,34	141.845,61141300	2,2734389650
1623	07/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	58.502,96	25.733,24417400	2,2734389650
1634	07/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	124.408,90	54.722,77985700	2,2734389650
1586	08/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	44.223,43	0,00	19.443,77160400	2,2744265310
1552	09/06/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	35.680,55	12.236,53352300	2,9159034630
1553	09/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	35.680,55	0,00	15.680,87014200	2,2754190090
1557	09/06/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	21.742.488,84	7.456.518,74781300	2,9159034630
1558	09/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	21.742.488,84	0,00	9.555.378,04422000	2,2754190090
1562	09/06/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	283.078,30	97.080,82039500	2,9159034630
1563	09/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	283.078,30	0,00	124.407,10870400	2,2754190090
1587	09/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.437,67	0,00	1.950,26497600	2,2754190090
1632	09/06/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	8.423.827,03	2.888.925,21132100	2,9159034630

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1635	09/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	8.423.827,03	0,00	3.702.099,26025900	2,2754190090
1550	10/06/2022	BB PREV RF IRF M	0,00	35.103,11	5.736,65479200	6,1190911380
1554	10/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	35.103,11	0,00	15.420,50268600	2,2763920680
1560	10/06/2022	BB PREV RF IRF M	0,00	278.497,10	45.512,82048500	6,1190911380
1564	10/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	278.497,10	0,00	122.341,44720200	2,2763920680
1571	10/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.159,00	1.827,01392200	2,2763920680
1588	10/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	8.170,99	0,00	3.589,44758000	2,2763920680
1630	10/06/2022	BB PREV RF IRF M	0,00	8.333.124,36	1.361.823,86710700	6,1190911380
1636	10/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	8.333.124,36	0,00	3.660.671,84873000	2,2763920680
1572	13/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	16.156,24	0,00	7.094,20237400	2,2773863990
1589	13/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	397,25	174,43241100	2,2773863990
1551	14/06/2022	BB PREV RF IPCA	86.297,27	0,00	31.302,13300700	2,7569134020
1555	14/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	86.297,27	37.876,64538800	2,2783767970
1556	14/06/2022	BB PREV RF IPCA	22.115.277,16	0,00	8.021.752,56718400	2,7569134020
1559	14/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.115.277,16	9.706.593,39101400	2,2783767970
1561	14/06/2022	BB PREV RF IPCA	583.385,13	0,00	211.608,07212000	2,7569134020
1565	14/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	583.385,13	256.052,96313000	2,2783767970
1573	14/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	5.937,05	0,00	2.605,82446500	2,2783767970
1590	14/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	338.078,77	0,00	148.385,80275400	2,2783767970
1631	14/06/2022	BB PREV RF IPCA	16.756.951,39	0,00	6.078.156,60000100	2,7569134020
1637	14/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.756.951,39	7.354.776,17752442	2,2783767970
1546	15/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	5.430,48	0,00	2.382,44918800	2,2793686540
1574	15/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	43.090,19	18.904,44089600	2,2793686540
1591	15/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	20.293.636,34	0,00	8.903.183,03903400	2,2793686540
1610	15/06/2022	BB PREV MULTIMERCADO FI LP	0,00	1.074.935,75	337.169,15885000	3,1881200450
1592	17/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.455,95	0,00	1.077,00376200	2,2803541500
1575	20/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.285.562,42	2.755.167,68977400	2,2813719990
1593	20/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.157.372,42	10.150.634,10533300	2,2813719990
1604	20/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	67.515,42	29.594,21787800	2,2813719990
1611	20/06/2022	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	3.085.748,61	899.316,00827500	3,4312172600

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1615	20/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.999.938,79	0,00	1.314.971,33799900	2,2813719990
1624	20/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.174,60	7.089,85645800	2,2813719990
1638	20/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.498,39	1.971,79153700	2,2813719990
1576	21/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	856,87	0,00	375,41971100	2,2824320980
1594	21/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	48.311,22	0,00	21.166,55301200	2,2824320980
1616	21/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.717.260,17	9.953.093,53995900	2,2824320980
1622	21/06/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	4.500.000,00	2.851.357,03732500	1,5781959050
1625	21/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.243.178,85	0,00	4.049.705,95098900	2,2824320980
1547	22/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.592,93	1.135,52812700	2,2834573080
1595	22/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	285.559,68	0,00	125.055,84361000	2,2834573080
1605	22/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	17.737.058,03	0,00	7.767.632,86436700	2,2834573080
1617	22/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	33.588.622,55	0,00	14.709.546,98050300	2,2834573080
1626	22/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.908.265,34	3.025.353,40415500	2,2834573080
1639	22/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.626.455,34	2.901.939,66700600	2,2834573080
1548	23/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	128,96	0,00	56,45063600	2,2844738170
1596	23/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	338.636,79	148.234,04299100	2,2844738170
1597	24/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.591,76	0,00	696,44844900	2,2855388680
1598	24/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.325,68	580,02951500	2,2855388680
1606	24/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.737.058,03	7.760.558,47412500	2,2855388680
1640	24/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	923,77	0,00	404,18039300	2,2855388680
1644	24/06/2022	BB PREV IRF-M 1+	10.000.000,00	0,00	8.753.759,34681400	1,1423663370
1549	27/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.347.997,64	1.464.197,39555600	2,2865753280
1577	27/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.329.159,03	0,00	4.079.970,12639800	2,2865753280
1599	27/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.644.345,19	1.156.465,37318000	2,2865753280
1607	27/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	10.563.025,91	0,00	4.619.583,61076100	2,2865753280
1618	27/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	472.962,93	206.843,36273900	2,2865753280
1627	27/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	133.710,02	0,00	58.476,10545000	2,2865753280
1641	27/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	47.364,55	0,00	20.714,18746600	2,2865753280
1578	28/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	756.576,24	330.728,97448100	2,2876019290
1600	28/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	134.925.467,99	0,00	58.981.182,99322300	2,2876019290

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1608	28/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.089.342,05	476.193,88504200	2,2876019290
1619	28/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.031.173,49	0,00	450.766,13939100	2,2876019290
1628	28/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	408.028,23	178.365,04893100	2,2876019290
1642	28/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	762.763,06	333.433,47473600	2,2876019290
1579	29/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.012.290,89	442.311,44224500	2,2886382610
1601	29/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	113.866.186,62	49.752.810,90085700	2,2886382610
1609	29/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.627.497,04	3.332.766,54942700	2,2886382610
1620	29/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.621.299,66	3.330.058,65971500	2,2886382610
1629	29/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.251.158,48	546.682,49732600	2,2886382610
1643	29/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.941.585,36	848.358,34176400	2,2886382610
1580	30/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.755,20	8.191,32532100	2,2896416960
1602	30/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	13.720,27	0,00	5.992,32186500	2,2896416960
1621	30/06/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	350.051,43	0,00	152.884,80752700	2,2896416960
Total			384.207.717,47	374.151.724,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.587.948,29

Value-At-Risk: 0,69%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ESTADO DE SANTA CATARINA		0,69	0,69			667.267.372,74	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,69%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,26	0,00	0,01			5.607.150,15	0,84
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,15	0,17	0,03			53.626.046,11	8,04
BB PREV RF IDKA2		1,29	0,08	0,28			42.816.660,30	6,42
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,69	0,04	0,10			7.356.188,45	1,10
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,14	0,06	0,03			35.287.121,09	5,29
BB PREV RF IPCA		0,91	0,08	0,88			91.992.655,31	13,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,02	0,10	1,02			69.223.292,62	10,37
BB PREV IRF-M 1+		2,33	0,02	0,07			9.984.627,30	1,50
Sub-total	2,48	1,15	0,54		-0,33	0,19	315.893.741,33	47,34

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		0,03	0,00	0,02			103.159.551,89	15,46
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	-0,00	0,01			120.416.693,87	18,05
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,81	0,08	0,81			72.868.449,36	10,92
Sub-total	0,42	0,20	0,08		-0,36	0,86	296.444.695,12	44,43

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,39%

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		0,41	0,00	0,42			11.260.058,58	1,69
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI		0,15	-0,00	0,16			18.619.344,45	2,79
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI		0,89	0,00	0,89			15.987.036,46	2,40
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI		0,82	0,00	0,82			1.173.785,18	0,18
Sub-total	0,74	0,39	0,01		-0,78	0,44	47.040.224,67	7,05

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,10%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		10,10	0,06	1,98			7.888.711,62	1,18
Sub-total	19,12	10,10	0,06		-0,63	-11,05	7.888.711,62	1,18