



**LDB**  
EMPRESAS

**ESTADO DE SANTA CATARINA**  
JUNHO 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 30.06.2023.

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

98,77%

#### 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	2,48	0,36	1,80	8,76	133.481.847,55	17,97	5.696.060.085,44	2,34
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,07	1,16	6,49	42.085.344,63	5,66	6.781.214.720,11	0,62
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,28	0,74	2,37	11,28	160.215.376,72	21,57	6.493.608.770,37	2,47
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,60	0,17	1,02	6,56	46.854.086,44	6,31	6.483.473.627,64	0,72
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,27	1,11	3,31	14,66	8.525.370,26	1,15	1.191.739.626,46	0,72
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,41	0,23	1,03	6,99	38.832.002,02	5,23	5.638.426.224,35	0,69
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	5,18	0,41	2,63	11,17	11.804.088,91	1,59	281.723.115,24	4,19
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,47</b>	<b>0,45</b>	<b>1,85</b>	<b>8,66</b>	<b>441.798.116,53</b>	<b>59,47</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	1,09	6,44	128.547.535,09	17,30	14.982.085.274,92	0,86
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,00	5,98	163.397.079,89	21,99	4.278.810.513,26	3,82
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,50</b>	<b>0,05</b>	<b>1,04</b>	<b>6,20</b>	<b>291.944.614,98</b>	<b>39,30</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,56</b>	<b>0,29</b>	<b>1,55</b>	<b>7,77</b>	<b>733.742.731,51</b>	<b>98,77</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,23%

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	20,21	-0,39	8,37	6,56	9.174.671,49	1,23	326.744.018,15	2,81
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>20,21</b>	<b>-0,39</b>	<b>8,37</b>	<b>6,56</b>	<b>9.174.671,49</b>	<b>1,23</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>20,21</b>	<b>-0,39</b>	<b>8,37</b>	<b>6,56</b>	<b>9.174.671,49</b>	<b>1,23</b>		
<b>Total</b>			<b>1,63</b>	<b>0,28</b>	<b>1,63</b>	<b>7,72</b>	<b>742.917.403,00</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	441.798.116,53	59,47	0,00	44,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	291.944.614,98	39,30	0,00	43,00	70,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>733.742.731,51</b>	<b>98,77</b>					<b>100,00</b>
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.174.671,49	1,23	0,00	3,00	40,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>9.174.671,49</b>	<b>1,23</b>					<b>30,00</b>
<b>Total</b>		<b>742.917.403,00</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	1,85 172,42	8,66 133,24	4,73 150,34	8,66 133,24	12,51 92,35	8.198.136,96	36.503.836,78
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,04 97,33	6,20 95,38	3,03 96,40	6,20 95,38	12,56 92,71	2.757.742,49	15.882.188,52
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,37 -0,63	6,56 -1,05	13,83 -2,07	6,56 -1,05	16,30 -3,53	708.855,64	565.082,92
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	3,54 54,46	0,59 18,85	3,54 54,46	9,35 69,01	0,00	1.343.005,22
<b>ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)</b>						<b>11.664.735,09</b>	<b>54.294.113,44</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+	11.501.817,38	0,00	0,00	0,00	11.804.088,91	302.271,53	1.186.135,17
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	160.922.324,03	0,00	-30.000.000,00	0,00	133.481.847,55	2.559.523,52	12.846.129,08
BB PREV RF IDKA2	46.381.228,86	0,00	0,00	0,00	46.854.086,44	472.857,58	2.885.290,08
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	156.503.033,41	0,00	0,00	0,00	160.215.376,72	3.712.343,31	9.228.251,72
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	38.435.762,40	0,00	0,00	0,00	38.832.002,02	396.239,62	2.536.867,69
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.252.476,64	0,00	0,00	0,00	8.525.370,26	272.893,62	1.090.259,30
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	41.603.336,85	0,00	0,00	0,00	42.085.344,63	482.007,78	1.719.851,59
					441.798.116,53	8.198.136,96	

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	121.671.790,06	252.331.558,41	-211.974.766,17	0,00	163.397.079,89	1.368.497,59	7.974.191,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	127.158.290,19	0,00	0,00	0,00	128.547.535,09	1.389.244,90	7.907.996,56
					291.944.614,98	2.757.742,49	

## 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	8.465.815,85	0,00	0,00	0,00	9.174.671,49	708.855,64	565.082,92
					9.174.671,49	708.855,64	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

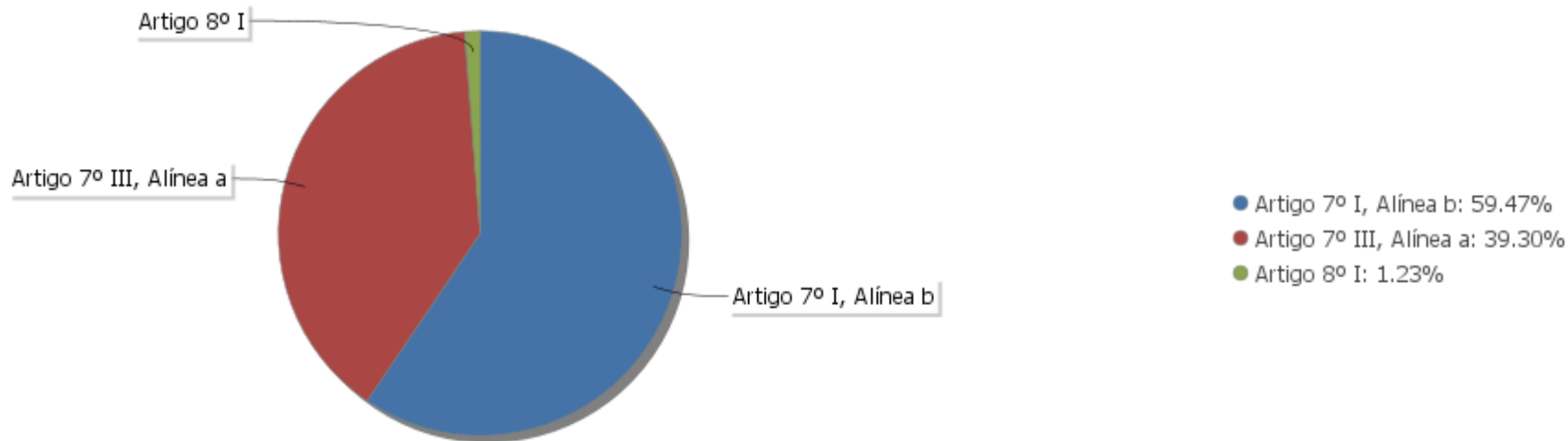
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	742.917.403,00	100,00	742.917.403,00	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	742.917.403,00	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	742.917.403,00	100,00	

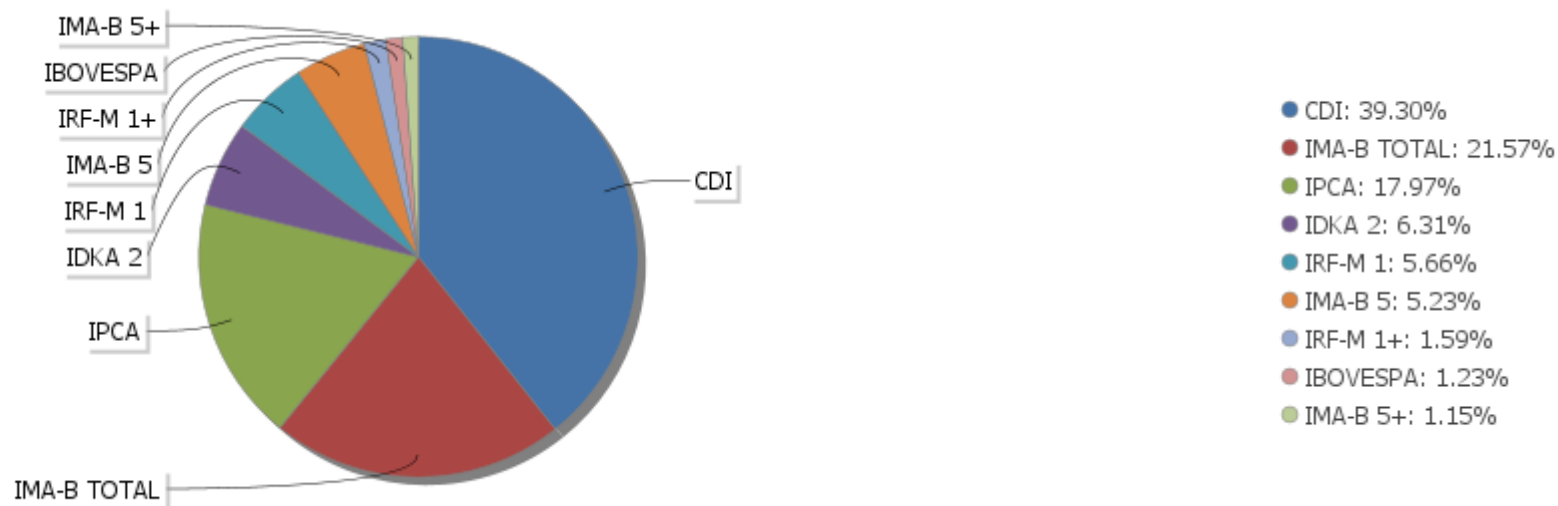


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

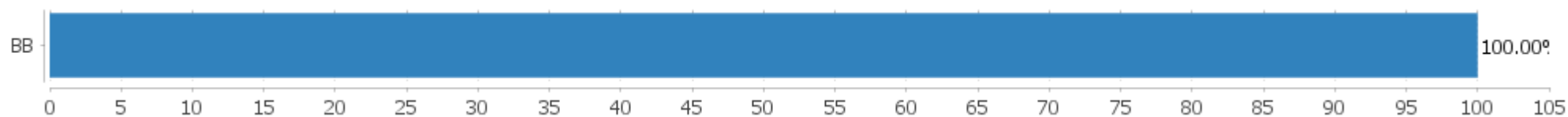


Alocação Por Estratégia



## 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
2023	0,99	0,88	1,43	1,09	1,47	1,63							7,72
INPC + 1,72% p.p. indexador	0,61	0,89	0,80	0,65	0,51	0,04							3,55
	0,38	-0,02	0,63	0,44	0,96	1,59							4,17
2022	0,31	0,78	1,62	0,76	0,95	0,38	0,49	0,97	0,92	1,32	0,22	0,76	9,89
INPC + 1,55% p.p. indexador	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
	-0,49	-0,33	-0,23	-0,40	0,36	-0,37	0,96	1,14	1,11	0,73	-0,28	-0,06	2,32
2021	-0,44	-0,71	-0,27	0,46	0,49	0,18	-0,09	-0,16	0,17	-0,87	1,43	0,77	0,94
IPCA + 2,89% p.p. indexador	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
	-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% p.p. indexador	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
	-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

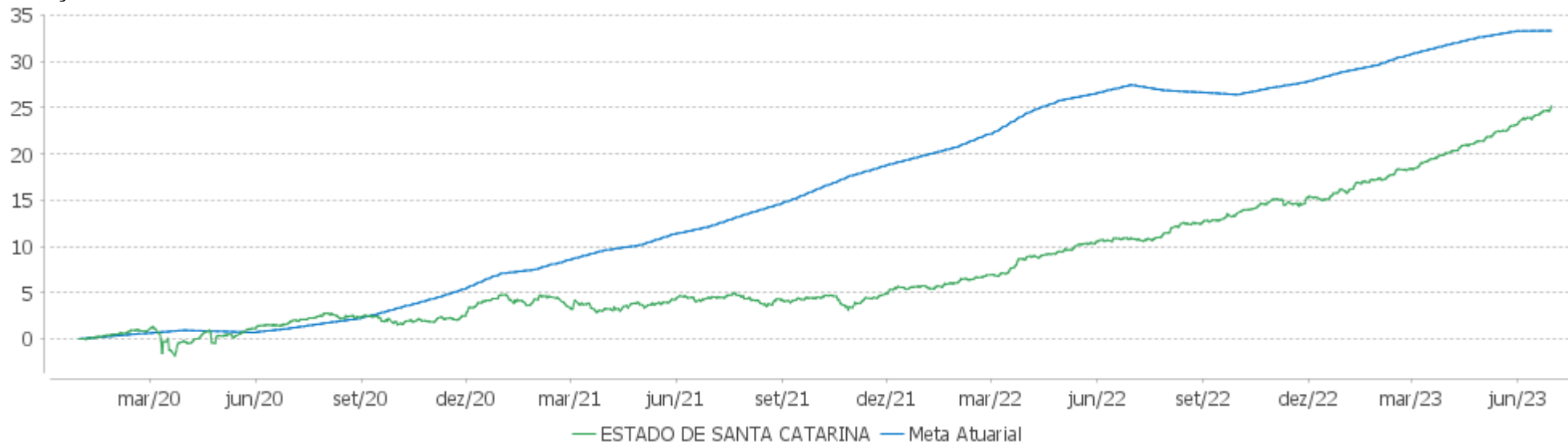
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

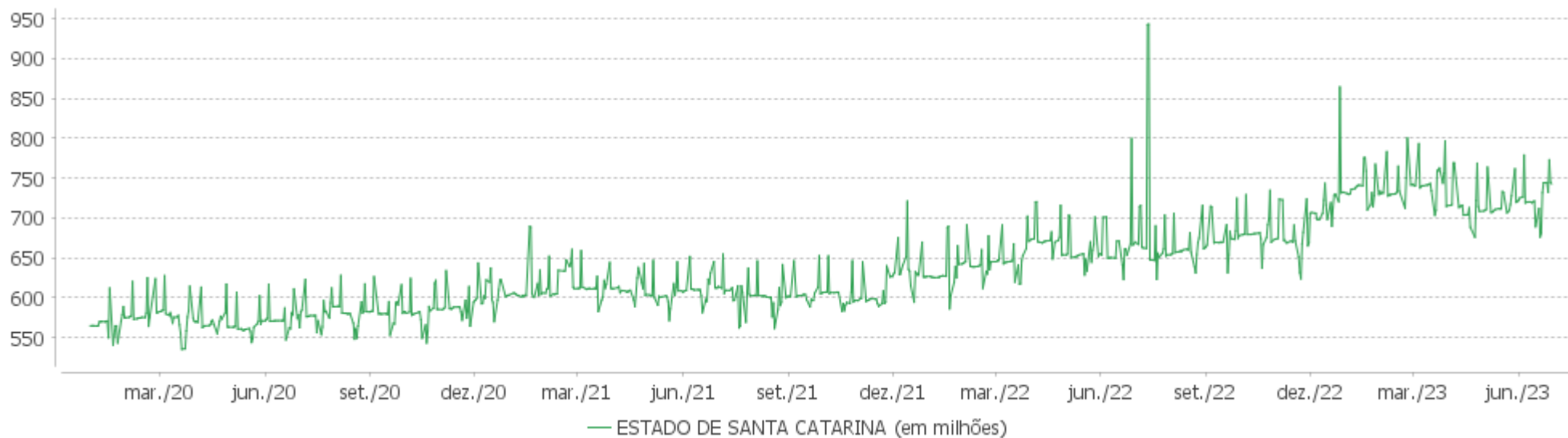
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	38,10	03 meses	4,25	1,21	3,04	1,29
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	61,90	06 meses	7,72	3,55	4,17	1,39
			12 meses	12,86	4,68	8,19	1,63
			24 meses	19,85	19,87	-0,02	1,72
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12	36 meses	23,03	33,79	-10,76	1,90
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03	Desde 31/12/2019	25,15	35,97	-10,82	2,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

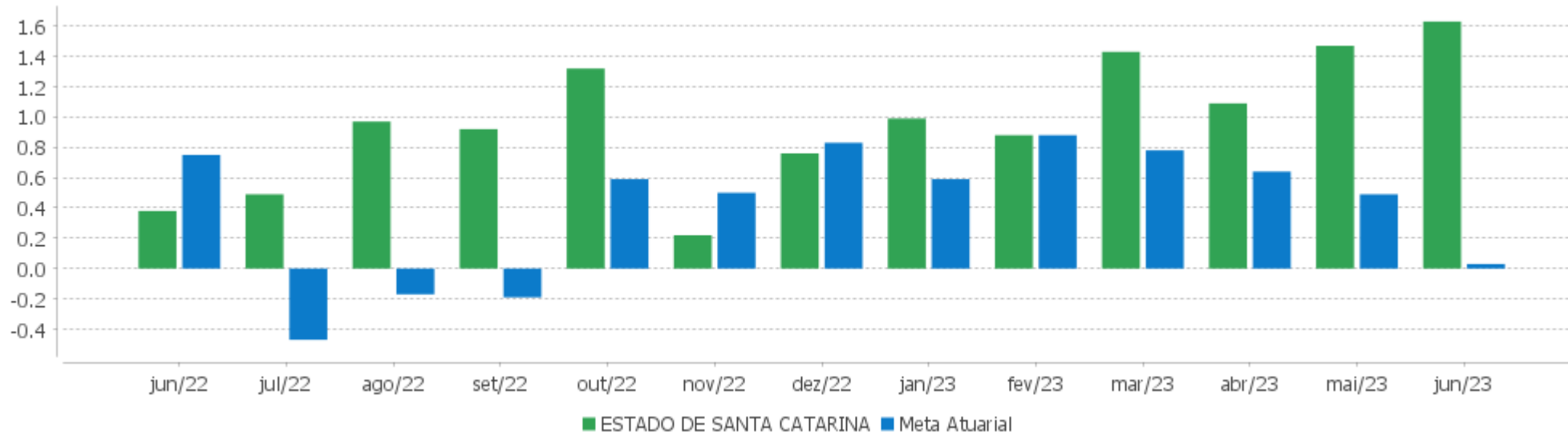


Patrimônio Líquido



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.	1,02 0,05	6,56 -0,22	2,10 0,11	6,56 -0,22	9,43 0,15	20,20 -0,12	27,87 -0,96
BB PREV IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	2,63 -0,02	11,17 -0,24	6,84 -0,05	11,17 -0,24	18,22 -0,58	16,71 -0,88	15,12 -1,19
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,49 -0,18	3,14 -0,08	6,49 -0,18	13,48 -0,34	21,33 -0,67	23,34 -1,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,99 -0,05	2,56 0,01	6,99 -0,05	10,05 -0,18	20,76 -0,56	27,74 -0,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,80 1,88	8,76 5,89	5,04 4,28	8,76 5,89	13,97 10,81	19,98 4,55	23,84 -1,22
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,28 -0,09	7,11 0,01	11,28 -0,09	13,29 -0,24	17,23 -0,58	25,61 -0,95
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	3,31 -0,06	14,66 -0,24	10,79 -0,12	14,66 -0,24	15,89 -0,44	13,02 -0,81	22,18 -1,34
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,92	6,44 99,04	3,16 100,55	6,44 99,04	13,54 99,98	23,74 101,59	26,65 101,82
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,00 93,03	5,98 92,01	2,90 92,23	5,98 92,01	12,44 91,84	20,85 89,21	22,25 85,01
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,37 -0,63	6,56 -1,05	13,83 -2,07	6,56 -1,05	16,30 -3,53	-10,29 -3,42	19,35 -4,88
ESTADO DE SANTA CATARINA Var. INPC + 1,55% p.p.	1,63 1,59	7,72 4,17	4,25 3,04	7,72 4,17	12,86 8,10	19,85 0,58	23,03 -9,47
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2737	01/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.292,33	0,00	898,86823100	2,5502403130
2751	01/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	849,66	0,00	333,16860200	2,5502403130
2681	01/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.168,28	0,00	6.732,02439400	2,5502403130
2697	01/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	6.000,84	0,00	2.353,04883500	2,5502403130
2738	02/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	214.912,54	0,00	84.231,64977200	2,5514464050
2759	02/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	441.750,01	0,00	173.137,09162500	2,5514464050
2698	02/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	807.785,61	0,00	316.599,08999735	2,5514464050
2719	02/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	495.351,24	0,00	194.145,26561454	2,5514464050
2673	05/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	293,25	0,00	114,88019900	2,5526592180
2699	05/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	60.362,48	0,00	23.646,90107200	2,5526592180
2674	06/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.058,55	0,00	1.589,18953816	2,5538489290
2682	06/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	14.847,26	0,00	5.813,67982700	2,5538489290
2700	06/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	51.481.873,18	0,00	20.158.542,89398300	2,5538489290
2739	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	765,95	0,00	299,78020800	2,5550385840
2752	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.009.330,11	1.569.185,73954500	2,5550385840
2675	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.236.891,65	0,00	2.049.633,09861312	2,5550385840
2683	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.089,89	9.037,00247200	2,5550385840
2701	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	59.626.655,72	23.336.890,52423400	2,5550385840
2720	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	292.285,41	114.395,69321197	2,5550385840
2702	09/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	55.758,29	0,00	21.812,49308664	2,5562547930
2760	12/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.967,18	0,00	769,19012200	2,5574691390
2703	12/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	31.329,06	0,00	12.250,02465200	2,5574691390
2740	13/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	929,58	0,00	363,30807300	2,5586549460
2704	13/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	16.208,79	0,00	6.334,88701700	2,5586549460
2727	14/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	29.705.568,83	0,00	11.604.438,41499000	2,5598454460
2736	14/06/2023	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	30.000.000,00	23.807.021,10587728	1,2601324570
2741	14/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	133.617,81	52.197,60834000	2,5598454460
2684	14/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.473,00	575,42536500	2,5598454460

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2705	14/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	312.773,15	0,00	122.184,38831482	2,5598454460
2706	14/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.619,62	2.195,29659800	2,5598454460
2676	15/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	410,00	0,00	160,09098700	2,5610436080
2685	15/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.407,83	0,00	6.797,16266600	2,5610436080
2707	15/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	29.590,51	0,00	11.554,08283800	2,5610436080
2728	16/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	32.613.554,47	12.728.311,00490700	2,5622845370
2742	16/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.213,28	863,79165500	2,5622845370
2677	16/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	24,70	0,00	9,63983400	2,5622845370
2686	16/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	55,00	21,46521900	2,5622845370
2708	16/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	25.218,53	0,00	9.842,20512431	2,5622845370
2743	19/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	619,72	241,74403000	2,5635379740
2687	19/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	86.080,88	33.578,93695100	2,5635379740
2709	19/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	22.649.645,11	0,00	8.835.307,04039400	2,5635379740
2744	20/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.057,09	6.260,63012800	2,5647721830
2753	20/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.457.178,37	1.347.947,54595200	2,5647721830
2678	20/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17,59	0,00	6,85830800	2,5647721830
2688	20/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.926.837,38	2.700.761,27069400	2,5647721830
2710	20/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	25.723.583,34	10.029.578,26449700	2,5647721830
2721	20/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	66.955,88	26.105,97558900	2,5647721830
2745	21/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	11.170.048,06	0,00	4.353.141,55780490	2,5659740010
2754	21/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.624.098,76	2.971.229,93336200	2,5659740010
2689	21/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	18.455,74	0,00	7.192,48908711	2,5659740010
2711	21/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	366.762,60	0,00	142.933,09279715	2,5659740010
2729	22/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	38.818.267,88	0,00	15.121.059,14001355	2,5671659320
2746	22/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.749.067,00	3.408.064,46943800	2,5671659320
2690	22/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	55,00	0,00	21,42440300	2,5671659320
2712	22/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	45.215,51	0,00	17.613,00640300	2,5671659320
2722	22/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.444.028,18	0,00	7.963.656,70218700	2,5671659320
2730	23/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.282,79	0,00	499,45894100	2,5683592670
2755	23/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	11.631.422,62	0,00	4.528.736,60217500	2,5683592670

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2713	23/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	24.022,58	0,00	9.353,27868900	2,5683592670
2691	26/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.800,20	1.868,09728100	2,5695663970
2714	26/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.273,03	0,00	1.273,76743556	2,5695663970
2731	27/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.001.939,91	1.167.716,89538900	2,5707771480
2747	27/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	206.905,04	0,00	80.483,46009300	2,5707771480
2692	27/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.867,93	5.783,43790400	2,5707771480
2715	27/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.977.789,13	0,00	1.936.297,40869300	2,5707771480
2723	27/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.302.912,60	5.563.653,23658152	2,5707771480
2732	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.488.335,38	2.133.900,45364400	2,5719734820
2748	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	177.696,30	69.089,47593900	2,5719734820
2756	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.146,98	0,00	1.223,56627004	2,5719734820
2761	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	559,90	0,00	217,69275700	2,5719734820
2679	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.277.273,38	2.051.838,17676700	2,5719734820
2693	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	7.621.933,99	0,00	2.963.457,45527403	2,5719734820
2716	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	39.760.499,53	0,00	15.459.140,54256900	2,5719734820
2724	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.422.557,97	0,00	1.719.519,27224400	2,5719734820
2734	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.796.722,78	1.086.867,55631500	2,5731955690
2749	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.710.837,74	664.868,91265100	2,5731955690
2757	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	484.805,29	188.405,92446200	2,5731955690
2694	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.748,25	0,00	679,40813402	2,5731955690
2695	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	362.478,10	140.866,90664600	2,5731955690
2717	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.934.643,09	8.135.659,54419000	2,5731955690
2725	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.925.919,37	1.137.076,17300800	2,5731955690
2726	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.886.385,46	1.898.062,54479500	2,5744069780
2735	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.050.140,12	0,00	407.915,34865000	2,5744069780
2750	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.619,91	2.182,99206300	2,5744069780
2758	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	11.940,29	0,00	4.638,07397200	2,5744069780
2680	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.446,67	0,00	561,94300700	2,5744069780
2696	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	241.156,00	93.674,38872800	2,5744069780
2718	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	118.004,57	0,00	45.837,57386000	2,5744069780

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
		<b>Total</b>	<b>252.331.558,41</b>	<b>241.974.766,17</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 5.610.687,99

Value-At-Risk: 0,76%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ESTADO DE SANTA CATARINA		0,76	0,76			742.917.403,00	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,72%

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		0,91	0,16	0,92			133.481.847,55	17,97
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,21	0,01	0,01			42.085.344,63	5,66
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,83	0,39	0,04			160.215.376,72	21,57
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,05	0,15			46.854.086,44	6,31
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,37	0,04	0,10			8.525.370,26	1,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,92	0,04	0,03			38.832.002,02	5,23
BB PREV IRF-M 1+		1,79	0,03	0,03			11.804.088,91	1,59
<b>Sub-total</b>	<b>2,70</b>	<b>1,20</b>	<b>0,71</b>		<b>0,29</b>	<b>1,85</b>	<b>441.798.116,53</b>	<b>59,47</b>

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		0,02	0,00	0,02			128.547.535,09	17,30
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			163.397.079,89	21,99
<b>Sub-total</b>	<b>0,01</b>	<b>0,01</b>	<b>0,00</b>		<b>-2,27</b>	<b>1,04</b>	<b>291.944.614,98</b>	<b>39,30</b>

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 8,25%

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		8,25	0,05	1,38			9.174.671,49	1,23

## 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>	15,06	8,25	0,05		0,48	8,37	9.174.671,49	1,23

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

- Conforme demonstrado no quadro Posições de Ativos e Enquadramentos, no fechamento do mês de junho de 2023 o Instituto possuía 21,99% dos seus recursos alocados no fundo: BB PREV RF FLUXO FIC, posição essa superior ao permitido no Art. 18 da Resolução CMN nº 4.963/2021.