



**LDB**  
EMPRESAS

**ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO**  
JUNHO 2024



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 28.06.2024.

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 IRF-M 1+	3,53	-0,41	-0,75	-0,07	12.526.051,06	1,70	313.002.801,12	4,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,61	-0,08	0,38	3,84	132.506.522,96	17,94	6.543.333.888,45	2,03
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,81	-0,51	-0,99	-1,23	82.382.268,42	11,15	4.649.802.742,18	1,77
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	-0,18	0,37	3,20	45.655.954,36	6,18	4.972.766.310,86	0,92
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,97	-0,82	-2,28	-5,21	4.188.643,94	0,57	1.195.654.596,88	0,35
BB	BB	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	0,06	0,04	0,77	5,09	12.024.613,36	1,63	11.444.832.997,29	0,11
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,06	0,04	0,79	5,20	324.531.146,61	43,94	31.640.362.924,77	1,03
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,49</b>	<b>-0,09</b>	<b>0,37</b>	<b>2,86</b>	<b>613.815.200,71</b>	<b>83,10</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 FLUXO FIC	0,06	0,04	0,71	4,71	115.404.136,92	15,62	5.048.562.747,13	2,29
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,06</b>	<b>0,04</b>	<b>0,71</b>	<b>4,71</b>	<b>115.404.136,92</b>	<b>15,62</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,17</b>	<b>-0,07</b>	<b>0,44</b>	<b>3,20</b>	<b>729.219.337,63</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	13,25	-0,37	0,65	-9,36	9.402.809,20	1,27	314.142.041,59	2,99
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>13,25</b>	<b>-0,37</b>	<b>0,65</b>	<b>-9,36</b>	<b>9.402.809,20</b>	<b>1,27</b>		
Renda Variável			13,25	-0,37	0,65	-9,36	9.402.809,20	1,27		
Total			1,26	-0,08	0,44	3,02	738.622.146,83	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	613.815.200,71	83,10	0,00	85,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	115.404.136,92	15,62	0,00	13,00	60,00	0,00	70,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>729.219.337,63</b>	<b>98,73</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.402.809,20	1,27	0,00	2,00	30,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>9.402.809,20</b>	<b>1,27</b>					40,00
<b>Total</b>		<b>738.622.146,83</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	0,37 47,45	2,86 54,76	1,16 45,79	2,86 54,76	8,38 71,69	2.285.042,70	17.014.719,10
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,71 90,19	4,71 90,16	2,27 89,82	4,71 90,16	10,63 90,93	894.226,69	6.676.278,94
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,65 -0,83	-9,36 -1,70	-4,13 -0,85	-9,36 -1,70	2,49 -2,44	60.874,48	-970.860,22
<b>ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>3.240.143,87</b>	<b>22.720.137,82</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+	12.620.818,17	0,00	0,00	0,00	12.526.051,06	-94.767,11	-9.175,50
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	132.001.035,99	0,00	0,00	0,00	132.506.522,96	505.486,97	4.896.584,66
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	83.202.021,49	0,00	0,00	0,00	82.382.268,42	-819.753,07	-1.243.489,19
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	45.485.902,72	0,00	0,00	0,00	45.655.954,36	170.051,64	2.588.175,79
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.286.457,68	0,00	0,00	0,00	4.188.643,94	-97.813,74	-362.131,12
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	11.306.091,97	630.363,00	0,00	0,00	12.024.613,36	88.158,39	449.401,40
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	321.997.466,99	0,00	0,00	0,00	324.531.146,61	2.533.679,62	10.695.353,06
	610.899.795,01	630.363,00	0,00	0,00	613.815.200,71	2.285.042,70	

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	107.452.539,01	325.587.652,93	-318.530.281,71	0,00	115.404.136,92	894.226,69	6.676.278,94
	107.452.539,01	325.587.652,93	-318.530.281,71	0,00	115.404.136,92	894.226,69	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	9.341.934,72	0,00	0,00	0,00	9.402.809,20	60.874,48	-970.860,22
	9.341.934,72	0,00	0,00	0,00	9.402.809,20	60.874,48	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

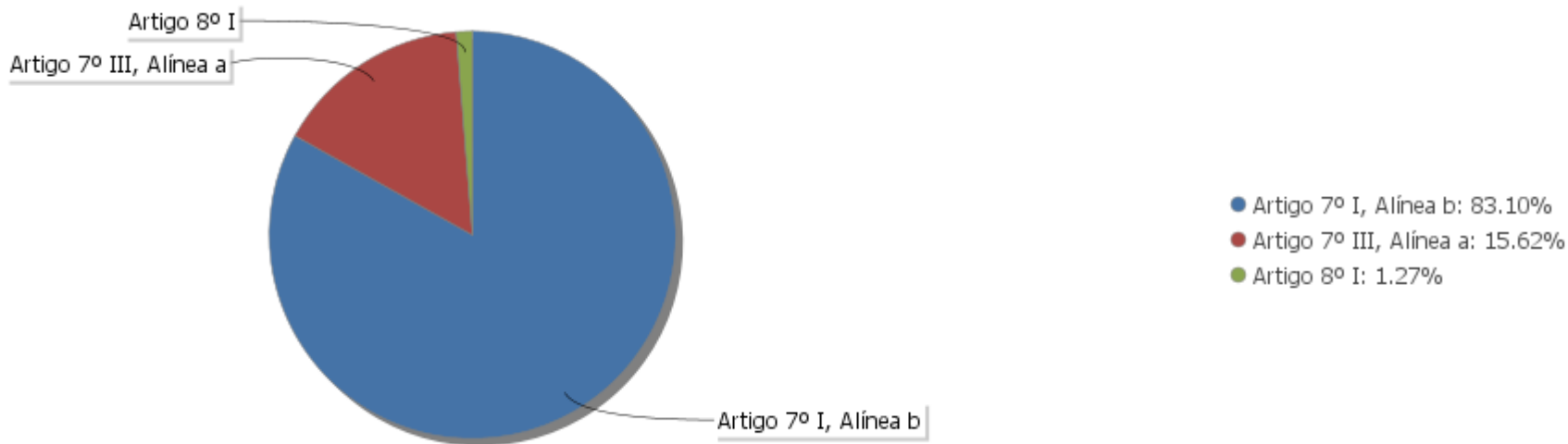
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	738.622.146,83	100,00	80,00	738.622.146,83	100,00	80,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	0,00	738.622.146,83	100,00	80,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	738.622.146,83	100,00	80,00

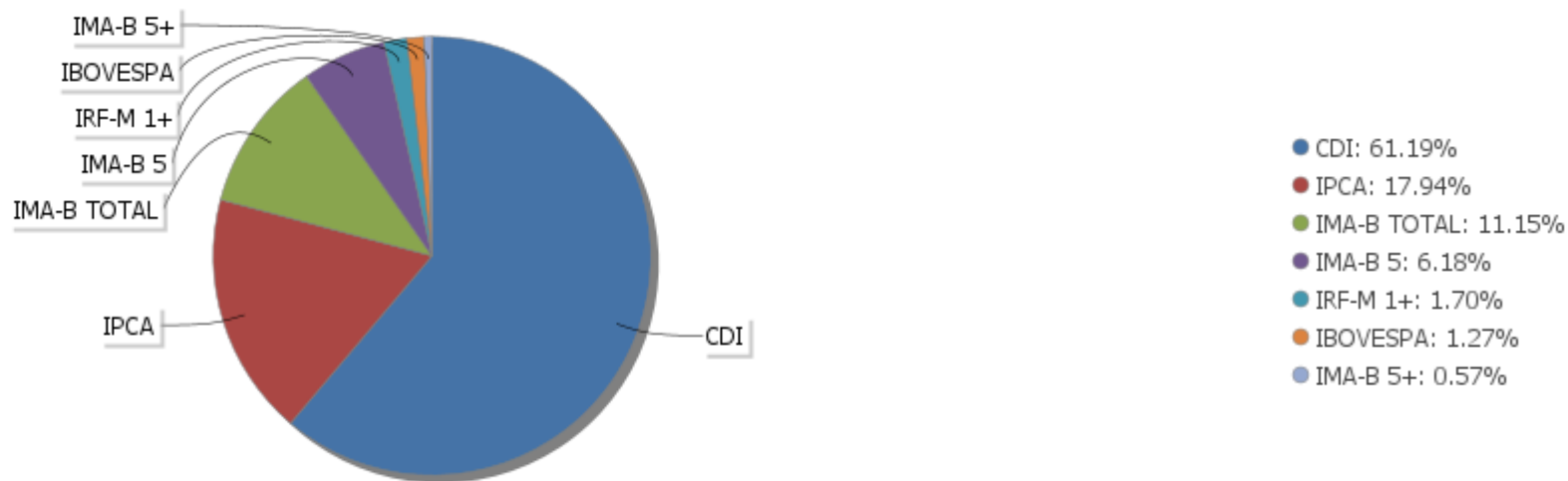


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

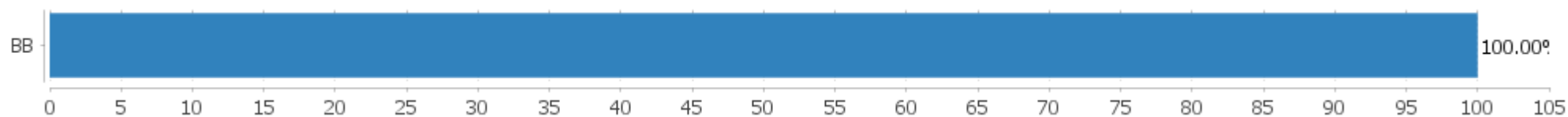


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,46	0,68	0,56	-0,08	0,92	0,44							3,02
INPC + 4,50%	0,96	1,15	0,54	0,76	0,83	0,60							4,93
p.p. indexador	-0,49	-0,47	0,02	-0,83	0,09	-0,16							-1,91
2023	0,99	0,88	1,43	1,09	1,47	1,63	0,94	0,58	0,45	0,33	1,59	1,47	13,62
INPC + 1,72%	0,61	0,89	0,80	0,65	0,51	0,04	0,05	0,36	0,25	0,26	0,24	0,69	5,47
p.p. indexador	0,38	-0,02	0,63	0,44	0,96	1,59	0,88	0,22	0,20	0,07	1,36	0,79	8,15
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%	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
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	24	44,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	55,56

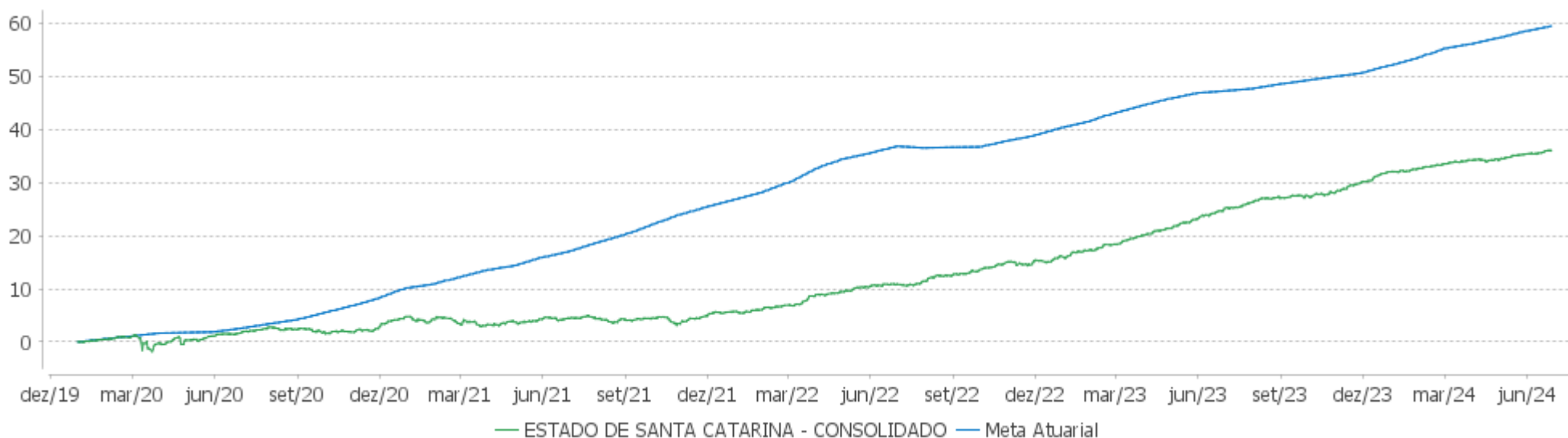
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03

Relatório

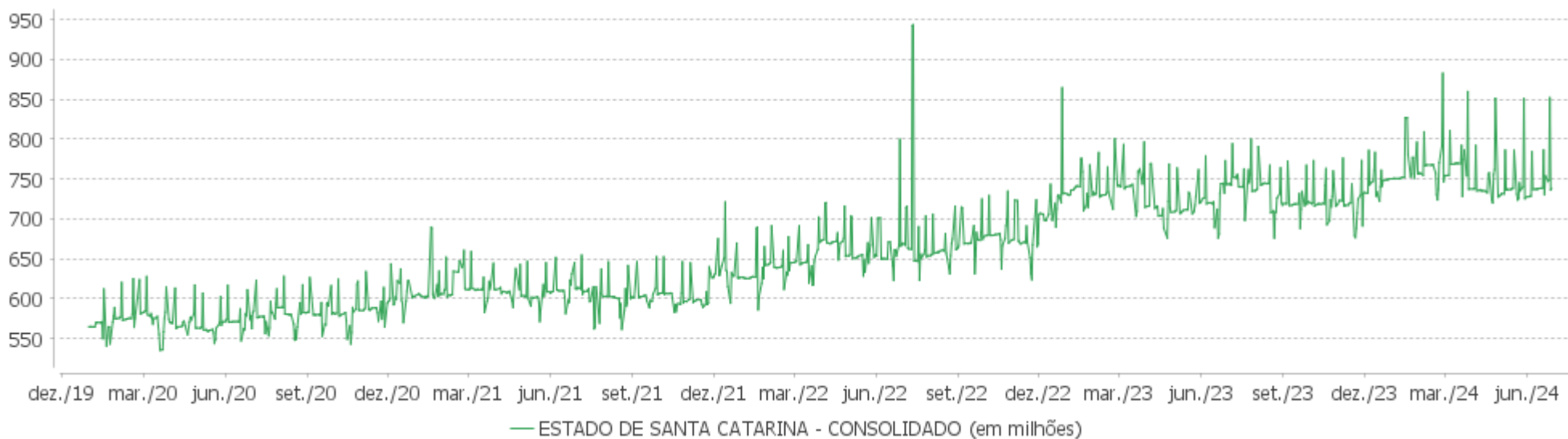
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,29	2,20	-0,92	1,13
06 meses	3,02	4,93	-1,91	0,98
12 meses	8,66	6,87	1,79	1,26
24 meses	22,64	11,86	10,77	1,46
36 meses	30,22	28,10	2,12	1,58
48 meses	33,68	42,98	-9,30	1,76
Desde 31/12/2019	35,98	45,31	-9,33	2,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

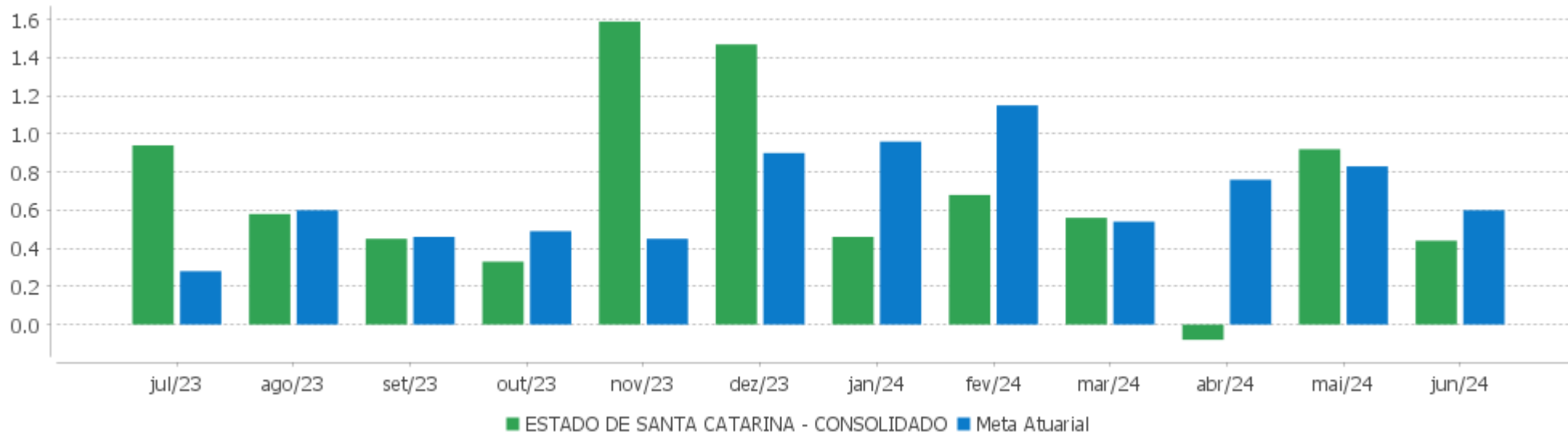


Patrimônio Líquido



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 IRF-M 1+ Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,75 -0,04	-0,07 -0,29	-1,30 -0,16	-0,07 -0,29	6,12 -0,49	25,45 -1,20	23,85 -1,51
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,20 -0,12	1,18 -0,06	3,20 -0,12	7,97 -0,26	18,82 -0,48	30,38 -0,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,38 0,17	3,84 1,35	1,40 0,34	3,84 1,35	9,79 5,56	25,12 17,60	31,72 11,41
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,99 -0,02	-1,23 -0,13	-1,33 -0,06	-1,23 -0,13	2,76 -0,30	16,42 -0,59	20,47 -0,95
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI % do CDI	0,77 97,66	5,09 97,50	2,46 97,23	5,09 97,50	11,39 97,41	26,20 97,70	36,96 97,79
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,79 99,81	5,20 99,52	2,51 99,36	5,20 99,52	11,62 99,35	26,72 99,62	37,80 100,03
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,28 -0,03	-5,21 -0,17	-3,66 -0,07	-5,21 -0,17	-1,73 -0,30	13,89 -0,79	11,06 -1,14
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,71 90,20	4,71 90,16	2,27 89,82	4,71 90,16	10,59 90,55	24,34 90,76	33,64 89,02
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,65 -0,83	-9,36 -1,70	-4,13 -0,85	-9,36 -1,70	2,49 -2,44	19,19 -6,55	-8,06 -5,78
ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO Var. INPC + 4,50% p.p.	0,44 -0,16	3,02 -1,91	1,29 -0,92	3,02 -1,91	8,66 0,35	22,64 6,08	30,22 -6,09
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

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 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 RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10

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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43



### 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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

#### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

#### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

#### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

#### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4078	03/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	741.912,02	262.353,80798100	2,8279064280
4098	03/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	337.582,82	0,00	119.375,52694724	2,8279064280
4116	03/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	253.803,82	0,00	89.749,72350100	2,8279064280
4132	03/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	162.038,03	0,00	57.299,64343700	2,8279064280
4147	03/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	490,11	0,00	173,31195700	2,8279064280
4070	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	347,05	0,00	122,67981000	2,8289088280
4079	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	296.369,96	0,00	104.764,76196991	2,8289088280
4106	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	285.777,16	101.020,27932900	2,8289088280
4130	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	788.545,21	0,00	278.745,36011700	2,8289088280
4148	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	434,04	0,00	153,43018300	2,8289088280
4067	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.683,53	6.957,99376900	2,8289088280
4063	04/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	19.683,53	0,00	2.327,00736100	8,4587313000
4057	04/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	14.053,26	0,00	1.661,39099300	8,4587313000
4071	05/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	257,44	0,00	90,96977900	2,8299508020
4080	05/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	164.155,43	0,00	58.006,46070700	2,8299508020
4133	05/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.000,00	0,00	1.413,45213300	2,8299508020
4149	05/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	209,27	0,00	73,94828200	2,8299508020
4072	06/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.438,60	0,00	2.627,61395300	2,8309333610
4081	06/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	34.669.311,61	0,00	12.246.601,09899300	2,8309333610
4150	06/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	19.792.494,64	0,00	6.991.508,49421900	2,8309333610
4073	07/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.780.525,50	0,00	5.925.480,48881200	2,8319265470
4082	07/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	39.759.092,09	14.039.591,57490100	2,8319265470
4099	07/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	311.432,30	109.971,88480397	2,8319265470
4117	07/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	101.769,61	35.936,52882975	2,8319265470
4151	07/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.649.467,47	7.997.900,75558100	2,8319265470
4083	10/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	29.527,19	0,00	10.422,99090184	2,8328903170
4140	10/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	100.121,00	35.342,34961346	2,8328903170
4152	10/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	81,32	0,00	28,70566400	2,8328903170

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4084	11/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.520,99	7.594,15701200	2,8338879440
4134	11/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	44,05	0,00	15,54401600	2,8338879440
4058	11/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	21.626,32	0,00	2.551,83141500	8,4748231680
4085	12/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	13.816,51	0,00	4.873,70184600	2,8349108000
4107	12/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	296.786,84	0,00	104.690,00999900	2,8349108000
4141	12/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.000,00	1.410,97913900	2,8349108000
4064	12/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	19.669,25	0,00	2.320,02875500	8,4780199170
4086	13/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	43.708,79	15.412,75586400	2,8358841460
4087	14/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.085,80	0,00	5.670,19660100	2,8369033970
4142	14/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	722,50	254,67909900	2,8369033970
4088	17/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	14.813,87	0,00	5.219,99964900	2,8379063210
4135	17/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	22.064,98	0,00	7.775,09103600	2,8379063210
4074	18/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.815.874,05	5.923.365,85073600	2,8389051890
4089	18/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.077.498,40	0,00	5.663.274,16015724	2,8389051890
4108	18/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	57.464,44	0,00	20.241,76088115	2,8389051890
4118	18/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	243.611,86	0,00	85.811,90416000	2,8389051890
4125	18/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	435.081,61	0,00	153.256,83002230	2,8389051890
4153	18/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.394,54	0,00	4.365,95771000	2,8389051890
4090	19/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.508.050,14	0,00	5.812.842,43202200	2,8399273390
4109	19/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	24.743.209,00	0,00	8.712.620,44637800	2,8399273390
4143	19/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	82.236,98	28.957,42397000	2,8399273390
4154	19/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.967.910,63	0,00	2.101.430,74720400	2,8399273390
4091	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.758.123,66	6.602.835,80501800	2,8409192980
4100	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	69.894,29	24.602,70168500	2,8409192980
4110	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.192.355,63	8.163.679,85050700	2,8409192980
4119	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.870,76	5.234,48871300	2,8409192980
4144	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.291.378,24	2.566.555,91911300	2,8409192980
4155	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.898.055,84	2.428.106,93174500	2,8409192980
4069	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	133.447,58	0,00	46.973,37938900	2,8409192980
4075	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	246,40	0,00	86,70220900	2,8419114410

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4092	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	11.761,00	0,00	4.138,41185500	2,8419114410
4101	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	22.119.745,98	0,00	7.783.404,38793400	2,8419114410
4120	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	13.954.241,97	0,00	4.910.160,73501900	2,8419114410
4126	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.587.905,88	4.781.255,91247100	2,8419114410
4136	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	344,61	0,00	121,25993600	2,8419114410
4068	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	133.494,18	46.973,37938900	2,8419114410
4065	21/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	133.494,18	0,00	15.703,60358700	8,5008628280
4093	24/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	42.679,15	0,00	15.012,37844400	2,8429305960
4111	24/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.363.303,82	0,00	1.534.790,83384560	2,8429305960
4121	24/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.447.273,67	4.026.575,14260331	2,8429305960
4145	24/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	847,00	297,93200100	2,8429305960
4156	24/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	293,04	0,00	103,07673300	2,8429305960
4066	24/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	133.447,58	0,00	15.692,13765600	8,5041045980
4076	25/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.749,23	0,00	966,70188200	2,8439274290
4094	25/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.616.948,26	0,00	1.623.440,95454700	2,8439274290
4102	25/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.074.336,05	5.652.161,12270900	2,8439274290
4112	25/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.029.340,31	713.569,65346800	2,8439274290
4122	25/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.151,42	9.195,53000300	2,8439274290
4127	25/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.061.778,55	0,00	4.241.239,92300300	2,8439274290
4137	25/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.214.169,56	0,00	778.560,49961800	2,8439274290
4157	25/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	51,42	0,00	18,08063000	2,8439274290
4061	25/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	22.946,42	0,00	2.697,22106500	8,5074302180
4095	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	103.202.283,87	0,00	36.275.342,78382300	2,8449706040
4103	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.446.893,63	2.266.066,86935100	2,8449706040
4113	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.282.029,62	1.505.122,62375600	2,8449706040
4123	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	489.137,74	171.930,68333018	2,8449706040
4128	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	660.891,49	232.301,69375768	2,8449706040
4146	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	226.582,50	79.643,17792300	2,8449706040
4158	26/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.204.818,42	0,00	4.289.962,92715200	2,8449706040
4059	26/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	244.378,29	0,00	28.714,22716800	8,5107040690

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4077	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	34,91	0,00	12,26653900	2,8459535270
4096	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	108.339.934,70	38.068.061,78392000	2,8459535270
4104	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.211.120,58	1.128.310,96837500	2,8459535270
4114	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.647.678,38	1.984.459,10181600	2,8459535270
4124	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.659.911,76	0,00	934.629,37281477	2,8459535270
4131	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	250.303,43	0,00	87.950,63855500	2,8459535270
4138	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.136.745,77	0,00	2.507.681,76721500	2,8459535270
4159	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.603.035,88	3.022.901,04120900	2,8459535270
4097	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	88.681,80	0,00	31.149,69012300	2,8469560900
4105	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	161.631,77	56.773,53808400	2,8469560900
4115	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.225.736,12	0,00	781.795,02937100	2,8469560900
4129	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	222.298,50	0,00	78.082,86920200	2,8469560900
4139	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	99.082,69	0,00	34.803,02711600	2,8469560900
4160	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	279.550,38	0,00	98.192,72625311	2,8469560900
4062	28/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	2.791,76	0,00	327,77667400	8,5172625670
4060	28/06/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	18.272,41	0,00	2.145,33834700	8,5172625670
<b>Total</b>			<b>326.218.015,93</b>	<b>318.530.281,71</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.338.711,09

Value-At-Risk: 0,45%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,84	0,41	5,00	0,40	-0,43	0,43	729.219.337,63	98,73
Artigo 8º	12,19	6,68	20,00	0,06	-0,01	0,65	9.402.809,20	1,27
ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO		0,45		0,45			738.622.146,83	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,41%

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 IRF-M 1+	5,05	1,91	0,03	0,03	-0,30	-0,75	12.526.051,06	1,70
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,00	0,42	0,07	0,42	-0,41	0,38	132.506.522,96	17,94
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,99	2,16	0,23	0,01	-0,44	-0,99	82.382.268,42	11,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	0,91	0,05	0,01	-0,24	0,37	45.655.954,36	6,18
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,41	3,03	0,02	0,05	-0,48	-2,28	4.188.643,94	0,57
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-2,77	0,77	12.024.613,36	1,63
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,01	0,00	0,00	-0,21	0,79	324.531.146,61	43,94
<b>Sub-total</b>	1,00	0,48	0,40		-0,41	0,37	613.815.200,71	83,10

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 FLUXO FIC	0,01	0,01	-0,00	0,01	-5,87	0,71	115.404.136,92	15,62
<b>Sub-total</b>	0,01	0,01	-0,00		-5,87	0,71	115.404.136,92	15,62

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 6,68%

Artigo 8º I

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
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	12,19	6,68	0,06	1,79	-0,01	0,65	9.402.809,20	1,27
<b>Sub-total</b>	12,19	6,68	0,06		-0,01	0,65	9.402.809,20	1,27

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)