



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA
MAIO 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 31.05.2022.

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 91,33%

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	3,58	0,58	1,77	8.639.167,76	1,32	3.694.753.029,30	0,23
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,74	0,92	3,90	35.939.291,55	5,49	5.107.140.425,93	0,70
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,48	0,96	4,58	53.815.873,43	8,22	6.293.749.685,70	0,86
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,59	0,77	6,17	42.703.024,99	6,52	9.450.283.491,65	0,45
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,73	1,11	2,99	10.521.223,68	1,61	772.476.623,73	1,36
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,67	0,77	6,14	35.175.372,63	5,37	6.992.058.203,56	0,50
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,32	0,51	6,78	52.143.232,86	7,96	2.293.984.372,74	2,27
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,61	0,82	3,37	73.481.387,69	11,22	5.396.025.552,32	1,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,80	0,80	4,68	312.418.574,59	47,71		

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	1,07	4,47	102.111.973,44	15,60	9.967.340.356,95	1,02
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,18	0,95	3,90	110.927.707,04	16,94	3.180.026.553,36	3,49
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,19	0,93	3,82	72.532.893,46	11,08	3.819.723.058,42	1,90
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,32	1,01	4,10	285.572.573,94	43,61		
Renda Fixa			1,83	0,91	4,42	597.991.148,53	91,33		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,35%

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	19,18	3,61	6,77	8.868.953,75	1,35	447.031.184,53	1,98
Sub-total Artigo 8º I			19,18	3,61	6,77	8.868.953,75	1,35		
Renda Variável			11,81	3,61	6,77	8.868.953,75	1,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,32%

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	1,07	4,71	12.309.476,40	1,88	320.193.902,85	3,84
BB	BB	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,34	0,88	4,17	18.425.613,89	2,81	19.778.373.316,20	0,09
BB	BB	BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	2,17	0,79	5,61	15.995.959,68	2,44	2.478.526.613,81	0,65
BB	BB	BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	3,43	1,08	5,07	1.173.478,58	0,18	117.644.020,41	1,00
Sub-total Artigo 10º I			0,76	0,90	4,81	47.904.528,55	7,32		
Investimentos Estruturados			0,76	0,90	4,81	47.904.528,55	7,32		
Total			1,82	0,95	4,49	654.764.630,83	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	312.418.574,59	47,71	0,00	44,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	285.572.573,94	43,61	0,00	47,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	597.991.148,53	91,33					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	8.868.953,75	1,35	0,00	4,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	8.868.953,75	1,35					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	47.904.528,55	7,32	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	47.904.528,55	7,32					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	0,80 77,17	4,68 107,73	3,92 139,43	5,40 105,03	5,85 74,09	2.472.688,37	15.116.077,31
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,01 97,64	4,10 94,27	2,73 96,91			2.852.731,55	10.772.552,99
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,61 0,39	6,77 0,55	-0,52 1,06			308.907,26	562.731,70
Artigo 10º I % do CDI	0,90 87,63	4,81 110,65	2,99 106,14			428.942,57	2.196.998,87
ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)						6.063.269,75	28.648.360,87

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 RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	72.885.455,33	0,00	0,00	0,00	73.481.387,69	595.932,36	3.161.435,25
BB PREV RF IDKA2	42.374.622,71	0,00	0,00	0,00	42.703.024,99	328.402,28	2.509.288,80
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	53.304.434,86	0,00	0,00	0,00	53.815.873,43	511.438,57	2.358.800,42
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	34.906.631,11	0,00	0,00	0,00	35.175.372,63	268.741,52	2.033.378,50
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	9.381.818,58	1.028.483,34	0,00	0,00	10.521.223,68	110.921,76	282.234,67
BB PREV RF IPCA	53.365.881,54	0,00	-1.502.249,16	0,00	52.143.232,86	279.600,48	3.412.031,74
BB PREV RF IRF M	8.589.706,13	0,00	0,00	0,00	8.639.167,76	49.461,63	129.290,17
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	35.611.101,78	0,00	0,00	0,00	35.939.291,55	328.189,77	1.269.918,26
					312.418.574,59	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	71.864.888,76	0,00	0,00	0,00	72.532.893,46	668.004,70	1.806.798,26
BB PREV RF FLUXO FIC	114.607.765,23	200.221.941,61	-205.009.517,53	0,00	110.927.707,04	1.107.517,73	4.981.616,89
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	101.034.764,32	0,00	0,00	0,00	102.111.973,44	1.077.209,12	3.984.137,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					285.572.573,94	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	8.560.046,49	0,00	0,00	0,00	8.868.953,75	308.907,26	562.731,70
					8.868.953,75	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	18.264.494,47	0,00	0,00	0,00	18.425.613,89	161.119,42	737.425,89
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI	15.871.153,56	0,00	0,00	0,00	15.995.959,68	124.806,12	849.749,41
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	1.160.902,25	0,00	0,00	0,00	1.173.478,58	12.576,33	56.663,49
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	12.179.035,70	0,00	0,00	0,00	12.309.476,40	130.440,70	553.160,08
					47.904.528,55	0,00	0,00

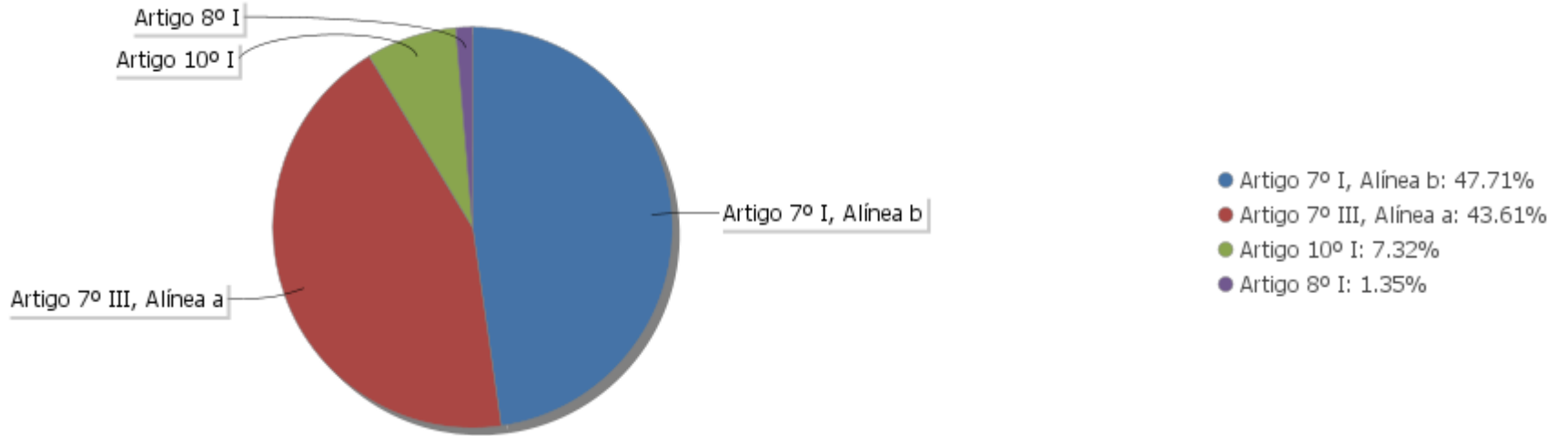
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

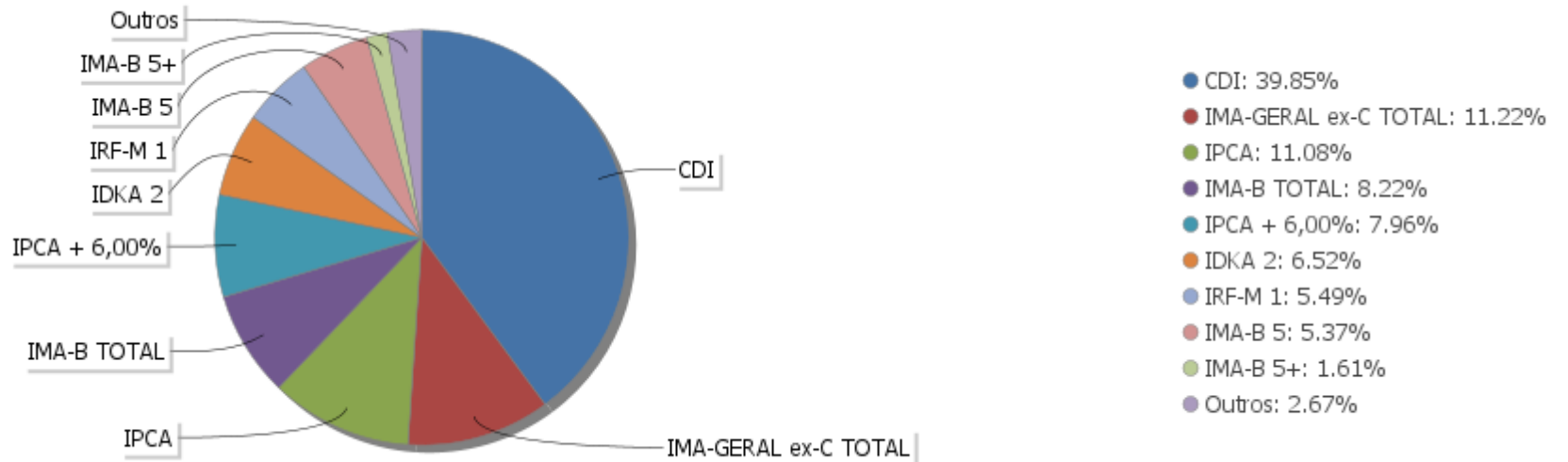
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	602.621.397,97	92,04	602.621.397,97	92,04
de 31 a 365 dias	52.143.232,86	7,96	654.764.630,83	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	654.764.630,83	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

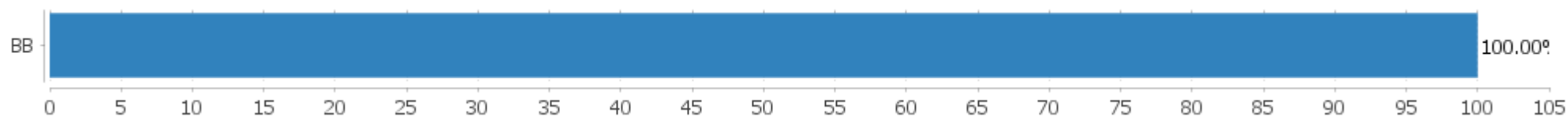


Alocação Por Estratégia



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								4,49
INPC + 1,55%	0,80	1,12	1,85	1,16	0,58								5,62
p.p. indexador	-0,49	-0,33	-0,23	-0,40	0,36								-1,14
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

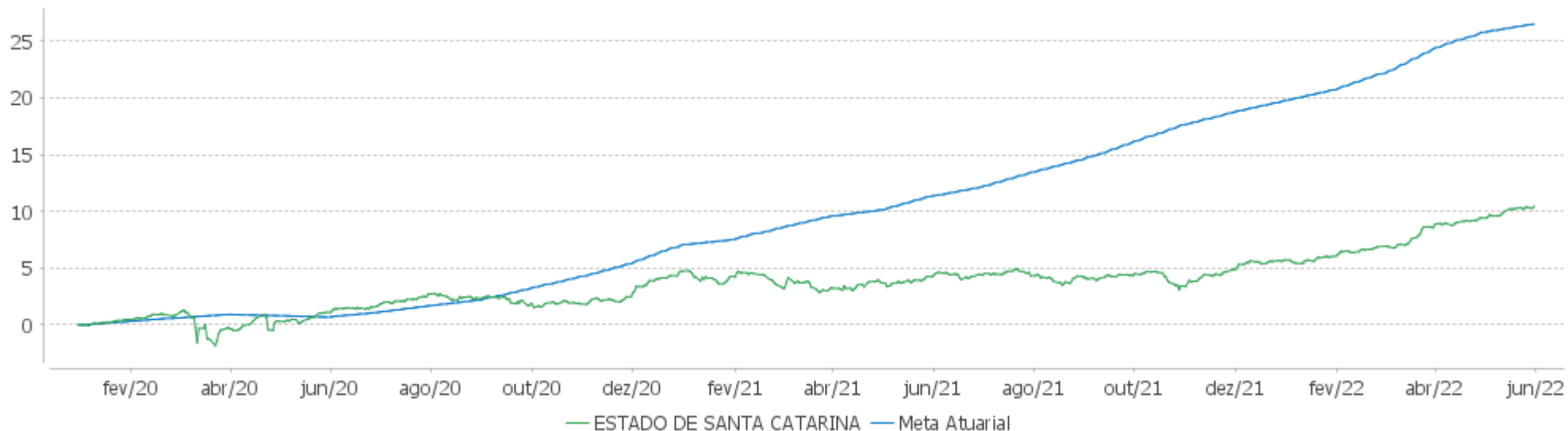
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	7	24,14
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	75,86
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03

Relatório

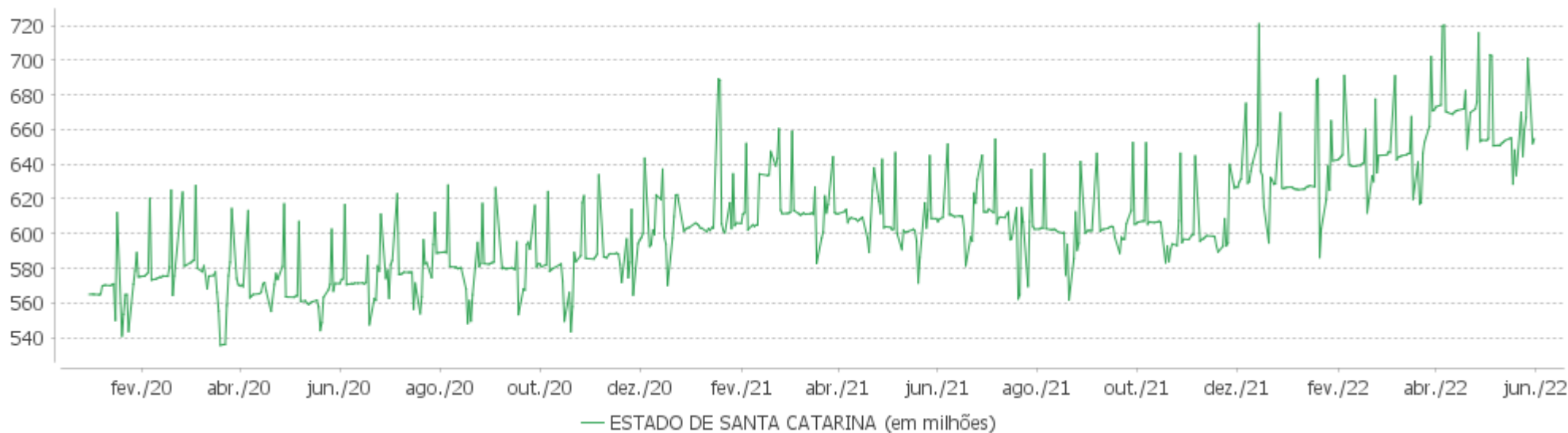
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,36	3,63	-0,27	1,56
06 meses	5,29	6,67	-1,38	1,46
12 meses	5,98	14,54	-8,56	1,82
24 meses	9,25	27,53	-18,28	2,00
Desde 31/12/2019	10,47	28,93	-18,47	2,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

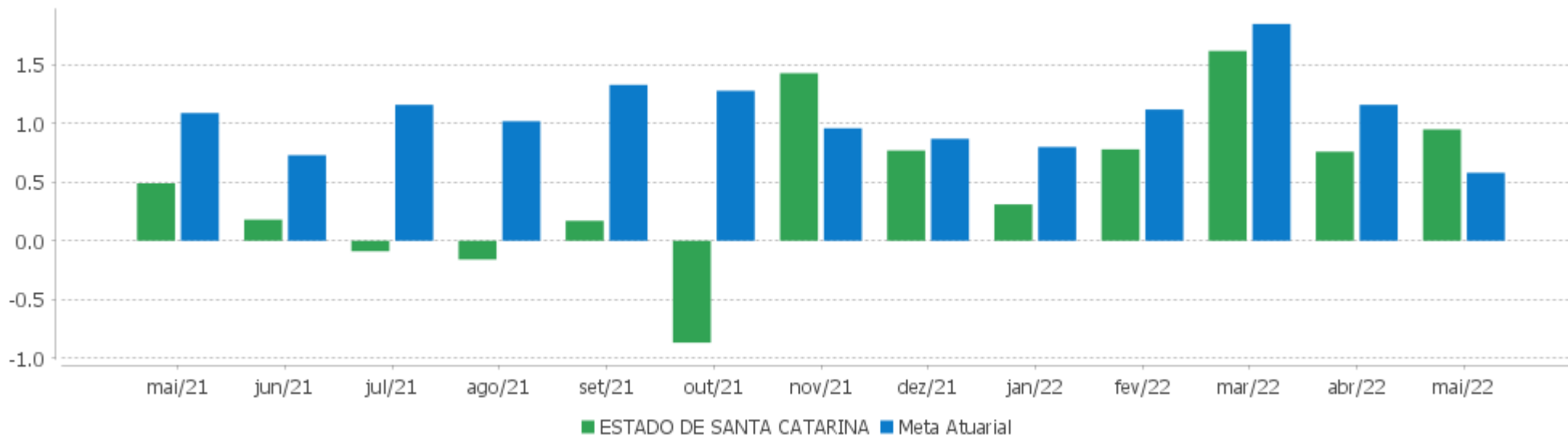


Patrimônio Líquido



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.	0,77 -0,08	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,92 -0,30	9,45 0,21	17,95 -0,54	27,46 -1,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,82	3,37	2,70	4,32	3,78	7,35	15,50
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,51 -0,47	6,78 -0,54	5,23 0,53	7,37 -1,30	9,67 -8,76	17,81 -17,82	31,37 -15,05
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,03	3,90 -0,12	2,51 -0,10	4,78 -0,16	6,14 -0,29	7,98 -0,69	14,50 -1,04
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,01	6,14 -0,12	4,95 -0,07	6,94 -0,15	9,18 -0,37	16,95 -0,70	27,79 -0,99
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,96 -0,01	4,58 -0,14	4,83 -0,10	4,80 -0,17	4,24 -0,35	13,52 -0,66	20,88 -0,93
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,58 -0,01	1,77 -0,05	1,32 0,01	3,68 -0,06	1,34 -0,26	1,85 -0,47	13,05 -0,85
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	1,11 -0,05	2,99 -0,18	4,72 -0,12	2,65 -0,16	-0,64 -0,39	9,58 -0,83	14,07 -0,94
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,07 103,41	4,47 102,93	2,84 100,83	5,31 103,21	8,23 104,30	10,70 104,45	15,42 98,68
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,95 92,35	3,90 89,81	2,53 90,00	4,60 89,42	6,73 85,24	7,86 76,73	11,92 76,28
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,93 0,46	3,82 -0,97	2,93 -0,25	4,61 -0,94	4,84 -6,90	9,18 -11,55	
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,61 0,39	6,77 0,55	-0,52 1,06	10,08 0,82	-12,44 -0,66	25,84 -1,56	9,58 -5,18
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI % do CDI	1,08 105,07	5,07 116,80	3,28 116,63	6,48 126,06	6,02 76,22	9,66 94,27	
BB PREV MULTIMERCADO FI LP % do CDI	1,07 103,88	4,71 108,32	3,02 107,27	5,93 115,36	7,27 92,17	10,08 98,42	16,55 105,90
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI % do CDI	0,88 85,56	4,17 95,97	2,71 96,18	4,93 95,95	7,64 96,85	11,76 114,79	17,07 109,25
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI % do CDI	0,79 76,27	5,61 129,15	3,27 116,04	6,83 132,81	6,77 85,81	11,60 113,30	17,08 109,31
ESTADO DE SANTA CATARINA	0,95	4,49	3,36	5,29	5,98	9,25	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. INPC + 1,55% p.p.	0,36	-1,14	-0,27	-1,25	-7,66	-16,40	
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

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 MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI	D+1 du	D+0		D+4 du	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com baseno resultado do fundo, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do Certificado de Depósito Interfinanceiro - CDI, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB PREV MULTIMERCADO FI LP	D+0	D+0	D+0	D+4 du		0,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0		D+3 du		
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 du		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

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	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

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	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1471	02/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	55.415,89	24.651,06159800	2,2480123130
1487	02/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	598,77	266,35530300	2,2480123130
1488	03/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	28.002,62	12.451,68820200	2,2489014780
1544	03/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	685.824,40	0,00	304.959,73554600	2,2489014780
1472	04/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.129,84	0,00	946,67953900	2,2498003930
1489	04/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	46.891.104,17	0,00	20.842.339,75418200	2,2498003930
1473	05/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.034,00	903,71999700	2,2506971250
1490	05/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	280.036,96	0,00	124.422,32092800	2,2506971250
1491	05/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.963,22	3.982,41944700	2,2506971250
1520	05/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	284.938,08	126.599,92179100	2,2506971250
1455	06/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.533.645,02	0,00	1.125.235,00260400	2,2516585550
1474	06/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	106.709,01	47.391,29286000	2,2516585550
1492	06/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	53.449.102,93	23.737.658,98533400	2,2516585550
1512	06/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	291.274,75	129.360,08852400	2,2516585550
1521	06/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	348.416,39	154.737,66625300	2,2516585550
1530	06/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	59.877,86	26.592,77973900	2,2516585550
1538	06/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	111.113,73	49.347,50420000	2,2516585550
1493	09/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	211.932,22	0,00	94.080,03428200	2,2526800890
1494	10/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	26.358,93	0,00	11.695,96987600	2,2536762900
1454	11/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.530.754,91	1.122.452,78413000	2,2546649140
1475	11/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	523,95	232,38486400	2,2546649140
1495	11/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.871.104,54	0,00	1.273.406,31513400	2,2546649140
1513	11/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	23.344,36	0,00	10.353,80461800	2,2546649140
1522	11/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	31.585,97	14.009,16375800	2,2546649140
1531	11/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	67.796,77	0,00	30.069,55471600	2,2546649140
1539	11/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	77.343,06	0,00	34.303,57190500	2,2546649140
1456	12/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.308,90	0,00	1.466,93428200	2,2556566030
1458	12/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.022.917,94	453.490,10068300	2,2556566030

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1464	12/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.022.917,94	0,00	453.490,10068200	2,2556566030
1476	12/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.000,00	1.329,98967800	2,2556566030
1496	12/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.918,63	2.180,57571100	2,2556566030
1463	13/05/2022	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.028.483,34	0,00	302.010,50682000	3,4054554950
1466	13/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.028.483,34	455.756,29079600	2,2566519840
1477	13/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	16.292,33	0,00	7.219,69099100	2,2566519840
1497	13/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.760,57	2.109,57207100	2,2566519840
1457	16/05/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	1.061.153,11	382.624,43560700	2,7733542640
1459	16/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.061.153,11	0,00	470.027,34770200	2,2576412100
1460	16/05/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	15.233,72	5.492,88642900	2,7733542640
1461	16/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	15.233,72	0,00	6.747,62665200	2,2576412100
1462	16/05/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	350.920,04	126.532,71331200	2,7733542640
1465	16/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	350.920,04	0,00	155.436,58507100	2,2576412100
1467	16/05/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	20.472,66	7.381,91303800	2,7733542640
1468	16/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	20.472,66	0,00	9.068,16366900	2,2576412100
1469	16/05/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	54.469,63	19.640,34335900	2,7733542640
1470	16/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	54.469,63	0,00	24.126,78762100	2,2576412100
1478	16/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	34.085,05	0,00	15.097,63812200	2,2576412100
1498	16/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	705,73	312,59617200	2,2576412100
1479	17/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	660,00	292,21213500	2,2586330980
1499	17/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.630,65	0,00	721,96320900	2,2586330980
1500	18/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	25.625,75	11.340,72618700	2,2596216130
1523	18/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.229.605,51	11.607.963,63386500	2,2596216130
1480	19/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	51.240,77	22.666,76186000	2,2606127120
1501	19/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	19.502.246,81	0,00	8.626.973,87592100	2,2606127120
1481	20/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.097.388,30	2.696.022,90373600	2,2616233310
1502	20/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.952.222,36	9.264.240,45631700	2,2616233310
1514	20/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	14.787.773,68	0,00	6.538.566,11633900	2,2616233310
1524	20/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	86.793,80	38.376,77070700	2,2616233310
1532	20/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.847.943,64	0,00	1.701.407,82828700	2,2616233310

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1540	20/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.354.319,67	2.809.627,74963500	2,2616233310
1503	23/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	17.001,56	0,00	7.514,17629700	2,2625979650
1525	23/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	31.476.003,99	0,00	13.911.443,60460800	2,2625979650
1533	23/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.612.721,06	0,00	2.038.683,46535800	2,2625979650
1482	24/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.575,00	695,79925500	2,2635839130
1504	24/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.980,41	2.200,23210600	2,2635839130
1515	24/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.850.680,54	7.886.025,53564800	2,2635839130
1534	24/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.916.806,90	3.055.688,30926800	2,2635839130
1483	25/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.598.241,08	0,00	4.238.453,20508300	2,2645622390
1505	25/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.209.697,51	3.183.704,72925600	2,2645622390
1516	25/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.609.584,32	0,00	2.035.529,97599900	2,2645622390
1526	25/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.315.175,24	580.763,56540400	2,2645622390
1535	25/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	148.420,81	65.540,61859900	2,2645622390
1541	25/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	9.319.086,77	0,00	4.115.182,44431800	2,2645622390
1506	26/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	4.996.917,49	0,00	2.205.612,25172400	2,2655466690
1507	26/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.376,62	607,63259400	2,2655466690
1508	26/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.785,15	1.229,35008900	2,2655466690
1517	26/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.575.277,28	0,00	695.318,83918100	2,2655466690
1484	27/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	767.738,26	338.727,72166700	2,2665350690
1509	27/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	38.076.691,15	0,00	16.799.515,55605000	2,2665350690
1518	27/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.560.474,12	688.484,43659400	2,2665350690
1527	27/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.096,97	6.219,61256800	2,2665350690
1536	27/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	549.026,49	242.231,63255200	2,2665350690
1542	27/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.019.239,45	449.690,57127800	2,2665350690
1485	30/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.120.584,17	494.194,03290200	2,2674983820
1510	30/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	30.422.286,00	13.416.673,74120300	2,2674983820
1519	30/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.076.983,53	1.798.009,45498500	2,2674983820
1528	30/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.085.848,83	4.006.992,42042500	2,2674983820
1537	30/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.489.175,80	656.748,34073600	2,2674983820
1543	30/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.280.611,28	1.005.782,98009100	2,2674983820

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1486	31/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.364,90	0,00	1.483,32006400	2,2684922020
1511	31/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	185.057,21	0,00	81.577,18586600	2,2684922020
1529	31/05/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	1.362.926,37	0,00	600.807,16556900	2,2684922020
Total			201.250.424,95	206.511.766,69		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.428.191,57

Value-At-Risk: 0,68%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ESTADO DE SANTA CATARINA		0,68	0,68			654.764.630,83	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,67%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,57	0,02	0,03			8.639.167,76	1,32
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,31	0,01	0,01			35.939.291,55	5,49
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,07	0,16	0,03			53.815.873,43	8,22
BB PREV RF IDKA2		1,26	0,07	0,25			42.703.024,99	6,52
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,41	0,05	0,13			10.521.223,68	1,61
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,05	0,03			35.175.372,63	5,37
BB PREV RF IPCA		0,88	0,04	0,85			52.143.232,86	7,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,01	0,11	1,01			73.481.387,69	11,22
Sub-total	2,24	1,11	0,52		-0,10	0,80	312.418.574,59	47,71

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,03			102.111.973,44	15,60
BB PREV RF FLUXO FIC		0,03	0,00	0,01			110.927.707,04	16,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,77	0,08	0,77			72.532.893,46	11,08
Sub-total	0,41	0,20	0,08		-0,06	1,01	285.572.573,94	43,61

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		0,40	0,00	0,41			12.309.476,40	1,88
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI		0,13	-0,00	0,13			18.425.613,89	2,81
BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI		0,87	0,00	0,87			15.995.959,68	2,44
BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI		0,84	0,00	0,84			1.173.478,58	0,18
Sub-total	0,90	0,39	0,01		-0,14	0,90	47.904.528,55	7,32

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,05%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		9,05	0,06	2,00			8.868.953,75	1,35
Sub-total	19,94	9,05	0,06		0,13	3,61	8.868.953,75	1,35