



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO
MAIO 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 31.05.2024.

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

98,72%

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+	3,35	0,26	0,56	0,68	12.620.818,17	1,73	369.613.967,10	3,41
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,80	0,08	0,72	3,44	132.001.035,99	18,14	6.634.026.168,29	1,99
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,87	0,24	1,31	-0,24	83.202.021,49	11,43	4.952.904.793,10	1,68
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,74	0,10	1,03	2,82	45.485.902,72	6,25	5.119.005.015,74	0,89
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,01	0,36	1,57	-2,99	4.286.457,68	0,59	1.345.594.003,69	0,32
BB	BB	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	0,06	0,04	0,81	4,29	11.306.091,97	1,55	11.360.201.127,51	0,10
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,06	0,04	0,82	4,38	321.997.466,99	44,25	34.291.651.726,37	0,94
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,66	0,09	0,99	2,48	610.899.795,01	83,95		

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	0,07	0,03	0,75	3,97	107.452.539,01	14,77	4.168.595.178,55	2,58
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,07	0,03	0,75	3,97	107.452.539,01	14,77		
Renda Fixa			1,25	0,08	0,97	2,75	718.352.334,02	98,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,28%

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	13,58	-0,34	-2,54	-9,95	9.341.934,72	1,28	312.378.854,32	2,99
Sub-total Artigo 8º I			13,58	-0,34	-2,54	-9,95	9.341.934,72	1,28		
Renda Variável			13,58	-0,34	-2,54	-9,95	9.341.934,72	1,28		
Total			1,34	0,07	0,92	2,57	727.694.268,74	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
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	610.899.795,01	83,95	0,00	85,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	107.452.539,01	14,77	0,00	13,00	60,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	718.352.334,02	98,72					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.341.934,72	1,28	0,00	2,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	9.341.934,72	1,28					40,00
Total		727.694.268,74	100,00					

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	0,99 118,62	2,48 56,29	1,35 52,24	4,07 76,38	9,97 83,07	5.968.834,36	14.729.676,40
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,75 89,44	3,97 90,22	2,32 89,93	4,82 90,39	11,00 91,59	985.930,87	5.782.052,25
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,54 0,50	-9,95 -0,94	-5,87 -0,50	-4,56 -0,45	10,35 -2,36	-243.295,62	-1.031.734,70
ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO (Total)						6.711.469,61	19.479.993,95

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+	12.550.388,37	0,00	0,00	0,00	12.620.818,17	70.429,80	85.591,61
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	131.055.550,80	0,00	0,00	0,00	132.001.035,99	945.485,19	4.391.097,69
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	164.859.909,03	0,00	-83.792.509,56	0,00	83.202.021,49	2.134.622,02	-423.736,12
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	90.008.432,16	0,00	-45.373.442,08	0,00	45.485.902,72	850.912,64	2.418.124,15
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.440.784,49	0,00	-4.287.138,79	0,00	4.286.457,68	132.811,98	-264.317,38
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	8.793.893,70	2.434.680,09	0,00	0,00	11.306.091,97	77.518,18	361.243,01
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	188.238.517,32	132.001.895,12	0,00	0,00	321.997.466,99	1.757.054,55	8.161.673,44
	603.947.475,87	134.436.575,21	-133.453.090,43	0,00	610.899.795,01	5.968.834,36	

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	114.658.188,65	436.808.276,45	-444.999.856,96	0,00	107.452.539,01	985.930,87	5.782.052,25
	114.658.188,65	436.808.276,45	-444.999.856,96	0,00	107.452.539,01	985.930,87	

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	9.585.230,34	0,00	0,00	0,00	9.341.934,72	-243.295,62	-1.031.734,70
	9.585.230,34	0,00	0,00	0,00	9.341.934,72	-243.295,62	

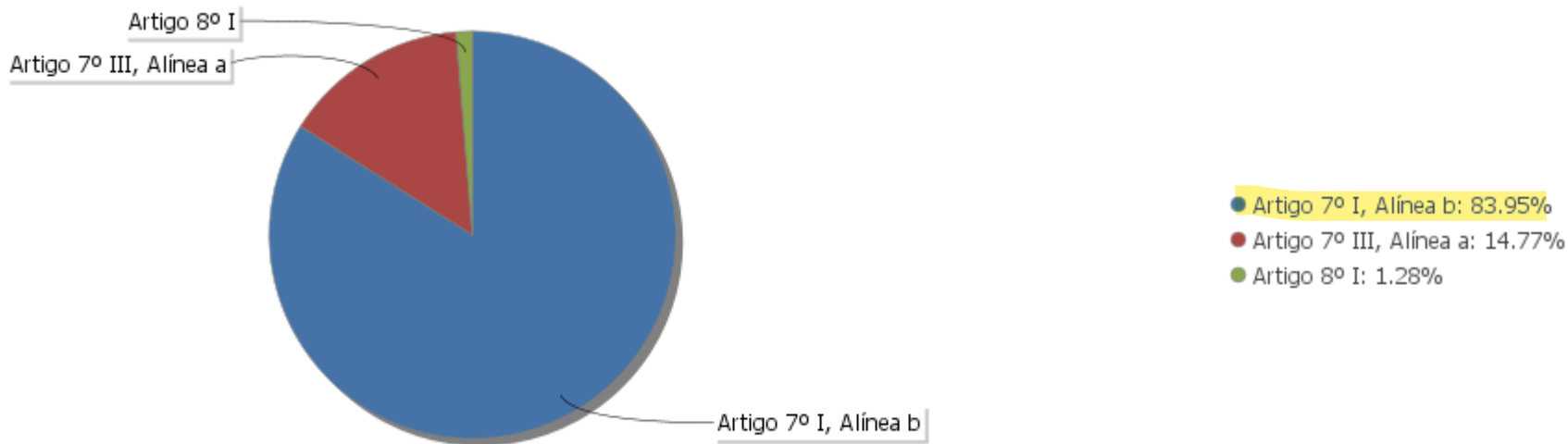
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

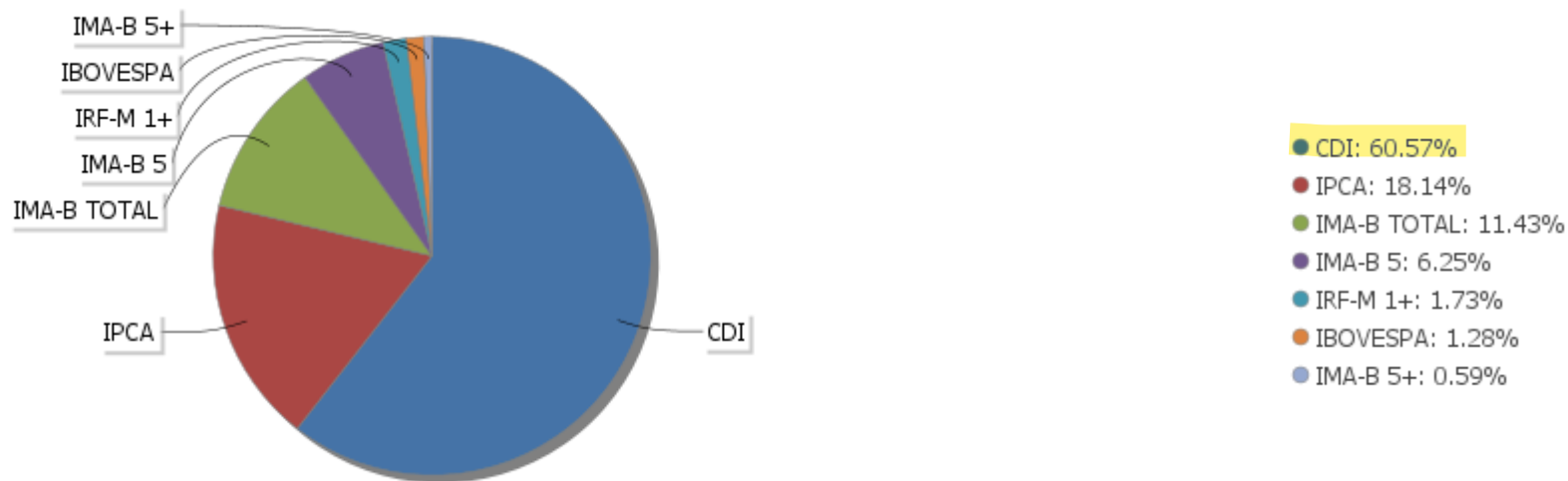
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	727.694.268,74	100,00	80,00	727.694.268,74	100,00	80,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	0,00	727.694.268,74	100,00	80,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	727.694.268,74	100,00	80,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

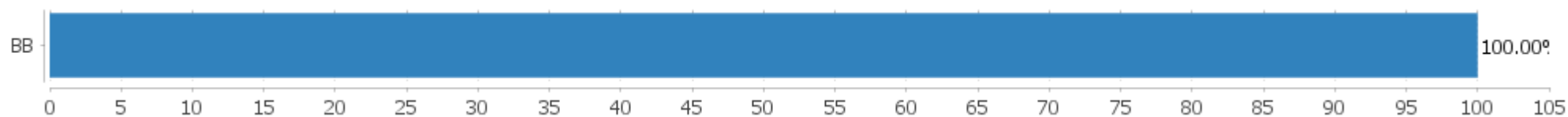


Alocação Por Estratégia



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								2,57
INPC + 4,50%	0,96	1,15	0,54	0,76	0,83								4,30
p.p. indexador	-0,49	-0,47	0,02	-0,83	0,09								-1,73
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	45,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	54,72

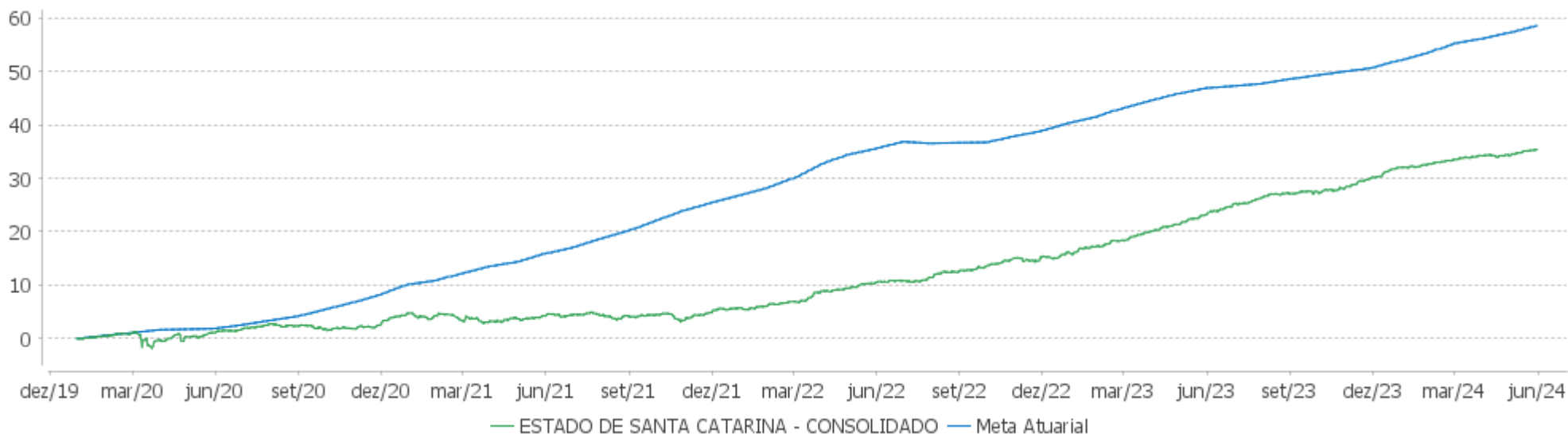
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03

Relatório

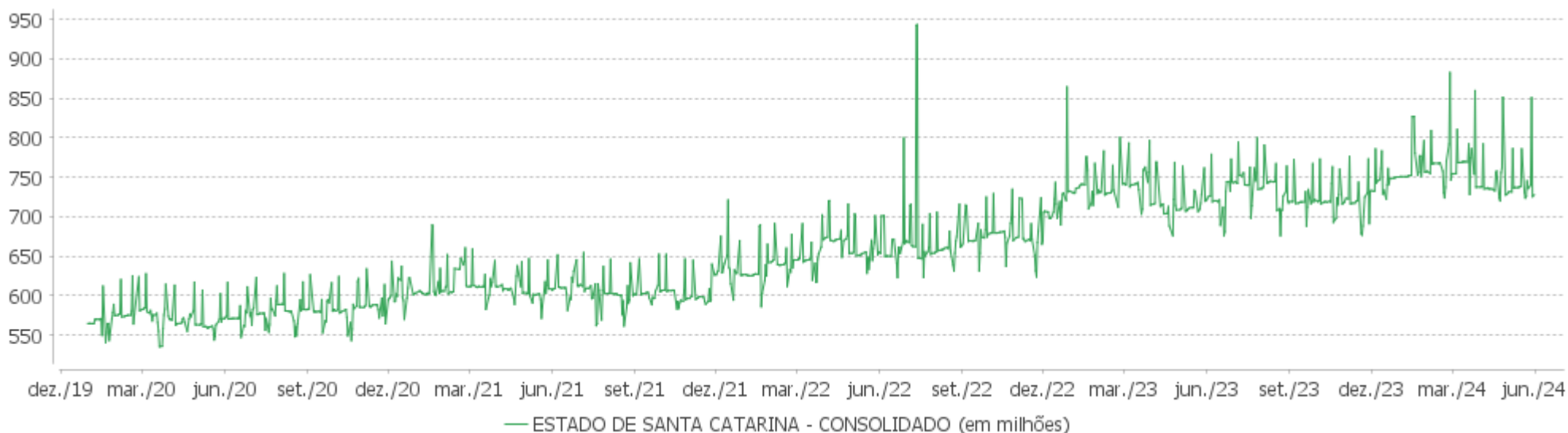
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,41	2,14	-0,73	1,11
06 meses	4,08	5,02	-0,93	1,03
12 meses	9,95	6,27	3,67	1,34
24 meses	22,57	12,03	10,54	1,48
36 meses	29,89	28,32	1,57	1,61
48 meses	33,90	42,87	-8,97	1,77
Desde 31/12/2019	35,39	44,44	-9,05	2,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

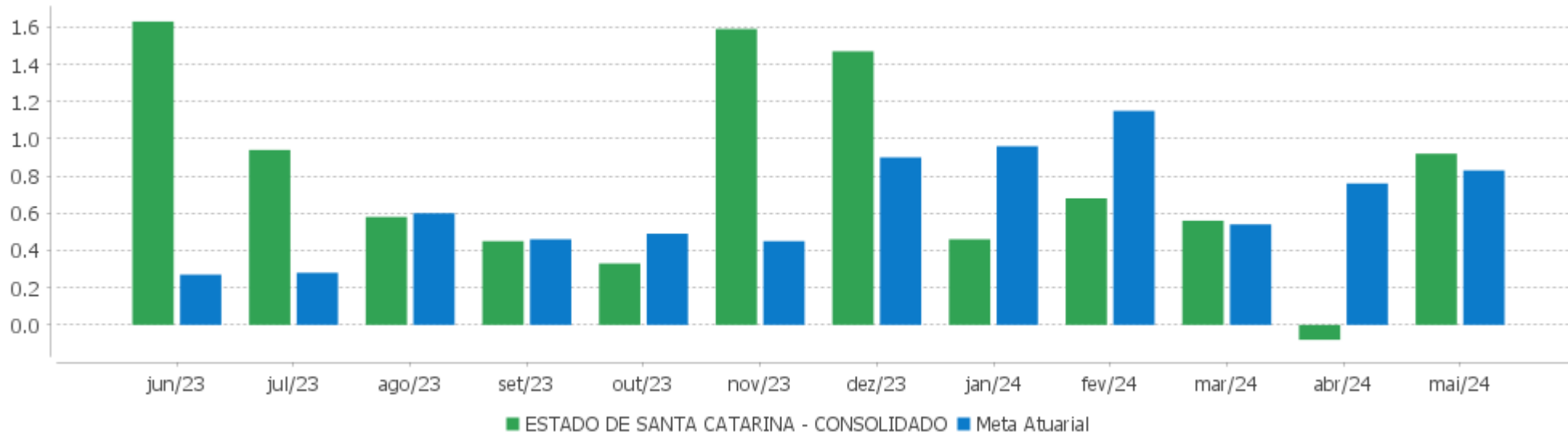


Patrimônio Líquido



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.	0,56 -0,04	0,68 -0,26	-0,19 -0,19	2,39 -0,30	9,73 -0,49	26,41 -1,26	24,98 -1,55
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	2,82 -0,10	1,56 -0,06	4,30 -0,12	8,68 -0,26	18,75 -0,48	29,66 -0,96
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,31 -0,02	-0,24 -0,11	-0,29 -0,06	2,49 -0,12	6,25 -0,31	17,16 -0,56	22,13 -1,00
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI % do CDI	0,81 96,74	4,29 97,49	2,51 97,28	5,20 97,56	11,71 97,56	26,49 97,75	36,31 97,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,72 0,26	3,44 1,17	1,78 0,78	4,42 1,58	11,34 7,41	25,22 17,21	31,28 10,59
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,82 98,86	4,38 99,47	2,56 99,32	5,31 99,54	11,94 99,48	27,01 99,67	37,15 100,06
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	1,57 -0,02	-2,99 -0,14	-1,98 -0,07	0,82 -0,16	3,89 -0,35	15,26 -0,76	14,52 -1,21
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 89,44	3,97 90,22	2,32 89,93	4,82 90,39	10,90 90,80	24,61 90,82	33,00 88,86
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,54 0,50	-9,95 -0,94	-5,87 -0,50	-4,56 -0,45	10,35 -2,36	5,33 -4,32	-7,77 -4,50
ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO Var. INPC + 4,50% p.p.	0,92 0,09	2,57 -1,73	1,41 -0,73	4,08 -1,16	9,95 2,00	22,57 5,56	29,89 -6,93
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

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	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

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	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3889	02/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	24.180,53	0,00	8.614,41030000	2,8069861030
3918	02/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	747.674,00	0,00	266.361,84596700	2,8069861030
3842	03/05/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	11.337,88	0,00	1.351,17085800	8,3911519630
3848	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	48,97	0,00	17,43942400	2,8080055000
3875	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.880,09	5.299,16697100	2,8080055000
3890	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	140.390,08	49.996,36930911	2,8080055000
3919	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	737.578,16	0,00	262.669,77041100	2,8080055000
3951	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	10.237,00	0,00	3.645,64812900	2,8080055000
3849	06/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	30.847,17	0,00	10.981,44684439	2,8090260270
3876	06/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	161.631,77	0,00	57.540,14681400	2,8090260270
3891	06/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	70.090,26	0,00	24.951,80155908	2,8090260270
3910	06/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	161.631,77	57.540,14681500	2,8090260270
3920	06/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.007,06	1.070,49915900	2,8090260270
3966	07/05/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	559.980,40	0,00	66.682,79075600	8,3976749270
3850	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	71.935,61	0,00	25.599,64074300	2,8100242000
3877	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.455,78	873,93553400	2,8100242000
3892	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	33.918.275,44	0,00	12.070.456,70282800	2,8100242000
3921	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.744,64	2.044,33826600	2,8100242000
3931	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	24.066,23	8.564,42090400	2,8100242000
3954	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	19.394.329,49	0,00	6.901.837,17634800	2,8100242000
3851	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.489.368,34	0,00	4.443.004,09125300	2,8110188700
3878	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	108.033,37	38.432,10415731	2,8110188700
3893	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	39.519.748,48	14.058.869,86450575	2,8110188700
3911	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	298.343,50	106.133,58138005	2,8110188700
3932	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	86.933,72	30.926,05351300	2,8110188700
3955	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.280.883,08	7.926.265,92364400	2,8110188700
3894	09/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	192.300,37	68.385,10139500	2,8120214210
3852	10/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	62.466,97	0,00	22.206,21704400	2,8130396940

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3895	10/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	77.242,34	27.458,67403300	2,8130396940
3956	10/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.295,81	816,13139200	2,8130396940
3896	13/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	477,67	169,74623900	2,8140240490
3897	14/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	29.961,00	10.643,30155400	2,8150099710
3912	14/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.992,04	0,00	1.062,88788700	2,8150099710
3922	14/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	9.797,90	0,00	3.480,59157905	2,8150099710
3879	15/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	22.064,98	0,00	7.835,55461800	2,8160074270
3898	15/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.559,41	5.880,45679200	2,8160074270
3957	15/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	24.642,44	0,00	8.750,84339700	2,8160074270
3853	16/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.687.231,64	4.503.819,52101667	2,8169937940
3899	16/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.613.272,58	0,00	4.477.564,91578500	2,8169937940
3923	16/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	36.492,14	0,00	12.954,28484000	2,8169937940
3933	16/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	18.157,43	0,00	6.445,67625100	2,8169937940
3944	16/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.369,24	0,00	1.551,02933100	2,8169937940
3958	16/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	14.517,57	0,00	5.153,56832909	2,8169937940
3843	17/05/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	85.989,23	0,00	10.208,28469800	8,4234749070
3880	17/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	84.126,22	29.853,40405502	2,8179774690
3900	17/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.374.784,33	0,00	5.810.828,69190200	2,8179774690
3924	17/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	24.607.951,26	0,00	8.732.486,87425800	2,8179774690
3959	17/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.987.119,81	0,00	2.124.615,92608900	2,8179774690
3881	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.721.038,37	2.384.213,88807757	2,8189745910
3901	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.770.624,17	6.658.670,93301500	2,8189745910
3913	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	76.162,19	27.017,69297359	2,8189745910
3925	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	35.470.058,89	12.582.610,35883200	2,8189745910
3934	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	13.216.277,85	0,00	4.688.328,12193300	2,8189745910
3960	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.912.693,67	2.452.201,48208100	2,8189745910
3882	21/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.239,99	0,00	439,72555900	2,8199179570
3902	21/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	21.795,20	0,00	7.729,01918800	2,8199179570
3935	21/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.696.331,67	2.729.275,03117425	2,8199179570
3845	22/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	85.989,23	0,00	30.482,52196900	2,8209355540

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3903	22/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.808,73	0,00	641,18090000	2,8209355540
3926	22/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.228.539,67	0,00	5.752.892,74049100	2,8209355540
3945	22/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.613.822,06	4.825.995,41868200	2,8209355540
3961	22/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	293,04	0,00	103,88043000	2,8209355540
3847	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	86.018,24	30.482,52196900	2,8218871110
3844	23/05/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	86.018,24	0,00	10.196,49013300	8,4360636720
3858	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	723.450,12	0,00	256.371,03524798	2,8218871110
3864	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	88.675.412,39	0,00	31.424.153,02310700	2,8218871110
3868	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	761.999,81	0,00	270.031,99632900	2,8218871110
3873	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	9.847.232,97	0,00	3.489.591,39138200	2,8218871110
3883	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	275,00	97,45251600	2,8218871110
3904	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.172,85	3.250,60841900	2,8218871110
3914	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	22.060.809,22	0,00	7.817.750,44579300	2,8218871110
3936	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.354.012,05	1.188.570,59764200	2,8218871110
3946	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	29.157.856,35	0,00	10.332.750,81640900	2,8218871110
3962	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.272,51	0,00	805,31570200	2,8218871110
3855	23/05/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	362.067,19	45.876,74555200	7,8921725080
3856	23/05/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	361.382,93	45.790,04445700	7,8921725080
3861	23/05/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	54.280.913,49	6.877.816,39782700	7,8921725080
3866	23/05/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	761.999,81	96.551,33731900	7,8921725080
3871	23/05/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	1.147.955,45	145.454,93637352	7,8921725080
3941	23/05/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	26.878.190,69	3.405.677,03794500	7,8921725080
3860	23/05/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	34.394.498,90	1.269.756,89774800	27,0874676570
3870	23/05/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	8.699.277,52	321.155,06809900	27,0874676570
3940	23/05/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	2.279.665,66	84.159,42342300	27,0874676570
3841	24/05/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	23.121,22	0,00	2.739,71465200	8,4392803390
3859	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	723.701,65	256.371,03524700	2,8228682460
3865	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	88.706.243,35	31.424.152,88977700	2,8228682460
3869	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	762.264,81	270.032,01766100	2,8228682460
3874	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.850.656,73	3.489.591,39138200	2,8228682460

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3884	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	18.589,75	0,00	6.585,41185000	2,8228682460
3905	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	8.895,14	0,00	3.151,09995300	2,8228682460
3915	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.060.674,73	7.814.985,61304090	2,8228682460
3947	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.861.073,52	5.973.028,86661200	2,8228682460
3863	24/05/2024	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	3.566.853,38	902.677,54288100	3,9514147750
3943	24/05/2024	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	720.285,41	182.285,44736900	3,9514147750
3857	24/05/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	723.701,65	0,00	85.753,95305398	8,4392803390
3867	24/05/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	762.264,81	0,00	90.323,43747100	8,4392803390
3862	24/05/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	92.273.096,73	0,00	26.242.371,83038600	3,5161873830
3872	24/05/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	9.850.656,73	0,00	2.801.516,43158300	3,5161873830
3942	24/05/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	29.878.141,66	0,00	8.497.312,11836200	3,5161873830
3885	27/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.758.473,88	0,00	976.836,94996500	2,8238836380
3906	27/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.027.744,12	0,00	1.780.436,01101102	2,8238836380
3927	27/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.704.519,07	957.730,35177700	2,8238836380
3937	27/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	267.514,58	94.732,86236000	2,8238836380
3948	27/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	660.891,49	234.036,37497900	2,8238836380
3952	27/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	14.573,55	0,00	5.160,81817300	2,8238836380
3963	27/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	591,93	0,00	209,61557700	2,8238836380
3967	28/05/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	182.266,66	0,00	21.580,82726400	8,4457679850
3886	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.484.591,31	0,00	1.941.519,57347800	2,8248962230
3907	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	96.146.689,04	0,00	34.035.476,50960900	2,8248962230
3916	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.548.929,31	0,00	1.610.299,61842956	2,8248962230
3928	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.139.792,89	1.111.471,94167200	2,8248962230
3938	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	501.484,53	177.523,16914050	2,8248962230
3949	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.504.816,43	1.594.683,86602000	2,8248962230
3953	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	345.803,78	0,00	122.412,91456400	2,8248962230
3964	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	11.761.482,23	0,00	4.163.509,48903500	2,8248962230
3854	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	182,03	0,00	64,41516700	2,8258872320
3887	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	774.570,11	0,00	274.098,02529500	2,8258872320
3908	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	103.872.321,35	36.757.419,11204500	2,8258872320

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3917	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.547.107,41	1.255.219,02283800	2,8258872320
3929	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.775.220,46	3.105.297,46574100	2,8258872320
3939	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.685.452,92	596.433,18421000	2,8258872320
3965	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.929.599,62	2.806.056,63602100	2,8258872320
3846	31/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	19.669,25	0,00	6.957,99516800	2,8268559440
3888	31/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	53,96	0,00	19,08834446	2,8268559440
3909	31/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.398,80	0,00	1.202,32515100	2,8268559440
3930	31/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.460.815,34	0,00	516.763,27656500	2,8268559440
3950	31/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	213.420,41	0,00	75.497,44812800	2,8268559440
Total			571.244.851,66	578.452.947,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.206.794,74

Value-At-Risk: 0,30%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,90	0,26	5,00	0,25	0,13	0,95	718.352.334,02	98,72
Artigo 8º	8,96	6,14	20,00	0,06	-0,38	-2,54	9.341.934,72	1,28
ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO		0,30		0,30			727.694.268,74	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,26%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV IRF-M 1+	3,93	1,79	0,03	0,06	-0,07	0,56	12.620.818,17	1,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,74	0,34	0,05	0,35	-0,15	0,72	132.001.035,99	18,14
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,70	1,18	0,13	0,02	0,17	1,31	83.202.021,49	11,43
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,15	0,55	0,03	0,01	0,17	1,03	45.485.902,72	6,25
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,32	1,90	0,01	0,03	0,17	1,57	4.286.457,68	0,59
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-2,58	0,81	11.306.091,97	1,55
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,01	0,00	0,00	-0,96	0,82	321.997.466,99	44,25
Sub-total	1,06	0,30	0,25		0,15	0,99	610.899.795,01	83,95

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	0,01	-0,00	0,01	-6,27	0,75	107.452.539,01	14,77
Sub-total	0,01	0,01	-0,00		-6,27	0,75	107.452.539,01	14,77

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,14%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	8,96	6,14	0,06	1,55	-0,38	-2,54	9.341.934,72	1,28
Sub-total	8,96	6,14	0,06		-0,38	-2,54	9.341.934,72	1,28

(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 (%)