



**LDB**  
EMPRESAS

**ESTADO DE SANTA CATARINA**  
MARÇO 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 31.03.2022.

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 91,39%

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                          | 3,55                | 0,84            | 1,29            | 8.598.586,31          | 1,31         | 4.149.479.304,06 | 0,21    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,72                | 0,87            | 2,23            | 35.363.673,44         | 5,40         | 5.022.847.839,72 | 0,70    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI      | 5,56                | 3,01            | 2,76            | 52.879.468,39         | 8,07         | 6.731.035.549,75 | 0,79    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RF IDKA2                          | 2,60                | 2,62            | 3,82            | 41.755.026,18         | 6,37         | 8.945.530.970,72 | 0,47    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI    | 8,77                | 3,52            | 1,82            | 9.377.733,11          | 1,43         | 945.847.891,90   | 0,99    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI              | 2,71                | 2,58            | 3,74            | 34.381.460,49         | 5,25         | 6.475.752.452,47 | 0,53    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RF IPCA                           | 2,36                | 2,41            | 3,92            | 52.202.466,66         | 7,97         | 1.781.925.104,48 | 2,93    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI          | 2,65                | 1,34            | 2,01            | 103.555.834,07        | 15,80        | 6.199.415.029,16 | 1,67    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |        |   | <b>2,96</b>         | <b>2,04</b>     | <b>2,79</b>     | <b>338.114.248,65</b> | <b>51,60</b> |                  |         |

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                | 0,96            | 2,57            | 88.338.567,85         | 13,48        | 8.356.230.168,64 | 1,06    |
| BB                                       | BB     | BB PREV RF FLUXO FIC                           | 0,17                | 0,83            | 2,18            | 132.047.340,03        | 20,15        | 3.423.570.144,27 | 3,86    |
| BB                                       | BB     | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 2,37                | 1,36            | 2,23            | 40.409.009,94         | 6,17         | 3.936.333.550,68 | 1,03    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |  | <b>0,28</b>         | <b>0,96</b>     | <b>2,30</b>     | <b>260.794.917,82</b> | <b>39,80</b> |                  |         |
| <b>Renda Fixa</b>                        |        |  | <b>1,95</b>         | <b>1,57</b>     | <b>2,53</b>     | <b>598.909.166,47</b> | <b>91,39</b> |                  |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,43%

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 | 18,36               | 5,00            | 12,70           | 9.361.508,18        | 1,43        | 487.959.895,73 | 1,92    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I</b> |        |                       | <b>18,36</b>        | <b>5,00</b>     | <b>12,70</b>    | <b>9.361.508,18</b> | <b>1,43</b> |                |         |
| Renda Variável               |        |                       | 8,98                | 5,00            | 12,70           | 9.361.508,18        | 1,43        |                |         |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,18%

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               | 1,21                | 1,19            | 2,84            | 12.090.416,70         | 1,84          | 311.358.405,30    | 3,88    |
| BB                                | BB     | BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI | 0,31                | 0,95            | 2,39            | 18.110.373,32         | 2,76          | 17.061.073.059,43 | 0,11    |
| BB                                | BB     | BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI       | 2,12                | 1,27            | 3,57            | 15.686.930,59         | 2,39          | 2.321.633.596,59  | 0,68    |
| BB                                | BB     | BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI         | 3,64                | 1,55            | 3,31            | 1.153.831,70          | 0,18          | 118.888.245,21    | 0,97    |
| <b>Sub-total Artigo 10º I</b>     |        |  | <b>0,73</b>         | <b>1,13</b>     | <b>2,92</b>     | <b>47.041.552,31</b>  | <b>7,18</b>   |                   |         |
| <b>Investimentos Estruturados</b> |        |  | <b>0,73</b>         | <b>1,13</b>     | <b>2,92</b>     | <b>47.041.552,31</b>  | <b>7,18</b>   |                   |         |
| <b>Total</b>                      |        |  | <b>1,94</b>         | <b>1,58</b>     | <b>2,69</b>     | <b>655.312.226,96</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            | 338.114.248,65        | 51,60        | 0,00                      | 44,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a           | Fundos Renda Fixa                       | 260.794.917,82        | 39,80        | 0,00                      | 47,00    | 60,00  | 0,00 | 60,00        |
|                                   | <b>Total Renda Fixa</b>                 | <b>598.909.166,47</b> | <b>91,39</b> |                           |          |        |      | 100,00       |
| <b>Renda Variável</b>             |   |                       |              |                           |          |        |      |              |
| Artigo 8º I                       | Fundos de Ações                         | 9.361.508,18          | 1,43         | 0,00                      | 4,00     | 30,00  | 0,00 | 30,00        |
|                                   | <b>Total Renda Variável</b>             | <b>9.361.508,18</b>   | <b>1,43</b>  |                           |          |        |      | 30,00        |
| <b>Investimentos Estruturados</b> |   |                       |              |                           |          |        |      |              |
| Artigo 10º I                      | Fundos Multimercados                    | 47.041.552,31         | 7,18         | 0,00                      | 5,00     | 10,00  | 0,00 | 10,00        |
|                                   | <b>Total Investimentos Estruturados</b> | <b>47.041.552,31</b>  | <b>7,18</b>  |                           |          |        |      | 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<br>% do CDI       | 2,04<br>221,31 | 2,79<br>114,88 | 2,79<br>114,88 | 4,04<br>93,76 | 5,22<br>81,41 | 6.771.724,24         | 9.137.985,55         |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI     | 0,96<br>103,81 | 2,30<br>94,97  | 2,30<br>94,97  |               |               | 2.476.314,29         | 5.868.469,13         |
| Artigo 8º I<br>Var. IBOVESPA p.p.       | 5,00<br>-1,06  | 12,70<br>-1,77 | 12,70<br>-1,77 |               |               | 446.146,89           | 1.055.286,13         |
| Artigo 10º I<br>% do CDI                | 1,13<br>122,61 | 2,92<br>120,38 | 2,92<br>120,38 |               |               | 526.656,09           | 1.334.022,63         |
| <b>ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)</b> |                |                |                |               |               | <b>10.220.841,51</b> | <b>17.395.763,44</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 RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI          | 102.184.130,81 | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 103.555.834,07 | 1.371.703,26                | 2.035.881,63                |
| BB PREV RF IDKA2                          | 40.688.910,55  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 41.755.026,18  | 1.066.115,63                | 1.561.289,99                |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI      | 51.334.393,09  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 52.879.468,39  | 1.545.075,30                | 1.422.395,38                |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI              | 33.517.156,21  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 34.381.460,49  | 864.304,28                  | 1.239.466,36                |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI    | 9.058.670,59   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 9.377.733,11   | 319.062,52                  | 167.227,44                  |
| BB PREV RF IPCA                           | 50.973.030,50  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 52.202.466,66  | 1.229.436,16                | 1.969.016,38                |
| BB PREV RF IRF M                          | 8.526.592,54   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 8.598.586,31   | 71.993,77                   | 88.708,72                   |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 35.059.640,12  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 35.363.673,44  | 304.033,32                  | 694.300,15                  |
|   |                |            |          |             | 338.114.248,65 | 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 | 39.866.428,77  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 40.409.009,94  | 542.581,17                  | 882.914,74                  |
| BB PREV RF FLUXO FIC                           | 130.956.690,07 | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 132.047.340,03 | 1.090.649,96                | 2.774.822,14                |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | 87.495.484,69  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 88.338.567,85  | 843.083,16                  | 2.210.732,25                |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo          | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------|----------------|------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
|       |                |            |          |             | 260.794.917,82 | 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 | 8.915.361,29   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 9.361.508,18 | 446.146,89                  | 1.055.286,13                |
|                       |                |            |          |             | 9.361.508,18 | 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 | 17.939.949,38  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 18.110.373,32 | 170.423,94                  | 422.185,32                  |
| BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI       | 15.490.047,15  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 15.686.930,59 | 196.883,44                  | 540.720,32                  |
| BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI         | 1.136.180,76   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.153.831,70  | 17.650,94                   | 37.016,61                   |
| BB PREV MULTIMERCADO FI LP               | 11.948.718,93  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 12.090.416,70 | 141.697,77                  | 334.100,38                  |
|  |                |            |          |             | 47.041.552,31 | 0,00                        | 0,00                        |



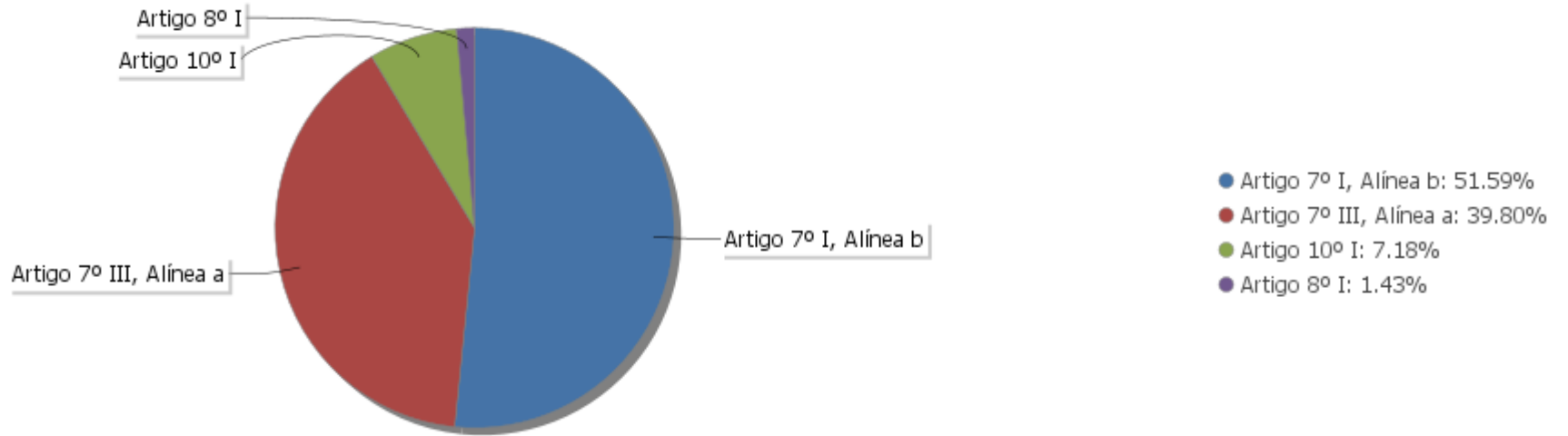
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

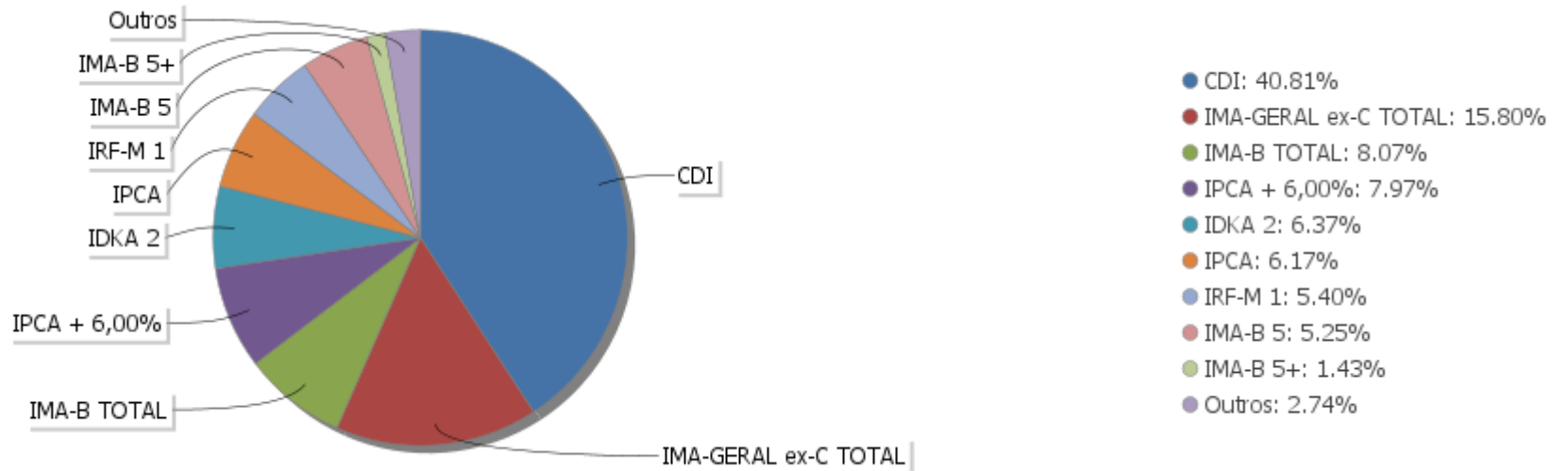
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 603.109.760,30 | 92,03 | 603.109.760,30        | 92,03     |
| de 31 a 365 dias  | 0,00           | 0,00  | 603.109.760,30        | 92,03     |
| acima de 365 dias | 52.202.466,66  | 7,97  | 655.312.226,96        | 100,00    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

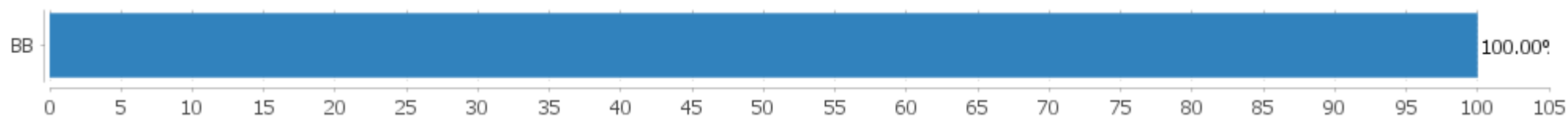


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**
**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

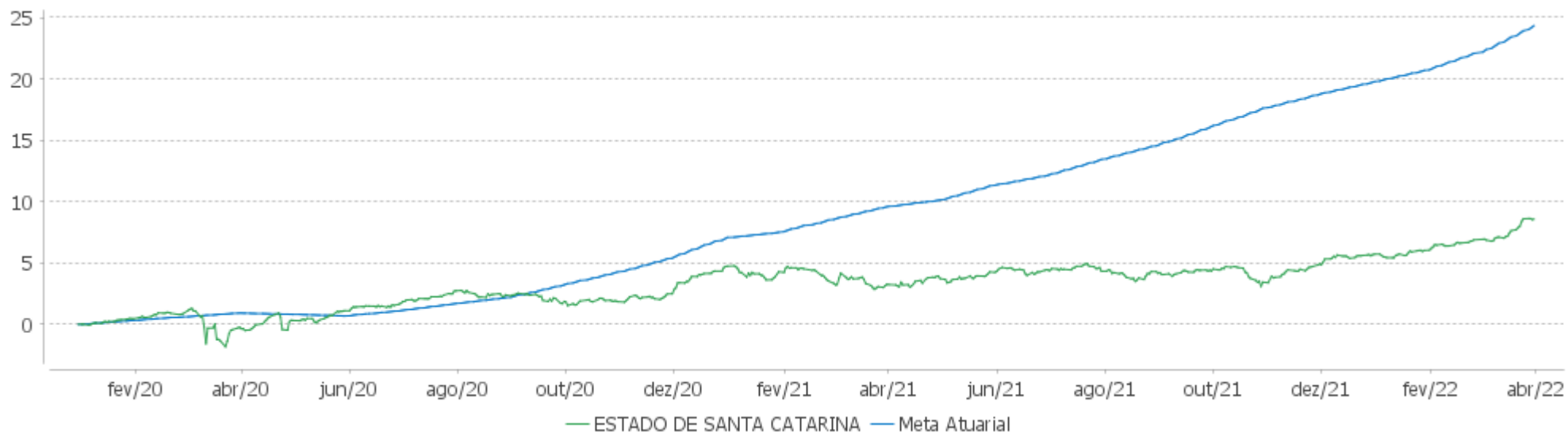
| Ano            | Jan   | Fev   | Mar   | Abr   | Mai   | Jun   | Jul   | Ago   | Set   | Out   | Nov   | Dez   | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2022           | 0,31  | 0,78  | 1,58  |       |       |       |       |       |       |       |       |       | 2,69      |
| INPC + 1,55%   | 0,80  | 1,12  | 1,85  |       |       |       |       |       |       |       |       |       | 3,81      |
| p.p. indexador | -0,49 | -0,33 | -0,26 |       |       |       |       |       |       |       |       |       | -1,11     |
| 2021           | -0,44 | -0,71 | -0,27 | 0,46  | 0,49  | 0,18  | -0,09 | -0,16 | 0,17  | -0,87 | 1,43  | 0,77  | 0,94      |
| IPCA + 2,89%   | 0,48  | 1,07  | 1,19  | 0,54  | 1,07  | 0,77  | 1,21  | 1,12  | 1,40  | 1,48  | 1,18  | 0,99  | 13,23     |
| p.p. indexador | -0,91 | -1,78 | -1,46 | -0,08 | -0,58 | -0,59 | -1,31 | -1,28 | -1,23 | -2,35 | 0,25  | -0,22 | -12,29    |
| 2020           | 0,46  | 0,40  | -1,10 | 0,57  | 0,79  | 0,60  | 0,99  | -0,41 | -0,44 | -0,00 | 0,62  | 2,20  | 4,74      |
| IPCA + 3,16%   | 0,48  | 0,47  | 0,34  | -0,06 | -0,13 | 0,52  | 0,65  | 0,50  | 0,90  | 1,12  | 1,14  | 1,63  | 7,81      |
| p.p. indexador | -0,02 | -0,07 | -1,44 | 0,63  | 0,92  | 0,08  | 0,34  | -0,91 | -1,34 | -1,12 | -0,52 | 0,57  | -3,07     |

**Performance Sobre a Meta Atuarial**
**Relatório**

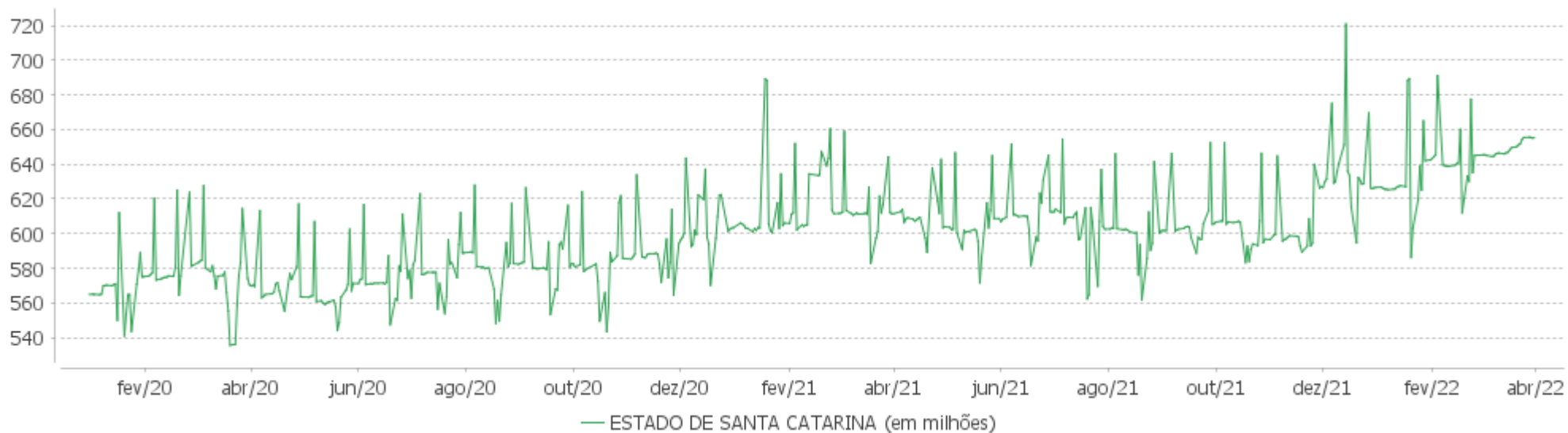
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 6          | 22,22     | 03 meses         | 2,69     | 3,81          | -1,11      | 1,48               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 21         | 77,78     | 06 meses         | 4,05     | 7,64          | -3,59      | 1,91               |
|                                 |            |           | 12 meses         | 5,15     | 14,38         | -9,24      | 1,94               |
|                                 |            |           | 24 meses         | 8,83     | 25,09         | -16,25     | 2,21               |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,20       | 2020-12   | Desde 31/12/2019 | 8,57     | 26,72         | -18,15     | 2,78               |
| Menor rentabilidade da Carteira | -1,10      | 2020-03   |                  |          |               |            |                    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

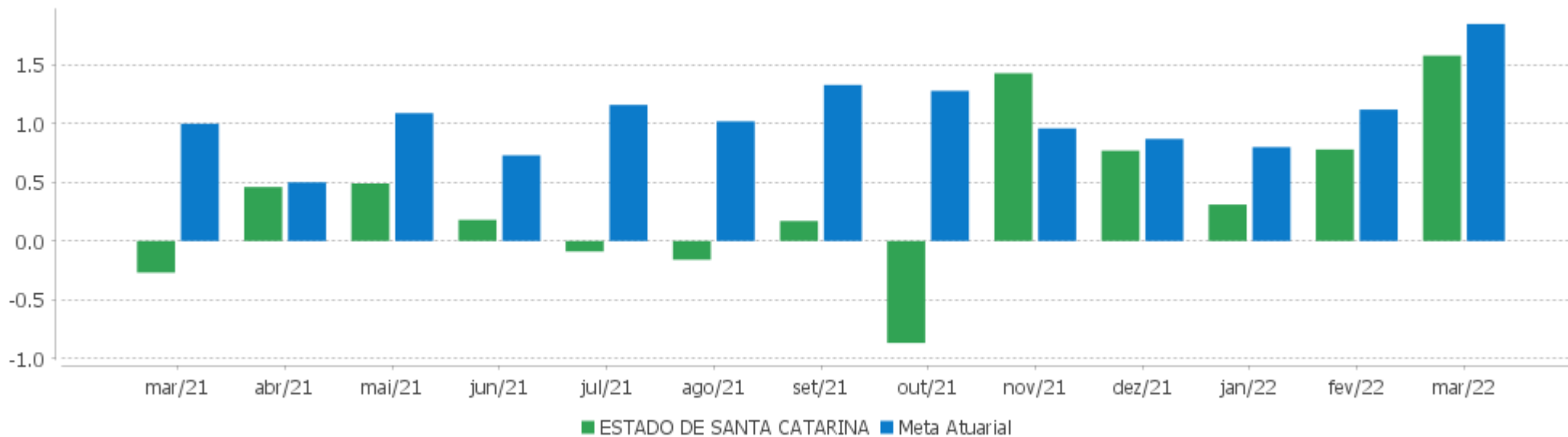


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                    | No Mês         | No Ano         | 3 meses        | 6 meses        | 12 meses       | 24 meses        | 36 meses        |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI<br>% do CDI                     | 0,96<br>104,35 | 2,57<br>105,87 | 2,57<br>105,87 | 4,55<br>105,47 | 6,77<br>105,64 | 9,24<br>105,21  | 14,50<br>98,55  |
| BB PREV RF FLUXO FIC<br>% do CDI                                   | 0,83<br>90,19  | 2,18<br>89,84  | 2,18<br>89,84  | 3,79<br>88,01  | 5,27<br>82,24  | 6,45<br>73,43   | 11,03<br>75,02  |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI<br>Var. IPCA p.p.   | 1,36<br>-0,26  | 2,23<br>-0,97  | 2,23<br>-0,97  | 3,66<br>-2,59  | 4,59<br>-6,71  | 9,58<br>-8,51   |                 |
| BB PREV RF IDKA2<br>Var. IDKA 2 p.p.                               | 2,62<br>0,08   | 3,82<br>-0,06  | 3,82<br>-0,06  | 5,75<br>-0,05  | 8,64<br>-0,45  | 18,02<br>-0,43  | 27,20<br>-2,04  |
| BB PREV RF IPCA<br>Var. IPCA + 6,00% p.p.                          | 2,41<br>0,27   | 3,92<br>-0,77  | 3,92<br>-0,77  | 5,51<br>-3,86  | 8,74<br>-9,24  | 18,49<br>-14,13 | 31,85<br>-13,44 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 1,34           | 2,01           | 2,01           | 3,02           | 3,54           | 8,04            | 17,28           |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br>Var. IRF-M 1 p.p.     | 0,87<br>-0,02  | 2,23<br>-0,04  | 2,23<br>-0,04  | 3,36<br>-0,08  | 4,88<br>-0,26  | 7,10<br>-0,67   | 13,96<br>-0,99  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI<br>Var. IMA-B 5 p.p.                  | 2,58<br>-0,03  | 3,74<br>-0,07  | 3,74<br>-0,07  | 5,75<br>-0,17  | 8,38<br>-0,33  | 17,29<br>-0,67  | 27,99<br>-0,98  |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.      | 3,01<br>-0,06  | 2,76<br>-0,11  | 2,76<br>-0,11  | 3,77<br>-0,20  | 4,18<br>-0,33  | 14,69<br>-0,67  | 24,92<br>-0,98  |
| BB PREV RF IRF M<br>Var. IRF-M TOTAL p.p.                          | 0,84<br>-0,00  | 1,29<br>-0,06  | 1,29<br>-0,06  | 2,23<br>-0,11  | 1,84<br>-0,35  | 3,87<br>-0,62   | 15,16<br>-0,92  |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI<br>Var. IMA-B 5+ p.p.       | 3,52<br>-0,04  | 1,82<br>-0,09  | 1,82<br>-0,09  | 1,82<br>-0,17  | 0,03<br>-0,31  | 11,51<br>-0,88  | 20,62<br>-1,04  |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                        | 5,00<br>-1,06  | 12,70<br>-1,77 | 12,70<br>-1,77 | 6,59<br>-1,54  | 0,34<br>-2,54  | 55,80<br>-8,54  | 17,39<br>-8,38  |
| BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI<br>% do CDI                       | 1,55<br>168,23 | 3,31<br>136,71 | 3,31<br>136,71 | 5,29<br>122,64 | 5,84<br>91,06  | 8,54<br>97,22   |                 |
| BB PREV MULTIMERCADO FI LP<br>% do CDI                             | 1,19<br>128,42 | 2,84<br>117,21 | 2,84<br>117,21 | 4,82<br>111,73 | 6,42<br>100,19 | 9,50<br>108,13  | 16,27<br>110,62 |
| BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI<br>% do CDI               | 0,95<br>102,87 | 2,39<br>98,44  | 2,39<br>98,44  | 4,25<br>98,51  | 6,26<br>97,59  | 10,94<br>124,55 | 16,32<br>110,94 |
| BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI<br>% do CDI                     | 1,27<br>137,64 | 3,57<br>147,25 | 3,57<br>147,25 | 4,91<br>114,00 | 5,93<br>92,45  | 12,68<br>144,38 | 16,70<br>113,57 |
| ESTADO DE SANTA CATARINA   | 1,58           | 2,69           | 2,69           | 4,05           | 5,15           | 8,83            |                 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. INPC + 1,55% p.p.          | -0,26  | -1,11  | -1,11   | -3,02   | -8,32    | -14,37   |          |
| CDI                             | 0,92   | 2,42   | 2,42    | 4,31    | 6,41     | 8,78     | 14,71    |
| IBOVESPA                        | 6,06   | 14,48  | 14,48   | 8,13    | 2,89     | 64,34    | 25,77    |
| INPC + 6,00%                    | 2,23   | 4,91   | 4,91    | 9,38    | 18,43    | 34,19    | 47,02    |
| IPCA + 6,00%                    | 2,14   | 4,69   | 4,69    | 9,37    | 17,98    | 32,62    | 45,29    |



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         | 0,89   | 2,28   | 2,28    | 3,43    | 5,14     | 7,77     | 14,95    | 22,64    | 34,09    |
| IRF-M 1+        | 0,81   | 0,79   | 0,79    | 1,73    | 0,56     | 2,39     | 15,66    | 27,47    | 45,50    |
| IRF-M TOTAL     | 0,84   | 1,35   | 1,35    | 2,35    | 2,19     | 4,49     | 16,08    | 26,70    | 43,00    |
| IMA-B 5         | 2,61   | 3,81   | 3,81    | 5,92    | 8,72     | 17,96    | 28,97    | 40,83    | 57,68    |
| IMA-B 5+        | 3,56   | 1,91   | 1,91    | 1,99    | 0,35     | 12,40    | 21,66    | 42,68    | 57,29    |
| IMA-B TOTAL     | 3,07   | 2,87   | 2,87    | 3,96    | 4,50     | 15,36    | 25,90    | 43,16    | 58,53    |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,57   | 2,54   | 2,54    | 3,91    | 4,91     | 10,14    | 19,47    | 30,83    | 44,94    |
| IDKA 2          | 2,54   | 3,88   | 3,88    | 5,80    | 9,10     | 18,45    | 29,25    | 41,12    | 58,63    |
| IDKA 20         | 4,00   | 0,37   | 0,37    | -2,51   | -7,51    | 6,54     | 12,87    | 41,87    | 51,51    |
| CDI             | 0,92   | 2,42   | 2,42    | 4,31    | 6,41     | 8,78     | 14,71    | 21,98    | 32,24    |

**Renda Variável**

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | 6,06   | 14,48  | 14,48   | 8,13    | 2,89     | 64,34    | 25,77    | 40,57    | 84,66    |
| IBRX 100                 | 5,96   | 14,89  | 14,89   | 8,55    | 2,79     | 66,70    | 29,68    | 46,11    | 91,79    |
| IBRX 50                  | 5,43   | 15,47  | 15,47   | 10,28   | 4,13     | 71,54    | 27,56    | 41,05    | 86,31    |
| SMALL CAP                | 8,81   | 6,69   | 6,69    | -5,35   | -9,80    | 48,46    | 30,68    | 46,05    | 95,46    |
| IFIX                     | 1,42   | -0,88  | -0,88   | 2,37    | -2,35    | 11,46    | 11,96    | 17,92    | 36,76    |
| Índice Consumo - ICON    | 5,74   |        |         | -11,99  | -18,58   | 22,89    | 14,32    | 13,52    | 40,45    |
| Índice Dividendos - IDIV | 10,00  | 15,48  | 15,48   | 13,37   | 11,66    | 55,59    | 43,49    | 63,17    | 97,87    |

**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      | 1,62   | 3,20   | 3,20    | 6,25    | 11,30    | 18,09    | 21,99    | 27,57    | 30,99    |
| INPC      | 1,71   | 3,42   | 3,42    | 6,26    | 11,73    | 19,48    | 23,44    | 29,20    | 31,22    |
| IGPM      | 1,74   | 5,49   | 5,49    | 7,11    | 14,77    | 50,46    | 60,70    | 73,99    | 74,34    |
| SELIC     | 0,92   | 2,42   | 2,42    | 4,31    | 6,41     | 8,78     | 14,71    | 21,99    | 32,26    |

**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   | -4,75  | -19,30 | -19,30  | -8,39   | -5,17    | 59,75    | 94,34    | 144,53   | 186,72   |
| MSCI ACWI | -6,10  | -19,97 | -19,97  | -12,65  | -12,11   | 46,60    | 70,12    | 100,67   | 137,04   |

**Meta Atuarial**

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,97   | 4,20   | 4,20    | 8,34    | 15,75    | 27,68    | 37,22    | 49,19    | 59,20    |
| IPCA + 5,00% | 2,05   | 4,45   | 4,45    | 8,86    | 16,86    | 30,14    | 41,22    | 55,00    | 66,95    |
| IPCA + 5,50% | 2,10   | 4,57   | 4,57    | 9,11    | 17,42    | 31,38    | 43,24    | 57,97    | 70,94    |
| IPCA + 5,89% | 2,13   | 4,66   | 4,66    | 9,31    | 17,85    | 32,35    | 44,84    | 60,31    | 74,11    |
| IPCA + 6,00% | 2,14   | 4,69   | 4,69    | 9,37    | 17,98    | 32,62    | 45,29    | 60,98    | 75,01    |
| INPC + 4,00% | 2,06   | 4,42   | 4,42    | 8,35    | 16,20    | 29,19    | 38,85    | 51,10    | 59,47    |
| INPC + 6,00% | 2,23   | 4,91   | 4,91    | 9,38    | 18,43    | 34,19    | 47,02    | 63,04    | 75,31    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR | Data         | Ativo | Aplicação   | Resgate     | Quantidade | Valor Cota |
|-----|--------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
|     | <b>Total</b> |       | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> |            |            |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.179.923,32

Value-At-Risk: 0,64%

|                          | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| ESTADO DE SANTA CATARINA |                             | 0,64               | 0,64                |        |       | 655.312.226,96 | 100,00     |

## Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,64%

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 IRF M                          |                             | 1,59               | 0,02                | 0,02                |        |       | 8.598.586,31   | 1,31       |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI |                             | 0,33               | 0,01                | 0,01                |        |       | 35.363.673,44  | 5,40       |
| BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI      |                             | 1,95               | 0,15                | 0,03                |        |       | 52.879.468,39  | 8,07       |
| BB PREV RF IDKA2                          |                             | 1,07               | 0,06                | 0,18                |        |       | 41.755.026,18  | 6,37       |
| BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI    |                             | 3,27               | 0,04                | 0,09                |        |       | 9.377.733,11   | 1,43       |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI              |                             | 1,08               | 0,05                | 0,03                |        |       | 34.381.460,49  | 5,25       |
| BB PREV RF IPCA                           |                             | 0,89               | 0,05                | 0,87                |        |       | 52.202.466,66  | 7,97       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI          |                             | 0,96               | 0,14                | 2,46                |        |       | 103.555.834,07 | 15,80      |
| <b>Sub-total</b>                          | 2,85                        | 1,04               | 0,53                |                     | 0,39   | 2,04  | 338.114.248,65 | 51,60      |

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             |                             | 0,04               | 0,00                | 0,02                |        |       | 88.338.567,85  | 13,48      |
| BB PREV RF FLUXO FIC                           |                             | 0,03               | 0,00                | 0,00                |        |       | 132.047.340,03 | 20,15      |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI |                             | 0,76               | 0,05                | 0,75                |        |       | 40.409.009,94  | 6,17       |
| <b>Sub-total</b>                               | 0,32                        | 0,12               | 0,05                |                     | 0,11   | 0,96  | 260.794.917,82 | 39,80      |

## Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,42%

Artigo 10º 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 PREV MULTIMERCADO FI LP               |                             | 0,48               | 0,01                | 0,48                |        |       | 12.090.416,70 | 1,84       |
| BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI |                             | 0,09               | -0,00               | 0,09                |        |       | 18.110.373,32 | 2,76       |
| BB MULTIMERCADO MACRO LP FIC DE FI       |                             | 0,89               | 0,01                | 0,88                |        |       | 15.686.930,59 | 2,39       |
| BB PREV MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI         |                             | 1,22               | 0,00                | 1,22                |        |       | 1.153.831,70  | 0,18       |
| <b>Sub-total</b>                         | 0,94                        | 0,42               | 0,01                |                     | 0,22   | 1,13  | 47.041.552,31 | 7,18       |

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 8,30%

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 |                             | 8,30               | 0,05                | 1,51                |        |       | 9.361.508,18 | 1,43       |
| <b>Sub-total</b>      | 19,10                       | 8,30               | 0,05                |                     | 0,21   | 5,00  | 9.361.508,18 | 1,43       |