



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA
NOVEMBRO 2023



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.11.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 98,66%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,75	0,06	1,09	13,91	126.411.238,75	17,26	6.143.876.019,86	2,06
BB	BB	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI	0,03	0,05	0,89	3,43	8.090.276,99	1,10	10.810.715.327,07	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,60	0,13	2,61	12,68	162.947.756,53	22,25	5.100.554.237,53	3,19
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,04	0,05	0,91	3,96	189.183.421,34	25,83	34.131.194.000,18	0,55
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,19	0,18	3,38	14,37	8.503.590,98	1,16	1.555.151.477,87	0,55
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,06	0,07	1,79	10,34	87.181.856,56	11,91	5.149.230.294,80	1,69
BB	BB	BB PREV IRF-M 1+	4,16	0,14	3,16	16,09	12.326.678,27	1,68	379.003.544,86	3,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,07	0,08	1,61	12,73	594.644.819,42	81,20		

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	0,03	0,04	0,83	11,02	127.853.744,39	17,46	3.918.825.638,18	3,26
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,03	0,04	0,83	11,29	127.853.744,39	17,46		
Renda Fixa			1,39	0,08	1,48	11,98	722.498.563,81	98,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,34%

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	16,80	0,76	10,32	13,69	9.788.410,88	1,34	341.466.472,70	2,87
		Sub-total Artigo 8º I	16,80	0,76	10,32	13,69	9.788.410,88	1,34		
		Renda Variável	16,80	0,76	10,32	13,69	9.788.410,88	1,34		
		Total	1,48	0,08	1,59	11,97	732.286.974,69	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	594.644.819,42	81,20	0,00	44,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	127.853.744,39	17,46	0,00	43,00	70,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	722.498.563,81	98,66					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.788.410,88	1,34	0,00	3,00	40,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	9.788.410,88	1,34					30,00
Total		732.286.974,69	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 98,66% DA CARTEIRA	1,61	12,73	2,22	5,67	13,55	9.484.848,64	55.858.389,81
% do CDI	175,96	105,74	76,10	89,49	101,87		
Artigo 7º III, Alínea a	0,83	11,29	2,65	5,89	12,47	972.443,00	24.220.512,41
% do CDI	90,73	93,77	90,96	93,00	93,72		
Artigo 8º I	10,32	13,69	7,25	15,62	10,61	916.007,45	1.178.822,31
Var. IBOVESPA p.p.	-2,22	-2,34	-2,77	-1,91	-2,59		
Artigo 10º I	0,00	3,54	0,00	0,00	4,37	0,00	1.343.005,22
% do CDI	0,00	29,38	0,00	0,00	32,88		
ESTADO DE SANTA CATARINA (Total)						11.373.299,09	82.600.729,75

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IRF-M 1+	11.949.449,50	0,00	0,00	0,00	12.326.678,27	377.228,77	1.708.724,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	131.254.439,59	0,00	-6.232.716,35	0,00	126.411.238,75	1.389.515,51	19.008.236,63
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	158.806.505,08	0,00	0,00	0,00	162.947.756,53	4.141.251,45	12.004.210,84
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	85.651.291,42	0,00	0,00	0,00	87.181.856,56	1.530.565,14	4.401.979,19
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.225.801,95	0,00	0,00	0,00	8.503.590,98	277.789,03	1.068.480,02
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	8.019.064,39	0,00	0,00	0,00	8.090.276,99	71.212,60	262.140,58
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	187.486.135,20	0,00	0,00	0,00	189.183.421,34	1.697.286,14	6.707.406,05
	591.392.687,13	0,00	-6.232.716,35	0,00	594.644.819,42	9.484.848,64	

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	117.127.203,41	281.302.878,94	-271.548.780,96	0,00	127.853.744,39	972.443,00	14.809.080,56
	117.127.203,41	281.302.878,94	-271.548.780,96	0,00	127.853.744,39	972.443,00	

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	8.872.403,43	0,00	0,00	0,00	9.788.410,88	916.007,45	1.178.822,31
	8.872.403,43	0,00	0,00	0,00	9.788.410,88	916.007,45	

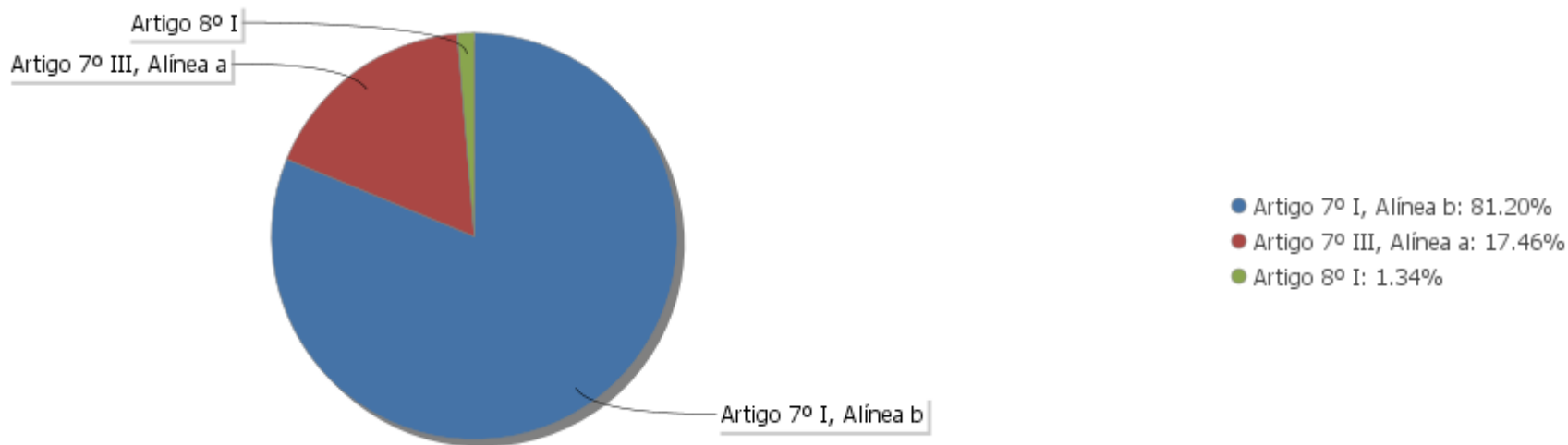
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

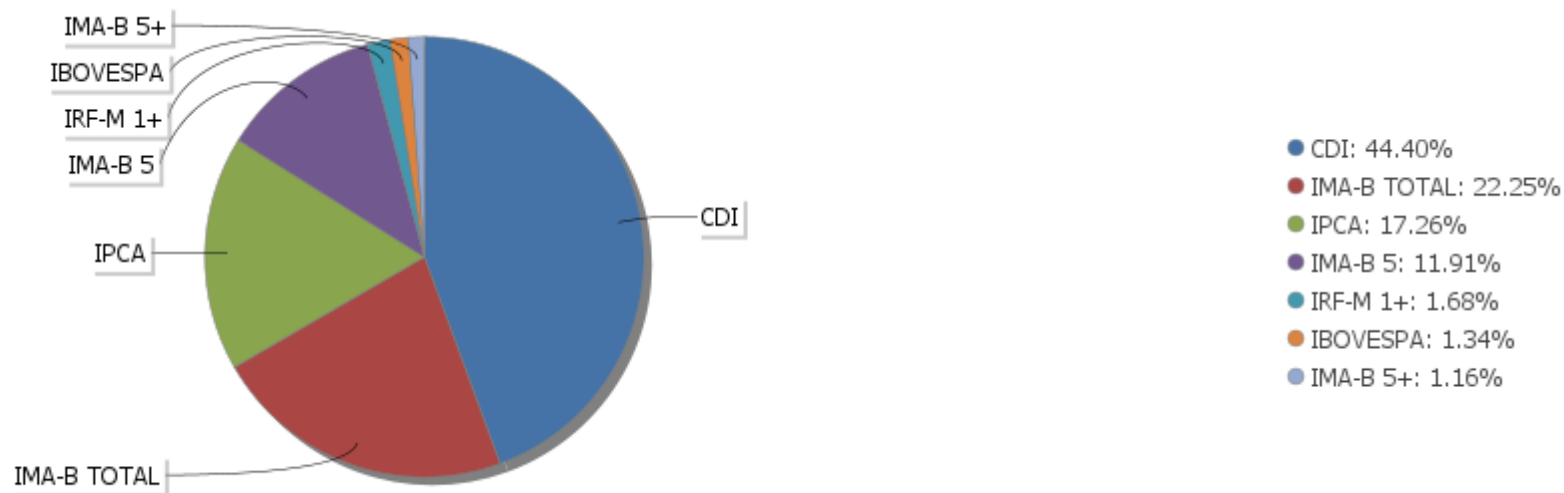
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	732.286.974,69	100,00	732.286.974,69	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	732.286.974,69	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	732.286.974,69	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

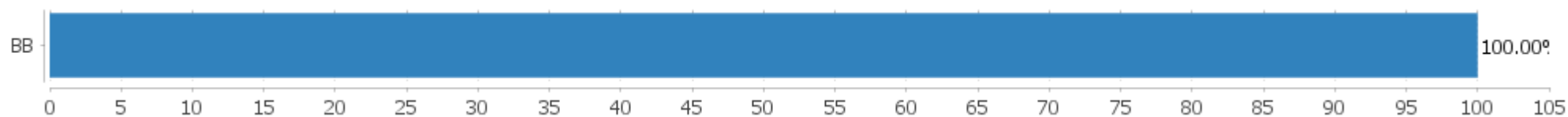


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	0,99	0,88	1,43	1,09	1,47	1,63	0,94	0,58	0,45	0,33	1,59		11,97
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		4,75
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		7,22
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

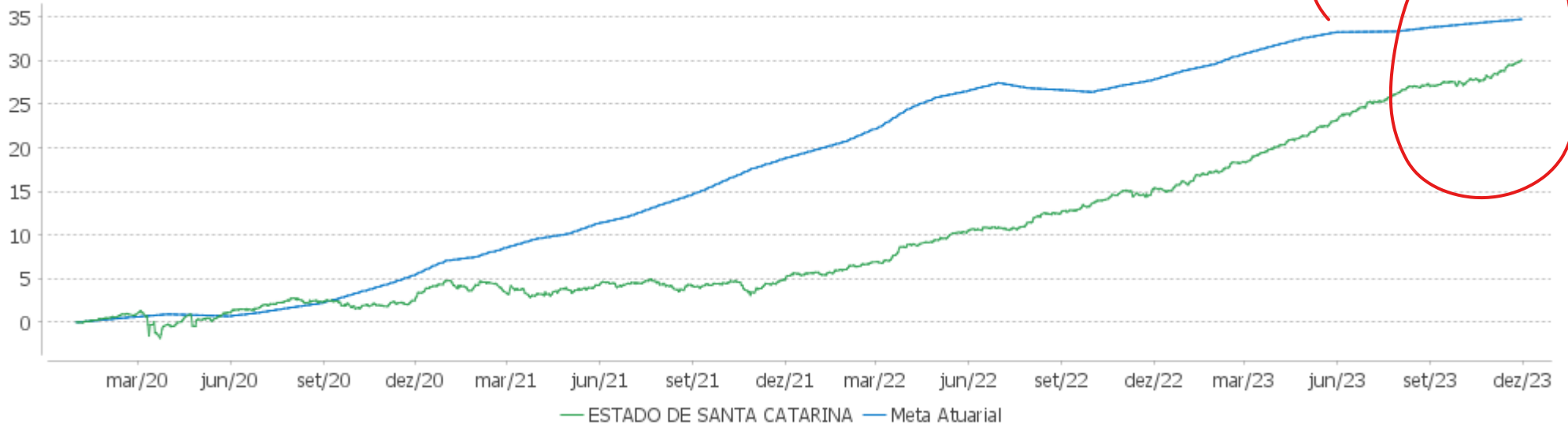
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

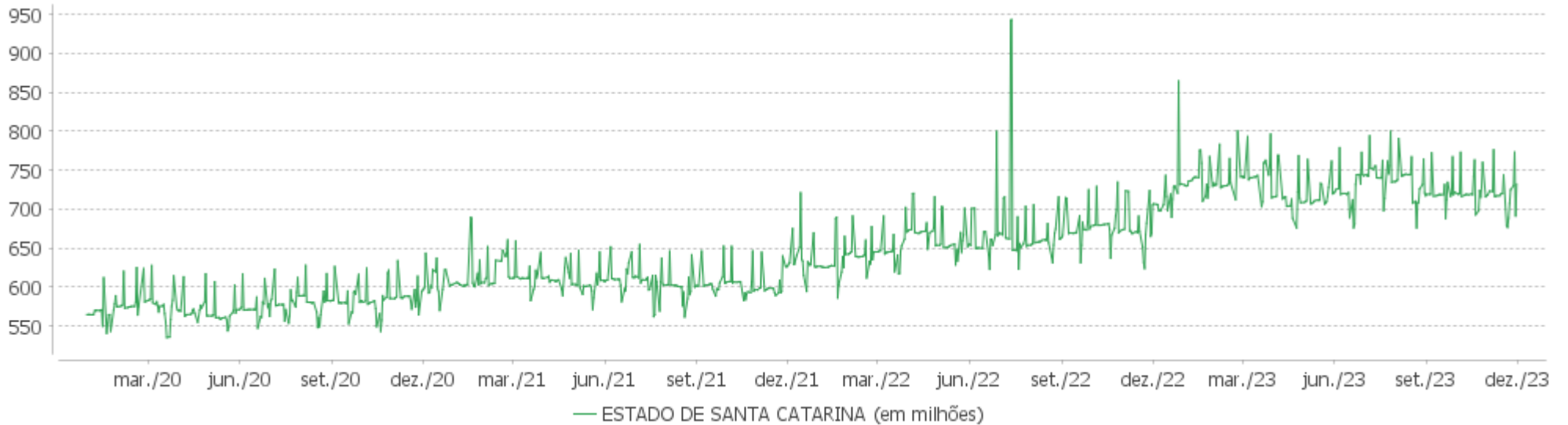
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	44,68	03 meses	2,39	0,75	1,64	1,75
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	55,32	06 meses	5,64	1,20	4,44	1,59
			12 meses	12,82	5,62	7,21	1,48
			24 meses	23,99	13,80	10,19	1,56
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12	36 meses	26,92	29,66	-2,73	1,86
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03	Desde 31/12/2019	30,08	37,54	-7,46	2,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

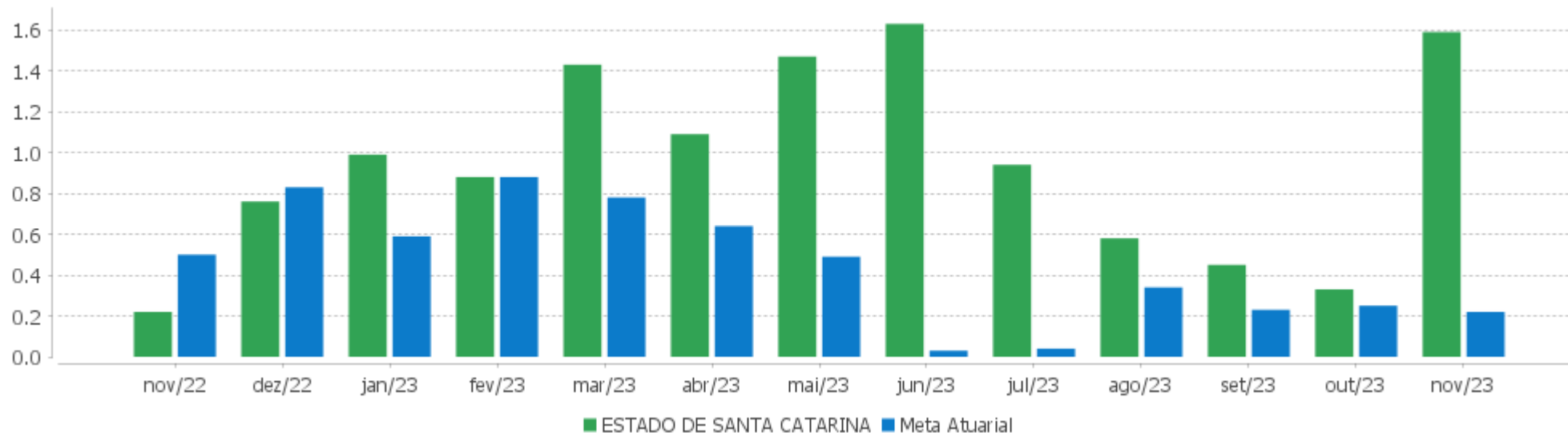


Patrimônio Líquido



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.	3,16 0,02	16,09 -0,41	3,03 -0,08	7,17 -0,16	17,88 -0,51	27,14 -0,86	21,39 -1,13
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,79 -0,02	10,34 -0,17	1,57 -0,05	4,19 -0,13	11,35 -0,20	21,76 -0,52	28,27 -0,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,09 0,81	13,91 9,87	2,85 2,07	6,62 5,57	14,78 10,10	25,45 14,59	28,54 5,78
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI % do CDI	0,89 96,76	11,76 97,68	2,83 97,10	6,19 97,68	12,99 97,68	26,28 97,83	30,86 97,49
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,61 -0,02	12,68 -0,26	0,93 -0,06	3,66 -0,18	12,44 -0,29	19,79 -0,62	23,43 -0,95
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,91 98,64	11,98 99,49	2,89 98,88	6,30 99,45	13,23 99,46	26,81 99,78	31,70 100,14
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	3,38 -0,02	14,37 -0,38	0,35 -0,06	3,04 -0,19	13,01 -0,37	17,36 -0,78	17,96 -1,12
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,83 90,73	11,02 91,50	2,65 90,96	5,80 91,57	12,17 91,47	24,35 90,62	27,69 87,46
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,32 -2,22	13,69 -2,34	7,25 -2,77	15,62 -1,91	10,61 -2,59	21,49 -3,44	11,43 -5,50
ESTADO DE SANTA CATARINA Var. INPC + 1,55% p.p.	1,59 1,36	11,97 7,22	2,39 1,64	5,64 4,44	12,82 7,19	23,99 10,12	26,92 -1,58
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11

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	1,00	12,22	2,91	6,45	13,55	26,81	29,79	34,92	44,24
IRF-M 1+	3,14	16,50	3,11	7,34	18,39	28,00	22,52	29,87	50,14
IRF-M TOTAL	2,47	14,81	3,03	6,96	16,50	27,30	24,84	31,46	48,61
IMA-B 5	1,80	10,51	1,62	4,32	11,55	22,27	29,18	38,75	57,20
IMA-B 5+	3,39	14,75	0,42	3,23	13,39	18,13	19,09	19,90	55,21
IMA-B TOTAL	2,62	12,95	0,99	3,85	12,73	20,41	24,38	28,75	57,75
IMA-GERAL TOTAL	1,84	12,96	2,33	5,79	13,83	24,95	27,59	32,92	50,36
IDKA 2	1,83	10,52	1,71	4,50	11,89	21,85	29,05	39,45	56,01
IDKA 20	4,68	19,28	-0,18	3,26	15,32	14,32	11,40	6,27	50,57
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66	35,59	43,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93	17,65	42,26
IBRX 100	12,38	14,97	9,89	17,42	11,95	23,34	15,95	17,94	44,76
IBRX 50	12,01	14,01	9,98	18,15	11,10	25,06	17,97	19,06	41,25
SMALL CAP	12,46	9,41	1,19	4,49	6,11	-3,54	-16,27	-12,84	24,96
Índice Consumo - ICON	16,33	0,95	1,71	2,02	-4,39	-24,66	-41,54	-39,36	-12,99
Índice Dividendos - IDIV	10,70	18,65	8,63	18,08	16,73	35,80	36,27	36,20	80,93

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	6,29	12,53	1,61	5,84	4,37	-12,16	16,75	69,92	111,42

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,66	10,79	-1,13	5,41	10,79	23,20	13,10	9,91	38,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,44	8,50	1,48	4,05	2,60	-16,06	3,97	48,41	80,72

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,28	4,04	0,78	1,05	4,68	10,86	22,77	28,06	32,25
INPC	0,10	3,14	0,33	0,34	3,85	10,06	22,12	28,46	32,79
IGPM	0,59	-3,89	1,46	-1,35	-3,46	2,23	20,51	50,06	56,02
SELIC	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,65	35,58	43,84

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	7,81	1,74	3,06	8,85	19,89	38,03	49,69	60,78
IPCA + 5,00%	0,67	8,75	1,98	3,55	9,90	22,20	42,03	55,50	68,63
IPCA + 5,50%	0,71	9,23	2,10	3,80	10,42	23,36	44,06	58,47	72,66
IPCA + 5,89%	0,74	9,59	2,19	3,99	10,82	24,28	45,66	60,82	75,87
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11	61,48	76,78
INPC + 4,00%	0,41	6,88	1,29	2,33	7,99	19,02	37,30	50,17	61,43
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34	62,00	77,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3323	01/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	466.399,63	174.305,47780600	2,6757600270
3361	01/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.838,05	0,00	1.434,37750800	2,6757600270
3298	01/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	65,41	0,00	24,44539000	2,6757600270
3324	03/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	22.701,85	0,00	8.480,47459200	2,6769551340
3351	03/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.469.683,57	0,00	1.296.130,63959500	2,6769551340
3378	03/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	120.099,61	0,00	44.864,25957400	2,6769551340
3310	03/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.182,14	0,00	6.418,53865300	2,6769551340
3325	06/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.183,56	5.669,51342900	2,6781063650
3299	06/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	21.445,92	0,00	8.007,86715500	2,6781063650
3311	06/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.728,95	1.018,98492000	2,6781063650
3326	07/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	52.352.646,20	0,00	19.540.578,98581400	2,6791757930
3362	07/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.265,37	8.310,52970000	2,6791757930
3300	07/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.564,58	0,00	1.703,72545600	2,6791757930
3327	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	60.012.060,80	22.390.490,23310900	2,6802477380
3343	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	298.803,62	111.483,58256700	2,6802477380
3363	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	80.010,09	29.851,75171100	2,6802477380
3301	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	210.024,39	0,00	78.360,06613200	2,6802477380
3308	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8,43	3,14523200	2,6802477380
3309	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	8,43	0,00	3,14523100	2,6802477380
3312	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	113.949,58	42.514,56997200	2,6802477380
3313	09/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.170,30	0,00	1.555,29843200	2,6813503520
3328	09/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	31.064,11	11.585,24844600	2,6813503520
3352	09/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	6.232.716,35	0,00	2.324.469,21580000	2,6813503520
3360	09/11/2023	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	6.232.716,35	4.703.074,87912700	1,3252428480
3302	09/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.323,84	0,00	493,72138100	2,6813503520
3329	10/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	631,71	235,49790200	2,6824442810
3314	13/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.146,10	0,00	427,08543700	2,6835380000
3330	13/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	8.395.351,79	0,00	3.128.463,91219300	2,6835380000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3379	13/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.033.881,55	2.993.764,77993000	2,6835380000
3315	14/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.960,98	0,00	6.690,25337700	2,6846486950
3331	14/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	32.124,86	0,00	11.966,13175400	2,6846486950
3332	16/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	86.564,05	0,00	32.230,78597800	2,6857567190
3344	16/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	110.688,34	41.213,09246600	2,6857567190
3353	16/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.457,09	542,52493900	2,6857567190
3364	16/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.334,45	0,00	1.241,53091600	2,6857567190
3303	16/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	170.774,05	63.585,07782700	2,6857567190
3316	17/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	74.163,74	27.602,29812300	2,6868683060
3333	17/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	22.712.885,22	0,00	8.453.293,06586400	2,6868683060
3354	17/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	44.195,07	0,00	16.448,54342100	2,6868683060
3365	17/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.635,76	5.447,14453200	2,6868683060
3373	17/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.964,23	0,00	1.475,40911800	2,6868683060
3304	17/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	66.914,35	24.904,21650000	2,6868683060
3317	20/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.769.025,92	2.518.268,49567500	2,6879683130
3334	20/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.123.961,80	9.718.850,35759400	2,6879683130
3345	20/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	76.048,01	28.292,00390200	2,6879683130
3355	20/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	32.984.231,98	12.271.064,29063100	2,6879683130
3366	20/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.119.298,14	0,00	416.410,46681400	2,6879683130
3318	21/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	18.510,75	0,00	6.883,68553300	2,6890754830
3335	21/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	24.121,51	0,00	8.970,18702200	2,6890754830
3367	21/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	9.498.901,24	0,00	3.532.404,09205700	2,6890754830
3374	21/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.272.591,49	4.191.995,18989500	2,6890754830
3336	22/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.877,06	2.184,62963000	2,6901859790
3346	22/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.208.938,70	0,00	7.512.097,25192000	2,6901859790
3368	22/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.124.147,84	3.391.642,03189800	2,6901859790
3337	23/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	236.478,16	0,00	87.868,51168800	2,6912730790
3347	23/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.208.938,70	7.509.062,85121700	2,6912730790
3356	23/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	38.452.037,26	0,00	14.287.675,80668000	2,6912730790
3369	23/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	18.490,79	0,00	6.870,64800000	2,6912730790

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3305	23/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.490,79	6.870,64800100	2,6912730790
3338	24/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	32.284,73	0,00	11.991,17241900	2,6923747630
3348	24/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.571.402,19	0,00	2.069.326,40528500	2,6923747630
3370	24/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.821,42	0,00	1.790,76853100	2,6923747630
3376	24/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	11.614.982,55	0,00	4.314.028,90474900	2,6923747630
3319	27/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	370.163,16	137.429,78134500	2,6934712140
3339	27/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.061.529,34	0,00	1.879.184,49385700	2,6934712140
3320	28/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	834.447,33	309.672,50760400	2,6946122420
3340	28/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	41.254.475,51	0,00	15.309.985,92932200	2,6946122420
3349	28/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	992.458,12	368.312,03559900	2,6946122420
3357	28/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.100.410,44	0,00	1.150.596,13835100	2,6946122420
3371	28/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	430.789,69	159.870,75367900	2,6946122420
3306	28/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4,37	0,00	1,62175400	2,6946122420
3321	29/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	10.211.374,52	0,00	3.788.035,83041900	2,6956911120
3341	29/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	51.495.678,16	19.102.959,50851500	2,6956911120
3350	29/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.638.519,76	978.791,57899600	2,6956911120
3358	29/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	36.420.556,22	13.510.656,34258800	2,6956911120
3372	29/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.300.573,50	482.463,84543500	2,6956911120
3377	29/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	388.870,28	144.256,24592900	2,6956911120
3380	29/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	186.387,11	0,00	69.142,60657300	2,6956911120
3322	30/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.011,02	8.161,80095800	2,6968337150
3342	30/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	555.779,40	206.085,89877400	2,6968337150
3359	30/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	40.887.416,47	0,00	15.161.267,17141600	2,6968337150
3307	30/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	43.016,35	0,00	15.950,68682200	2,6968337150
Total			281.302.878,94	277.781.497,31		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.433.739,16

Value-At-Risk: 0,74%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ESTADO DE SANTA CATARINA		0,74		0,74			732.286.974,69	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,69%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,21	0,03	0,21			126.411.238,75	17,26
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FI		0,02	-0,00	0,02			8.090.276,99	1,10
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,02	0,44	0,04			162.947.756,53	22,25
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,02	-0,00	0,02			189.183.421,34	25,83
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		3,23	0,04	0,04			8.503.590,98	1,16
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,25	0,14	0,02			87.181.856,56	11,91
BB PREV IRF-M 1+		1,92	0,03	0,03			12.326.678,27	1,68
Sub-total	1,52	0,84	0,68		0,46	1,61	594.644.819,42	81,20

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	-0,00	0,02			127.853.744,39	17,46
Sub-total	0,02	0,02	-0,00		-3,97	0,83	127.853.744,39	17,46

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,98%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		6,98	0,06	1,18			9.788.410,88	1,34
Sub-total	13,27	6,98	0,06		0,71	10,32	9.788.410,88	1,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)