



LDB
EMPRESAS

ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO
SETEMBRO 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 30.09.2024.

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 98,70%

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+	3,84	-0,12	0,05	2,11	12.800.195,30	1,69	213.381.167,69	6,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,02	0,71	6,65	136.101.800,34	18,01	6.153.638.080,30	2,21
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,93	-0,25	-0,69	0,60	83.900.851,62	11,10	4.321.577.868,21	1,94
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,77	-0,08	0,38	5,06	46.478.718,13	6,15	4.696.596.123,48	0,99
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,13	-0,36	-1,46	-2,88	4.291.459,97	0,57	1.125.610.778,02	0,38
BB	BB	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	0,04	0,04	0,82	7,80	15.207.378,13	2,01	11.688.156.356,10	0,13
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,04	0,04	0,83	7,97	330.622.262,22	43,76	32.173.775.540,30	1,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,31	-0,02	0,54	5,40	629.402.665,71	83,30		

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	0,04	0,04	0,75	7,19	116.305.771,15	15,39	3.861.447.255,05	3,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,04	0,04	0,75	7,19	116.305.771,15	15,39		
Renda Fixa			1,09	-0,01	0,57	5,74	745.708.436,86	98,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,30%

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	12,34	-0,55	-2,49	-4,99	9.855.677,91	1,30	308.317.813,44	3,20
Sub-total Artigo 8º I			12,34	-0,55	-2,49	-4,99	9.855.677,91	1,30		
Renda Variável			12,34	-0,55	-2,49	-4,99	9.855.677,91	1,30		
Total			1,17	-0,02	0,53	5,59	755.564.114,77	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	629.402.665,71	83,30	0,00	85,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	116.305.771,15	15,39	0,00	13,00	60,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	745.708.436,86	98,70					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.855.677,91	1,30	0,00	2,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	9.855.677,91	1,30					40,00
Total		755.564.114,77	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	0,54 64,20	5,40 67,61	2,47 93,94	3,66 69,99	9,07 82,01	3.357.192,10	32.202.378,05
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,75 90,22	7,19 90,04	2,38 90,26	4,70 89,93	9,96 90,07	821.980,55	9.354.612,56
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,49 0,59	-4,99 -3,23	4,82 -1,57	0,49 -2,41	7,22 -5,86	-251.616,60	-517.991,51
ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO (Total)						3.927.556,05	41.038.999,10

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+	12.793.477,33	0,00	0,00	0,00	12.800.195,30	6.717,97	264.968,74
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	135.146.573,61	0,00	0,00	0,00	136.101.800,34	955.226,73	8.491.862,04
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	84.480.148,39	0,00	0,00	0,00	83.900.851,62	-579.296,77	275.094,01
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	46.302.947,30	0,00	0,00	0,00	46.478.718,13	175.770,83	3.410.939,56
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.355.047,47	0,00	0,00	0,00	4.291.459,97	-63.587,50	-259.315,09
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	13.849.714,87	1.242.872,52	0,00	0,00	15.207.378,13	114.790,74	782.360,12
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	330.324.692,12	700.000,00	-3.150.000,00	0,00	330.622.262,22	2.747.570,10	19.236.468,67
	627.252.601,09	1.942.872,52	-3.150.000,00	0,00	629.402.665,71	3.357.192,10	

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	101.900.923,18	334.064.906,41	-320.482.038,99	0,00	116.305.771,15	821.980,55	9.354.612,56
	101.900.923,18	334.064.906,41	-320.482.038,99	0,00	116.305.771,15	821.980,55	

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	10.107.294,51	0,00	0,00	0,00	9.855.677,91	-251.616,60	-517.991,51
	10.107.294,51	0,00	0,00	0,00	9.855.677,91	-251.616,60	

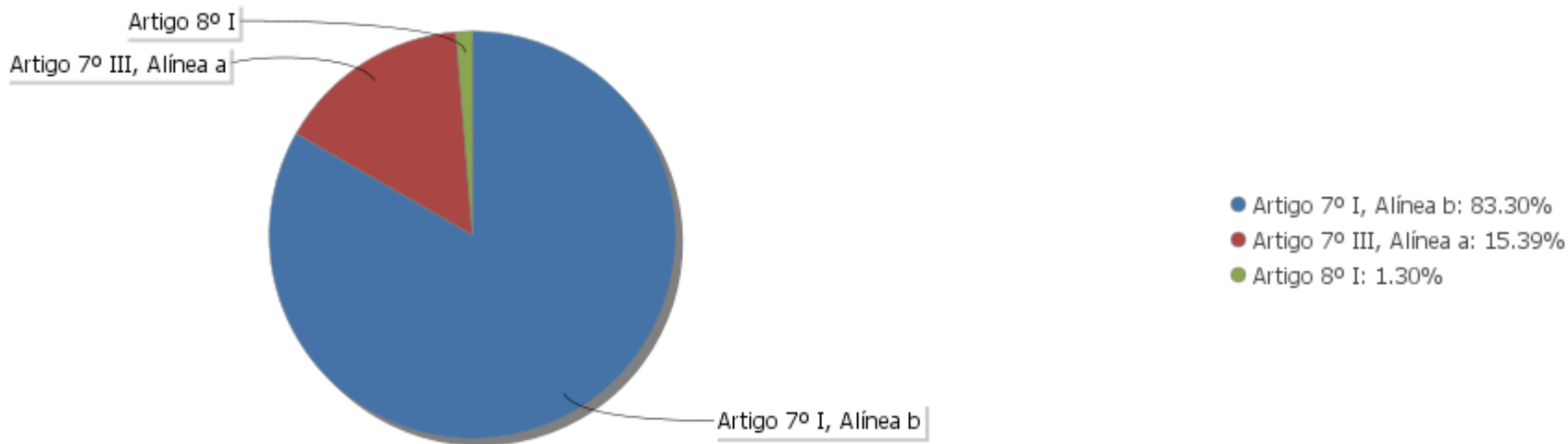
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

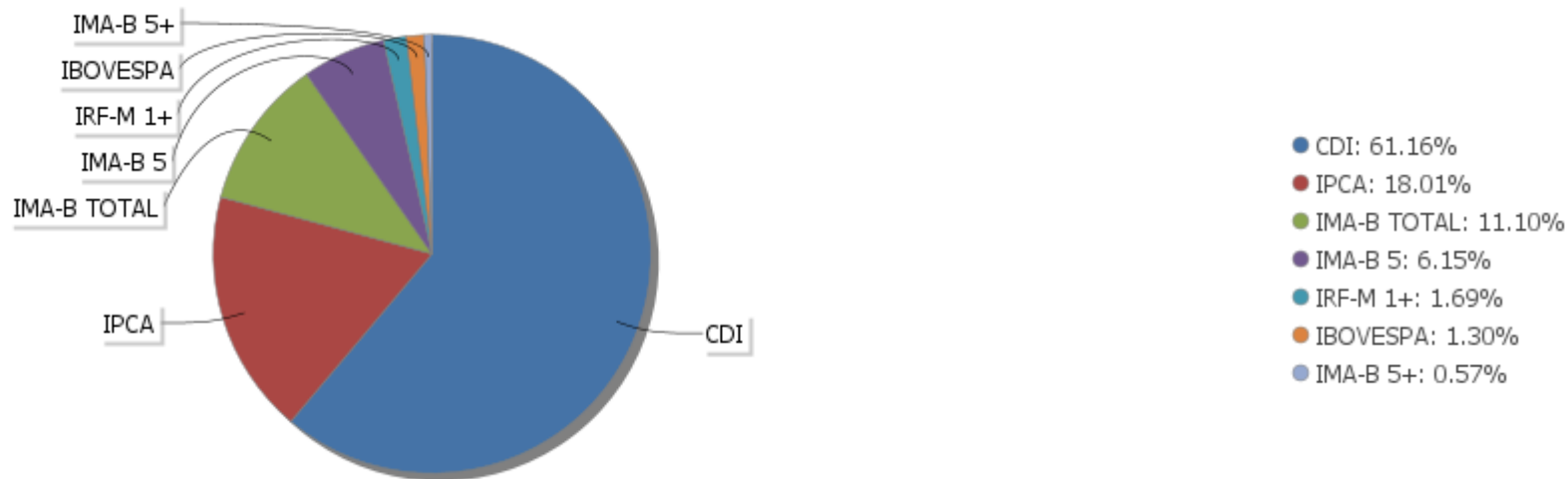
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	755.564.114,77	100,00	80,00	755.564.114,77	100,00	80,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	0,00	755.564.114,77	100,00	80,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	755.564.114,77	100,00	80,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

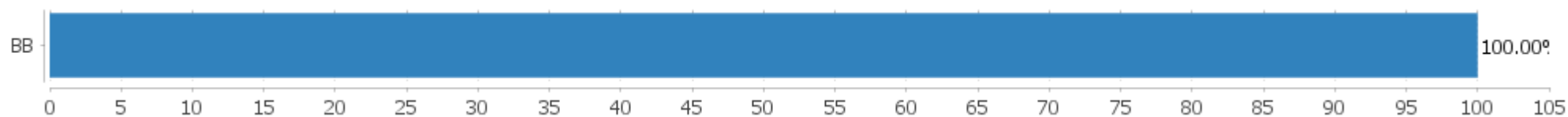


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,46	0,68	0,56	-0,08	0,92	0,44	1,07	0,87	0,53				5,59
INPC + 4,50%	0,96	1,15	0,54	0,76	0,83	0,60	0,66	0,24	0,85				6,78
p.p. indexador	-0,49	-0,47	0,02	-0,83	0,09	-0,16	0,41	0,62	-0,32				-1,19
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	26	45,61
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	54,39

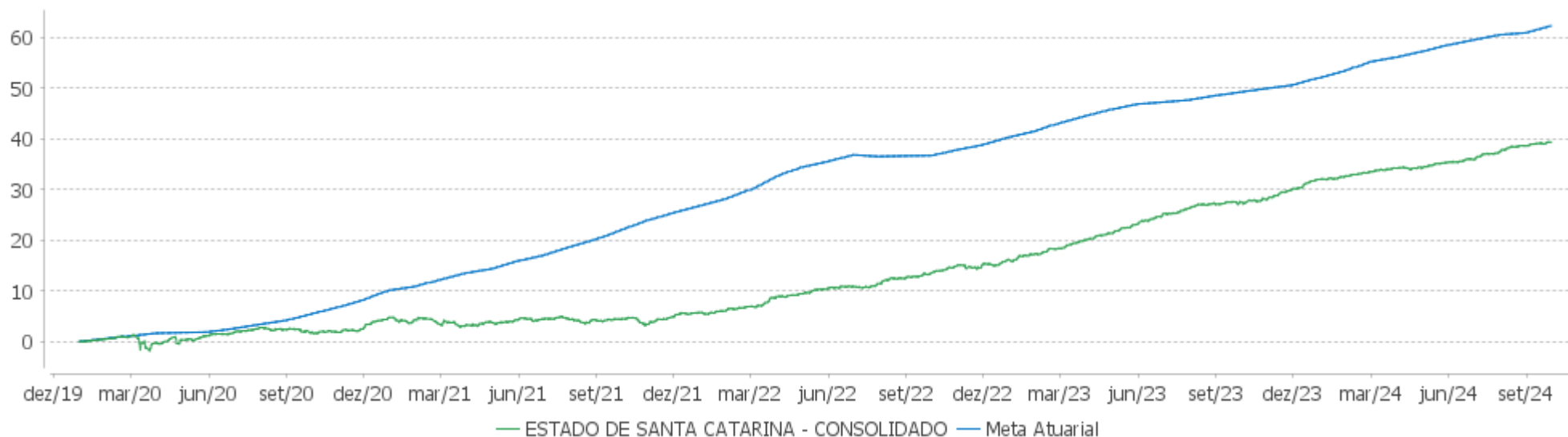
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,20	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-1,10	2020-03

Relatório

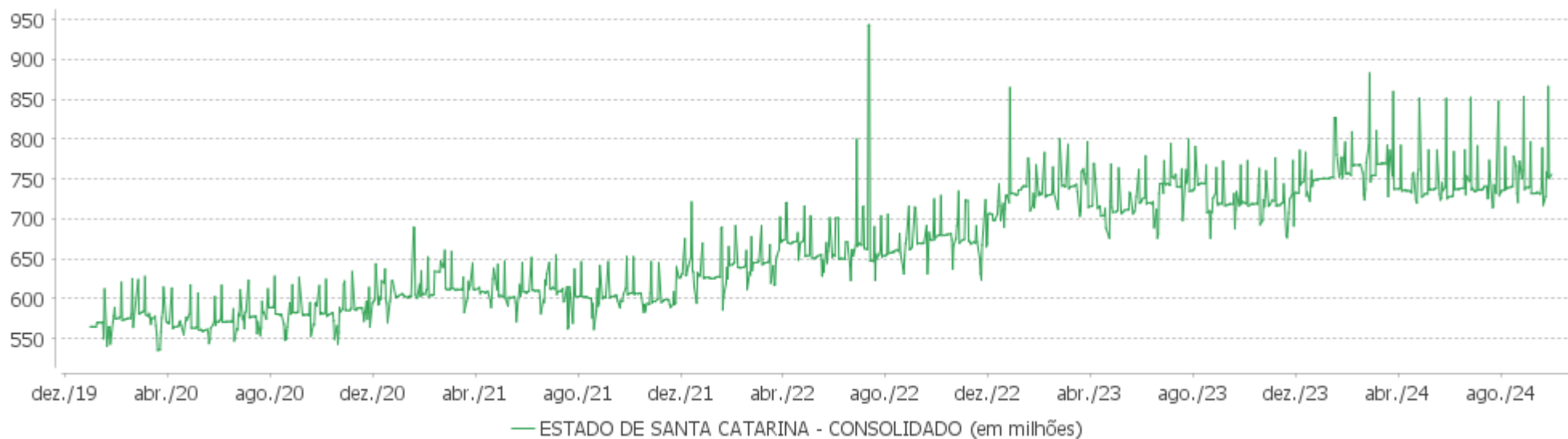
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,49	1,77	0,72	0,92
06 meses	3,81	4,01	-0,20	1,03
12 meses	9,21	8,05	1,16	1,17
24 meses	22,75	14,80	7,95	1,39
36 meses	33,57	25,62	7,95	1,50
48 meses	36,83	42,57	-5,74	1,71
Desde 31/12/2019	39,37	47,88	-8,51	2,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

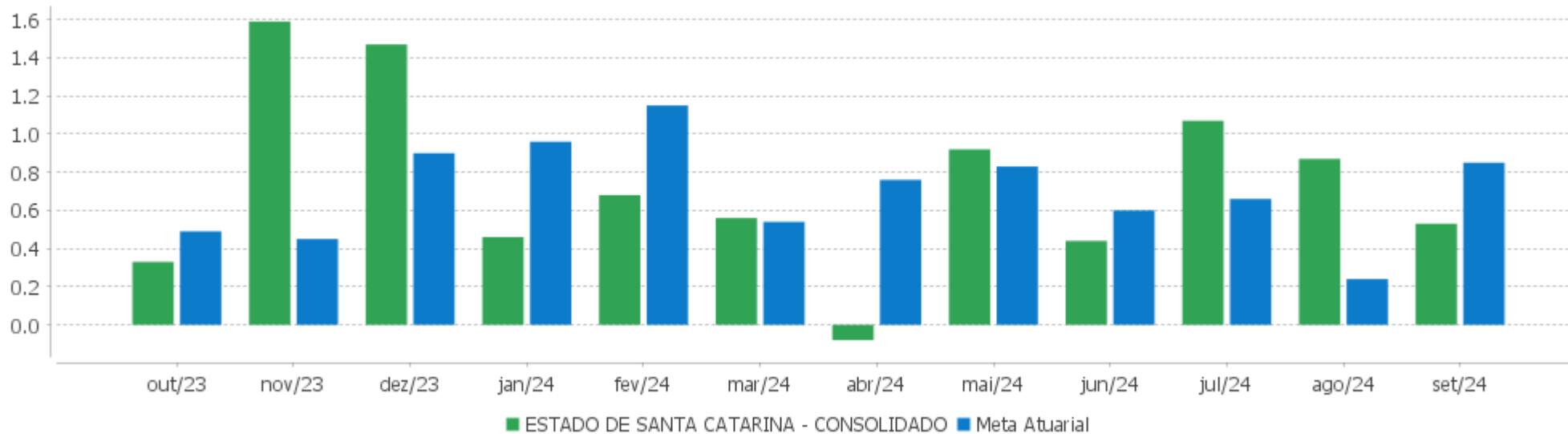


Patrimônio Líquido



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.	0,05 -0,05	2,11 -0,38	2,19 -0,09	0,86 -0,25	7,20 -0,47	21,64 -1,17	30,24 -1,46
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,02	5,06 -0,24	1,80 -0,12	3,00 -0,18	8,13 -0,30	20,47 -0,59	31,28 -0,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	6,65 3,35	2,71 1,91	4,15 2,28	9,77 5,34	24,69 14,85	35,92 18,20
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI % do CDI	0,82 97,84	7,80 97,62	2,58 97,96	5,10 97,57	10,77 97,39	25,35 97,57	38,80 97,70
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,69 -0,02	0,60 -0,22	1,84 -0,09	0,49 -0,15	5,34 -0,28	16,66 -0,62	24,76 -1,01
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,83 99,87	7,97 99,70	2,63 100,06	5,21 99,72	10,99 99,45	25,87 99,58	39,67 99,89
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,46 -0,04	-2,88 -0,26	2,45 -0,10	-1,29 -0,16	3,31 -0,32	13,37 -0,78	18,85 -1,24
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,22	7,19 90,04	2,38 90,26	4,70 89,93	9,96 90,07	23,52 90,51	35,60 89,66
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,49 0,59	-4,99 -3,23	4,82 -1,57	0,49 -2,41	7,22 -5,86	12,41 -7,39	12,21 -6,56
ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO Var. INPC + 4,50% p.p.	0,53 -0,32	5,59 -1,19	2,49 0,72	3,81 -0,20	9,21 0,45	22,75 4,02	33,57 0,58
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4463	02/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.249,88	4.924,09220000	2,8939107430
4388	02/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.059,49	366,11011700	2,8939107430
4409	02/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.797,49	0,00	2.348,89414400	2,8939107430
4462	02/09/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	14.249,88	0,00	1.643,68057700	8,6694946640
4373	03/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.694,01	0,00	930,58696900	2,8949577950
4387	03/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.205,43	1.798,10220700	2,8949577950
4408	03/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	15.456,57	0,00	5.339,13483100	2,8949577950
4446	03/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	84.916,93	0,00	29.332,70051300	2,8949577950
4372	04/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	257,95	0,00	89,07159600	2,8959849320
4407	04/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	29.212,35	0,00	10.087,18991400	2,8959849320
4371	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	286,94	0,00	99,04802300	2,8969785670
4386	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.881,37	4.446,48439800	2,8969785670
4406	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	35.382.184,57	0,00	12.213.478,19864600	2,8969785670
4424	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	277.951,56	95.945,32840700	2,8969785670
4436	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	386.100,99	0,00	133.277,13031700	2,8969785670
4456	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	19.802.511,33	0,00	6.835.573,98579800	2,8969785670
4370	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	149.311,52	0,00	51.522,05919500	2,8980114990
4385	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	112.332,22	38.761,82687300	2,8980114990
4405	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	38.576.143,78	13.311.245,93305200	2,8980114990
4415	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	311.292,79	107.415,99545300	2,8980114990
4435	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.205.884,04	416.107,40344400	2,8980114990
4449	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.695.547,61	585.072,76820200	2,8980114990
4455	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.779.381,66	7.860.348,95577900	2,8980114990
4384	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	32,35	0,00	11,15897700	2,8990111910
4404	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	97.800,05	0,00	33.735,65797300	2,8990111910
4434	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	250.900,28	86.546,84769000	2,8990111910
4383	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	325,00	112,06759400	2,9000355020
4403	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	28.402,13	0,00	9.793,71803500	2,9000355020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4433	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	35.126,12	0,00	12.112,30689200	2,9000355020
4402	11/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	33.400,37	11.513,25172700	2,9010370650
4401	12/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.515,71	0,00	4.312,74231200	2,9020305630
4382	13/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	18.609,15	0,00	6.410,22311800	2,9030424770
4400	13/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.633,16	0,00	907,03460900	2,9030424770
4432	13/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	773.962,36	0,00	266.603,87029500	2,9030424770
4381	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	22.064,98	0,00	7.597,91725100	2,9040826940
4399	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.067,01	0,00	1.056,10284600	2,9040826940
4431	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.983.845,21	683.122,83741000	2,9040826940
4398	17/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	639,13	220,00473400	2,9050738550
4380	18/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	110,00	37,85085900	2,9061427360
4397	18/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	174.296,30	0,00	59.975,13399400	2,9061427360
4423	18/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	9.284.487,92	0,00	3.194.780,42320000	2,9061427360
4369	19/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	190.758,24	65.615,06985400	2,9072321408
4379	19/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	78.469,42	26.991,11196700	2,9072318360
4396	19/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	17.323.411,13	0,00	5.958.730,54067600	2,9072318360
4422	19/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	24.729.462,91	0,00	8.506.188,80949800	2,9072318360
4448	19/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	88.184,50	30.332,80624800	2,9072318360
4454	19/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.143.953,00	0,00	2.113.334,38356000	2,9072318360
4461	19/09/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	235.190,34	0,00	26.993,46730000	8,7128614260
4378	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.339.830,17	2.523.787,83186300	2,9082595919
4395	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.141.738,72	6.581.853,56813100	2,9082595840
4414	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	79.074,51	27.189,63273900	2,9082595840
4421	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	42.629.388,88	14.658.041,22662500	2,9082595840
4430	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.592.253,84	0,00	5.705.217,62613000	2,9082595840
4442	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.785.407,07	3.708.543,46336100	2,9082595840
4453	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.117.040,41	2.447.181,96723400	2,9082595840
4444	20/09/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	1.400.000,00	385.240,83358600	3,6340903610
4445	20/09/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	700.000,00	0,00	192.620,41679300	3,6340903610
4394	23/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	14.078,74	0,00	4.839,24055500	2,9092870750

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4413	23/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	22.211.175,47	0,00	7.634.576,75279400	2,9092870750
4429	23/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.610.034,17	3.990.680,14626900	2,9092870750
4368	24/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	8.734,01	0,00	3.001,02535100	2,9103419590
4393	24/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	65.921,43	0,00	22.650,75064300	2,9103419590
4420	24/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	29.361.400,09	0,00	10.088.642,67623300	2,9103419590
4428	24/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.017,42	0,00	1.036,79225400	2,9103419590
4441	24/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.750.000,00	0,00	601.303,91021100	2,9103419590
4443	24/09/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	1.750.000,00	481.161,84813000	3,6370298410
4460	24/09/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	235.190,34	0,00	26.961,62493900	8,7231515360
4367	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	315,61	0,00	108,40317800	2,9114460020
4377	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.979,89	4.801,69990800	2,9114460020
4392	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.952.036,69	0,00	1.700.885,63778800	2,9114460020
4412	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.211.147,89	7.628.906,00572400	2,9114460020
4419	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	27,58	9,47295600	2,9114460020
4427	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.601,36	6.389,04516400	2,9114460020
4440	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	10.462.972,57	0,00	3.593.737,46338100	2,9114460020
4458	25/09/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	40.076,46	0,00	4.592,47817300	8,7265433800
4366	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	34,91	0,00	11,98643500	2,9124587420
4376	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	893.197,52	306.681,60448700	2,9124587420
4391	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	103.148.204,85	0,00	35.416.194,35239300	2,9124587420
4411	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.049.108,60	360.214,06410700	2,9124587420
4418	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.101.919,68	0,00	1.065.051,88735100	2,9124587420
4426	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	518.849,86	178.148,39829900	2,9124587420
4439	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	851.679,03	292.426,12701000	2,9124587420
4452	26/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	9.658.377,36	0,00	3.316.228,04495600	2,9124587420
4457	26/09/2024	BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FI	718.165,50	0,00	82.264,62658300	8,7299429880
4375	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	10.109.645,53	0,00	3.469.933,55705400	2,9134983030
4390	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	94.544.602,48	32.450.543,17781700	2,9134983030
4410	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.914.216,12	0,00	1.000.246,37632300	2,9134983030
4417	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	26.075.552,11	8.949.911,54899600	2,9134983030

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
4425	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.586.862,75	544.658,88940700	2,9134983030
4438	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	629.371,98	216.019,33982700	2,9134983030
4447	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	531.335,45	0,00	182.370,26239300	2,9134983030
4451	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.760.553,11	1.977.194,59938200	2,9134983030
4374	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.428,92	2.548,88368200	2,9145778810
4389	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	54.487,59	0,00	18.694,84783800	2,9145778810
4416	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.162.018,24	0,00	1.428.000,35200000	2,9145778810
4437	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	452.912,84	0,00	155.395,68969900	2,9145778810
4450	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	293,04	0,00	100,54286100	2,9145778810
Total			336.007.778,93	323.632.038,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.235.936,43

Value-At-Risk: 0,43%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,72	0,40	5,00	0,39	-0,37	0,57	745.708.436,86	98,70
Artigo 8º	11,23	5,64	20,00	0,04	-0,30	-2,49	9.855.677,91	1,30
ESTADO DE SANTA CATARINA - CONSOLIDADO		0,43		0,43			755.564.114,77	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,40%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV IRF-M 1+	4,14	2,06	0,03	0,05	-0,19	0,05	12.800.195,30	1,69
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,37	0,42	0,07	0,43	-0,34	0,71	136.101.800,34	18,01
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,93	2,00	0,21	0,04	-0,39	-0,69	83.900.851,62	11,10
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,02	1,01	0,06	0,04	-0,22	0,38	46.478.718,13	6,15
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,43	3,24	0,02	0,03	-0,42	-1,46	4.291.459,97	0,57
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOURO SELIC FIC FI	0,01	0,00	0,00	0,01	-1,64	0,82	15.207.378,13	2,01
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,01	0,01	0,00	0,01	-0,09	0,83	330.622.262,22	43,76
Sub-total	0,85	0,47	0,39		-0,35	0,54	629.402.665,71	83,30

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	0,01	-0,00	0,01	-4,25	0,75	116.305.771,15	15,39
Sub-total	0,02	0,01	-0,00		-4,25	0,75	116.305.771,15	15,39

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,64%

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	11,23	5,64	0,04	1,83	-0,30	-2,49	9.855.677,91	1,30
Sub-total	11,23	5,64	0,04		-0,30	-2,49	9.855.677,91	1,30

(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 (%)