

# ESTADO DE SANTA CATARINA - SEGURO

JUNHO 2025



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 20.06.2025.

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 | 100,00% |
|------------|---------|

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

| Gestor                          | Admin. | Ativo                                                         | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |      |      | Valor (R\$)    | % Carteira | PL do Fundo       | % Fundo |
|---------------------------------|--------|---------------------------------------------------------------|------------------------|-------------------|------|------|----------------|------------|-------------------|---------|
|                                 |        |                                                               |                        | Dia               | Mês  | Ano  |                |            |                   |         |
| BB                              | BB     | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI                | 0,76                   | 0,03              | 0,65 | 6,21 | 104.977.411,90 | 15,68      | 4.677.828.846,09  | 2,24    |
| BB                              | BB     | BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FIF RESP LIMITADA | 0,09                   | 0,05              | 0,75 | 5,95 | 3.616.124,74   | 0,54       | 14.041.124.869,99 | 0,03    |
| BB                              | BB     | BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO         | 0,09                   | 0,05              | 0,76 | 6,06 | 439.653.522,70 | 65,67      | 38.415.787.294,39 | 1,14    |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b |        |                                                               | 0,98                   | 0,05              | 0,74 | 6,24 | 548.247.059,34 | 81,89      |                   |         |

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

| Gestor                            | Admin. | Ativo                | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |      |      | Valor (R\$)    | % Carteira | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------|--------|----------------------|------------------------|-------------------|------|------|----------------|------------|------------------|---------|
|                                   |        |                      |                        | Dia               | Mês  | Ano  |                |            |                  |         |
| BB                                | BB     | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,10                   | 0,05              | 0,71 | 5,59 | 121.220.954,85 | 18,11      | 5.207.675.002,30 | 2,33    |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a |        |                      | 0,10                   | 0,05              | 0,71 | 5,59 | 121.220.954,85 | 18,11      |                  |         |
| Renda Fixa                        |        |                      | 0,79                   | 0,05              | 0,73 | 6,13 | 669.468.014,19 | 100,00     |                  |         |
| Total                             |        |                      | 0,84                   | 0,05              | 0,73 | 6,07 | 669.468.014,19 | 100,00     |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

|                         |                              |                |            | Política de Investimentos |          |        | Pró-Gestão Nível 2 |              |
|-------------------------|------------------------------|----------------|------------|---------------------------|----------|--------|--------------------|--------------|
| Artigo                  | Tipo de Ativo                | Valor(R\$)     | % Carteira | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | ALM                | Limite Legal |
| Renda Fixa              |                              |                |            |                           |          |        |                    |              |
| Artigo 7º I, Alínea b   | Fundos 100% Títulos Públicos | 548.247.059,34 | 81,89      | 0,00                      | 85,00    | 100,00 | 0,00               | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa            | 121.220.954,85 | 18,11      | 0,00                      | 4,00     | 60,00  | 0,00               | 70,00        |
|                         | Total Renda Fixa             | 669.468.014,19 | 100,00     |                           |          |        |                    | 100,00       |
| Total                   |                              | 669.468.014,19 | 100,00     |                           |          |        |                    |              |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador                             | No Mês        | No Ano          | 3 meses       | 6 meses         | 12 meses        | No Mês(R\$)         | Atribuição Desemp. (%) | No Ano(R\$)          |
|--------------------------------------------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|-----------------|---------------------|------------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI                | 0,74          | 6,24            | 3,10          | 6,24            | 10,39           | 4.023.704,88        | 0,61                   | 34.844.755,11        |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI              | 0,71          | 5,59            | 2,76          | 5,59            | 10,69           | 854.419,24          | 0,13                   | 7.150.497,62         |
| Artigo 8º I<br>Var. IBOVESPA p.p.                | 0,00<br>-0,07 | -1,80<br>-15,79 | 0,82<br>-4,44 | -1,80<br>-15,79 | -0,57<br>-11,23 | 0,00                | 0,00                   | -111.265,16          |
| <b>ESTADO DE SANTA CATARINA - SEGURO (Total)</b> |               |                 |               |                 |                 | <b>4.878.124,12</b> | 0,73                   | <b>41.883.987,57</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 RETORNO TOTAL FIC FI                | 104.300.221,13 | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 104.977.411,90 | 677.190,77                  | 6.812.393,30                |
| BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FIF RESP LIMITADA | 3.589.205,48   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 3.616.124,74   | 26.919,26                   | 485.058,88                  |
| BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO         | 436.333.927,85 | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 439.653.522,70 | 3.319.594,85                | 22.456.915,79               |
|                                                               | 544.223.354,46 | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 548.247.059,34 | 4.023.704,88                | 34.844.755,11               |

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 | 120.366.535,61 | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 121.220.954,85 | 854.419,24                  | 7.150.497,62                |
|                      | 120.366.535,61 | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 121.220.954,85 | 854.419,24                  | 7.150.497,62                |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

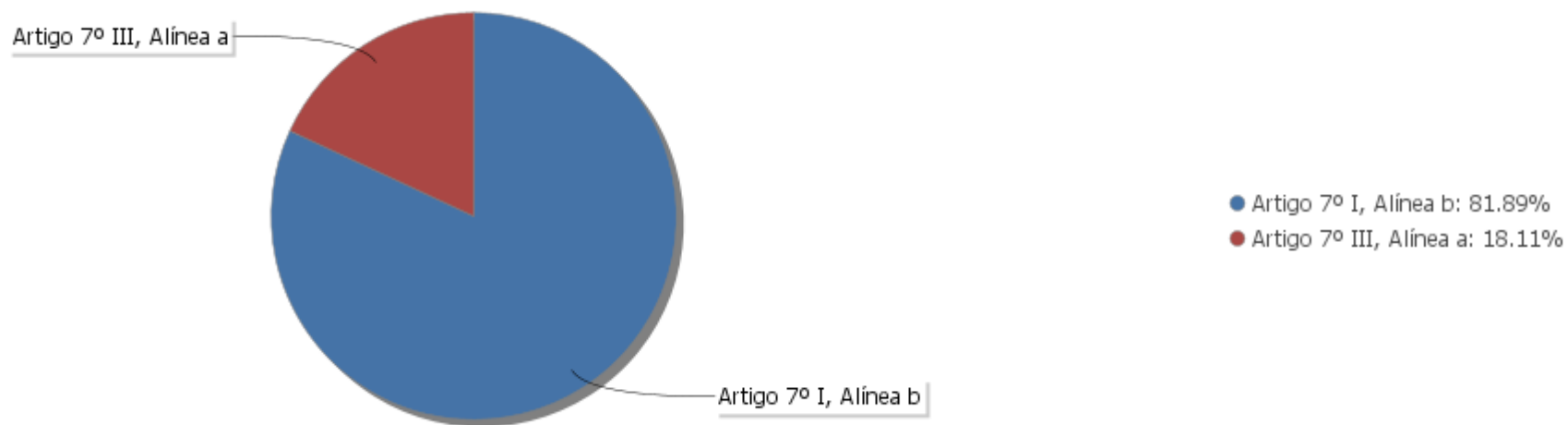
| Período               | Valor (R\$)    | (%)    | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|----------------|--------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias        | 669.468.014,19 | 100,00 | 669.468.014,19        | 100,00    | 10,00                   |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00           | 0,00   | 669.468.014,19        | 100,00    | 30,00                   |
| acima de 365 dias     | 0,00           | 0,00   | 669.468.014,19        | 100,00    | 100,00                  |

### DE 0 A 30 DIAS

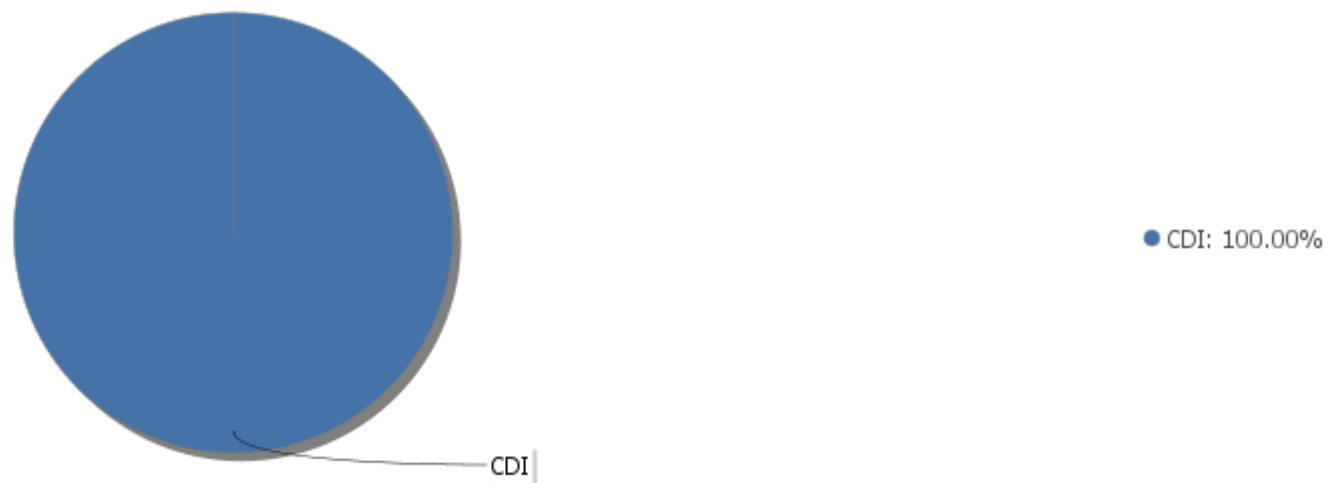
| Ativo                                                         | Liquidação | Vencimento | Valor (R\$)    |
|---------------------------------------------------------------|------------|------------|----------------|
| BB PREV RF FLUXO FIC                                          | D+0        |            | 121.220.954,85 |
| BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FIF RESP LIMITADA | D+0        |            | 3.616.124,74   |
| BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO         | D+0        |            | 439.653.522,70 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI                | D+3 du     |            | 104.977.411,90 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Artigo

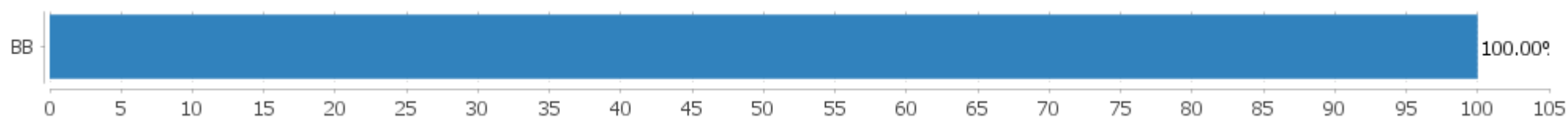


## Alocação Por Estratégia



## 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 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2025           | 1,09  | 0,85  | 0,98  | 1,15  | 1,12  | 0,73  |       |       |       |       |       |       | 6,07      |
| INPC + 4,50%   | 0,39  | 1,84  | 0,84  | 0,83  | 0,72  |       |       |       |       |       |       |       |           |
| p.p. indexador | 0,70  | -0,99 | 0,14  | 0,32  | 0,40  |       |       |       |       |       |       |       |           |
| 2024           | 0,46  | 0,68  | 0,56  | -0,08 | 0,92  | 0,44  | 1,07  | 0,87  | 0,53  | 0,63  | 0,56  | 0,34  | 7,21      |
| INPC + 4,50%   | 0,96  | 1,15  | 0,54  | 0,76  | 0,83  | 0,60  | 0,66  | 0,24  | 0,85  | 1,02  | 0,66  | 0,85  | 9,50      |
| p.p. indexador | -0,49 | -0,47 | 0,02  | -0,83 | 0,09  | -0,16 | 0,41  | 0,62  | -0,32 | -0,38 | -0,11 | -0,51 | -2,30     |
| 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

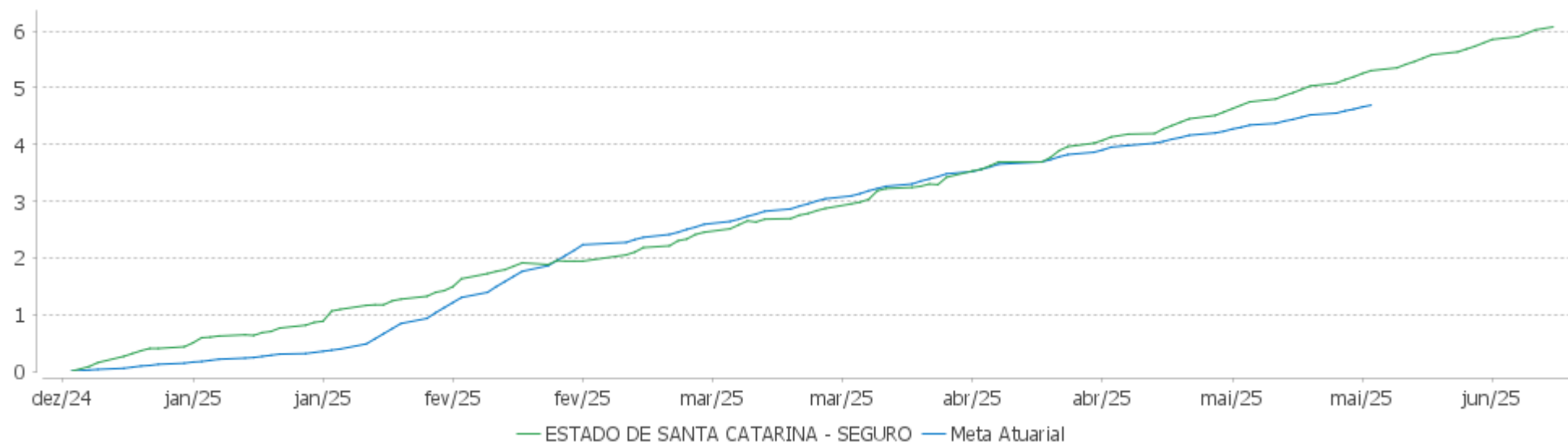
### Relatório

|                              | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial  | 30         | 46,15     | 03 meses         | 3,03     |               |            | 0,40               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 35         | 53,85     | 06 meses         | 6,07     |               |            | 0,52               |
|                              |            |           | 12 meses         | 10,38    |               |            | 0,84               |
|                              |            |           | 24 meses         | 19,94    |               |            | 1,08               |
|                              |            |           | 36 meses         | 35,37    |               |            | 1,29               |
|                              |            |           | 48 meses         | 43,74    |               |            | 1,44               |
|                              |            |           | 60 meses         | 47,56    |               |            | 1,62               |
|                              |            |           | Desde 31/12/2019 | 50,10    |               |            | 2,05               |

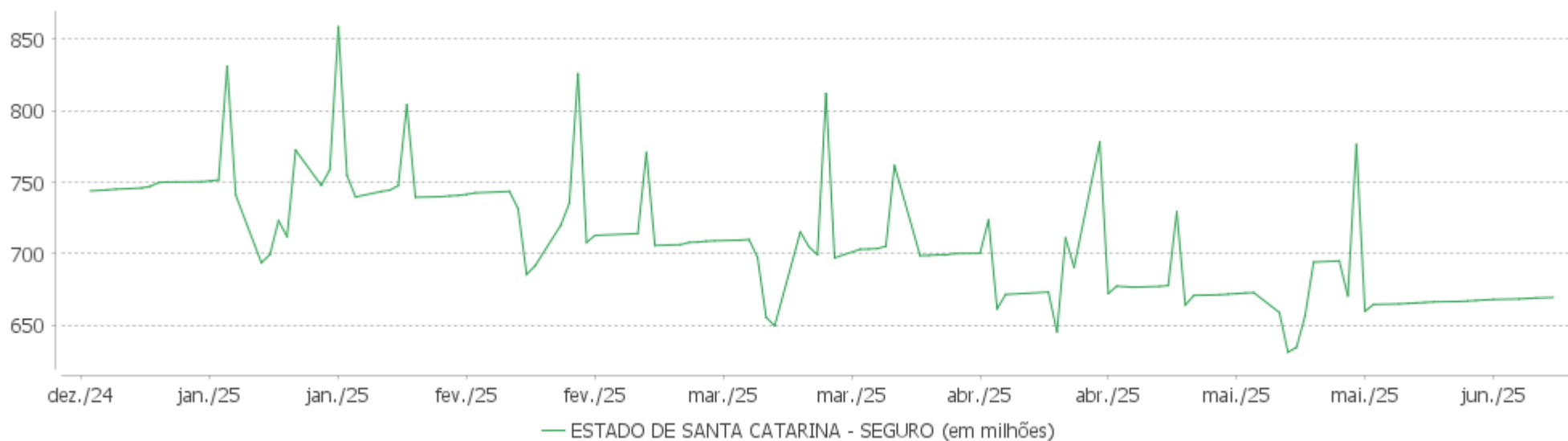
|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,20          | 2020-12 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -1,10         | 2020-03 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução No Ano

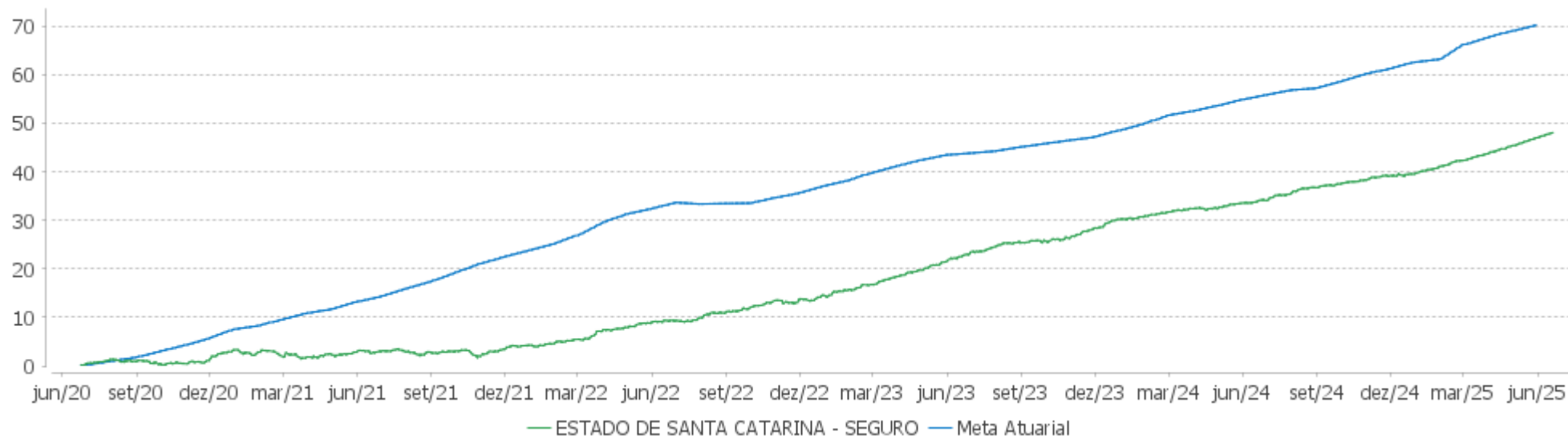


### Patrimônio Líquido No Ano

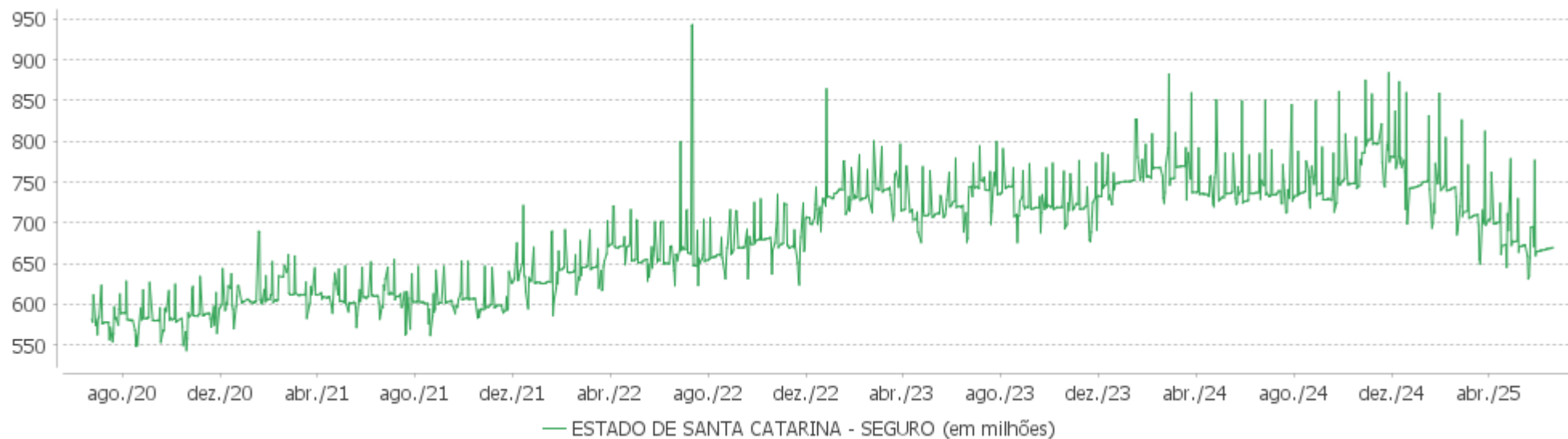


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

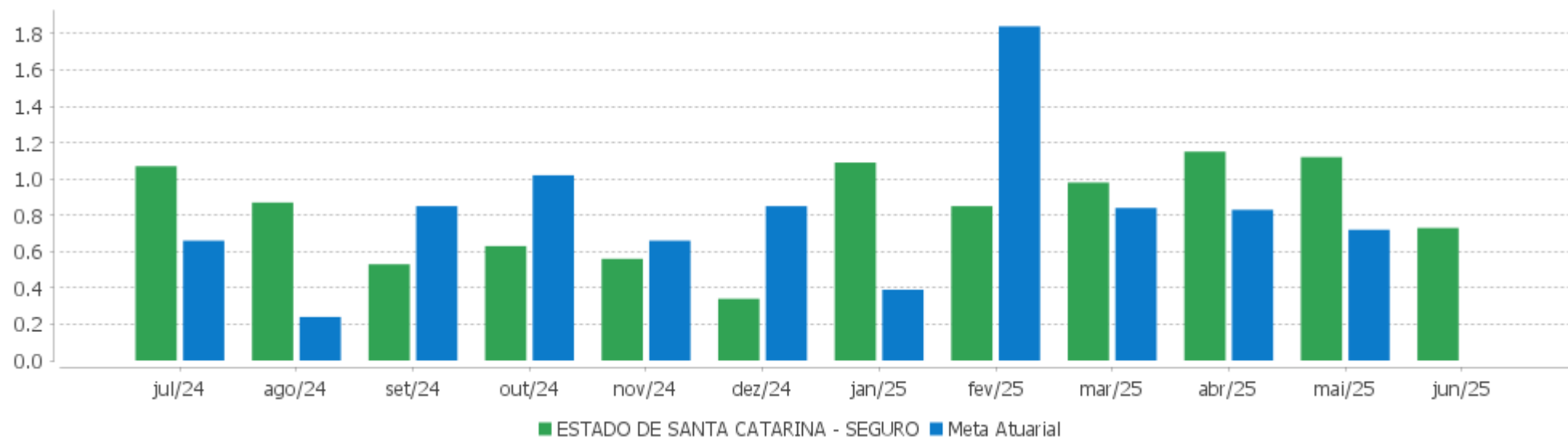


### Patrimônio Líquido



## 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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI<br>% do CDI                | 0,65   | 6,21   | 2,91    | 6,21    | 10,60    | 21,42    | 38,39    |
| BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FIF RESP LIMITADA<br>% do CDI | 0,75   | 5,95   | 2,92    | 5,95    | 11,50    | 24,20    | 40,71    |
| BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO<br>% do CDI         | 0,76   | 6,06   | 2,97    | 6,06    | 11,72    | 24,70    | 41,57    |
| BB PREV RF FLUXO FIC<br>% do CDI                                          | 0,71   | 5,59   | 2,76    | 5,59    | 10,69    | 22,41    | 37,64    |
| ESTADO DE SANTA CATARINA - SEGURO<br>Var. INPC + 4,50% p.p.               | 0,73   | 6,07   | 3,03    | 6,07    | 10,38    | 19,94    | 35,37    |
| CDI                                                                       |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                                                                  | 0,07   | 13,99  | 5,26    | 13,99   | 10,66    | 16,11    | 39,14    |
| INPC + 6,00%                                                              |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA + 6,00%                                                              |        |        |         |         |          |          |          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Cotização e Taxas

| Fundo                                                         | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas       |               |
|---------------------------------------------------------------|-----------|------------|-----------|------------|-------------|---------------|
|                                                               | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| 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 RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FIF RESP LIMITADA | 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         |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IRF-M 1+        |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IRF-M TOTAL     |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IMA-B 5         |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IMA-B 5+        |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IMA-B TOTAL     |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IMA-GERAL TOTAL |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IDKA 2          |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IDKA 20         |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| CDI             |        |        |         |         |          |          |          |          |          |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | 0,07   | 13,99  | 5,26    | 13,99   | 10,66    | 16,11    | 39,14    | 8,13     | 44,25    |
| IBRX 100                 | 0,16   | 13,86  | 5,26    | 13,86   | 10,77    | 16,96    | 37,55    | 5,85     | 44,31    |
| IBRX 50                  | 0,34   | 12,51  | 4,19    | 12,51   | 10,10    | 18,24    | 39,14    | 7,56     | 47,88    |
| SMALL CAP                | -0,45  | 24,56  | 14,40   | 24,56   | 9,67     | -3,45    | 15,66    | -30,13   | -2,44    |
| Índice Consumo - ICON    | -2,71  | 21,28  | 12,22   | 21,28   | 9,25     | -7,29    | -0,24    | -46,36   | -37,30   |
| Índice Dividendos - IDIV | 0,51   | 12,31  | 5,77    | 12,31   | 13,22    | 26,91    | 49,42    | 43,30    | 77,38    |

## 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   |        |        |         |         |          |          |          |          |          |

### Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      |        |        |         |         |          |          |          |          |          |

### Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI |        |        |         |         |          |          |          |          |          |

### Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| INPC      |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IGPM      |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| SELIC     |        |        |         |         |          |          |          |          |          |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IPCA + 5,00% |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IPCA + 5,50% |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IPCA + 5,89% |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| IPCA + 6,00% |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| INPC + 4,00% |        |        |         |         |          |          |          |          |          |
| INPC + 6,00% |        |        |         |         |          |          |          |          |          |



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| APR | Data  | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-----|-------|-------|-----------|---------|------------|------------|
|     | Total |       | 0,00      | 0,00    |            |            |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 229.132,93

Value-At-Risk: 0,03%

|                                   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|-----------------------------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| Artigo 7º                         | 0,04                        | 0,03               | 5,00                  | 0,03                | 9,38   | 0,73  | 669.468.014,19 | 100,00     |
| ESTADO DE SANTA CATARINA - SEGURO |                             | 0,03               |                       | 0,03                |        |       | 669.468.014,19 | 100,00     |

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,03%

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI                | 0,26                        | 0,16               | 0,02                | 0,16                | 1,23   | 0,65  | 104.977.411,90 | 15,68      |
| BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOIRO SELIC FIC FIF RESP LIMITADA | 0,01                        | 0,03               | 0,00                | 0,03                | 59,89  | 0,75  | 3.616.124,74   | 0,54       |
| BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO         | 0,01                        | 0,03               | 0,01                | 0,03                | 66,67  | 0,76  | 439.653.522,70 | 65,67      |
| <b>Sub-total</b>                                              | 0,05                        | 0,04               | 0,03                |                     | 8,35   | 0,74  | 548.247.059,34 | 81,89      |

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 FLUXO FIC | 0,02                        | 0,02               | 0,00                | 0,03                | 23,42  | 0,71  | 121.220.954,85 | 18,11      |
| <b>Sub-total</b>     | 0,02                        | 0,02               | 0,00                |                     | 23,42  | 0,71  | 121.220.954,85 | 18,11      |

(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 (%)