



ADITUS

# Sergipe Previdência

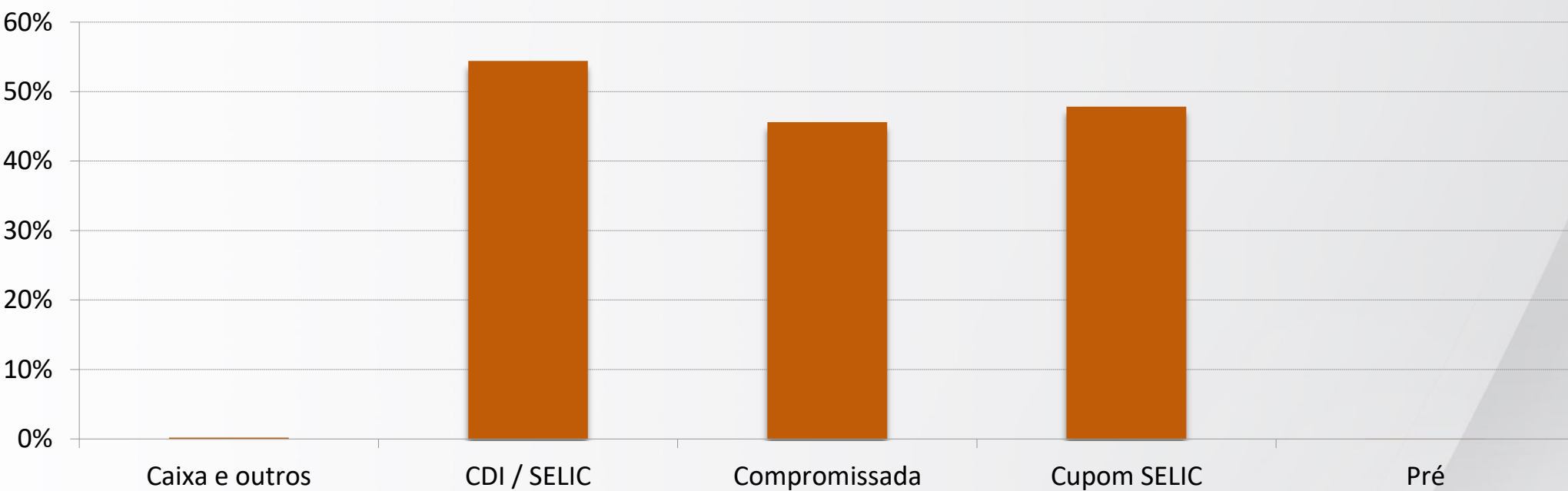
*Apresentação Mensal*

*Janeiro 2026*

# ANÁLISE DE INVESTIMENTOS

| VEÍCULO DE INVESTIMENTO                              | ALOCAÇÃO (R\$)    | GESTOR | RISCO DE MERCADO | RENTABILIDADE* |       |       |       |        |        |        |        |
|------------------------------------------------------|-------------------|--------|------------------|----------------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|
|                                                      |                   |        |                  | 1M             | 3M    | 6M    | ANO   | 12M    | 24M    | 36M    |        |
| Renda Fixa                                           | 15.285.281,82     | 57,07% |                  | 1,16%          |       |       | 1,16% |        |        |        |        |
| Benchmark                                            | IPCA + 5.52% a.a. |        |                  | 0,79%          | 2,19% | 2,19% | 0,79% | 10,19% | 21,58% | 34,06% |        |
| RF TRADICIONAL                                       | 15.285.281,82     | 57,07% |                  |                |       |       |       |        |        |        |        |
| BB PREV RF REF. DI LP PERFIL FIC FIF                 | 2.733.142,43      | 10,20% | BB               | 0,00%          | 1,20% | 3,52% | 7,36% | 1,20%  | 14,59% | 27,22% | 43,51% |
| BB RF LP TESOURO SELIC FIC FIF LIMITATA              | 12.538.592,04     | 46,81% | BB               | 0,01%          | 1,15% | 3,41% | 7,17% | 1,15%  | 14,19% | 26,37% | 42,26% |
| CAIXA BRASIL TIT PUB FI FINANC. RF LP                | 13.547,35         | 0,05%  | CAIXA            | 0,05%          | 1,21% | 3,47% | 7,28% | 1,21%  | 14,38% | 26,64% | 42,85% |
| Benchmark                                            | CDI               |        |                  |                | 1,16% | 3,48% | 7,31% | 1,16%  | 14,50% | 27,01% | 43,34% |
| Caixa / Valores a Pagar / Valores a Receber / Outros | 11.500.298,33     | 42,93% |                  |                |       |       |       |        |        |        |        |
| Benchmark                                            | CDI               |        |                  |                | 1,16% | 3,48% | 7,31% | 1,16%  | 14,50% | 27,01% | 43,34% |
| Total**                                              | 26.785.580,15     | 100%   |                  | 0,01%          | 1,16% |       |       | 1,16%  |        |        |        |
| Benchmark                                            | IPCA + 5.52% a.a. |        |                  |                | 0,79% | 2,19% | 2,19% | 0,79%  | 10,19% | 21,58% | 34,06% |

# EXPOSIÇÃO POR FATOR DE RISCO



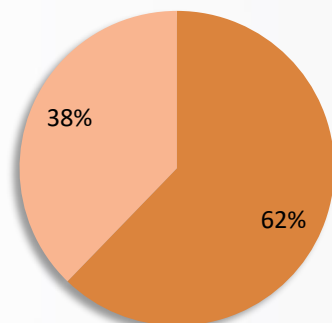
# RISCO DE MERCADO – (*Value-At-Risk* – VaR e Stress Test)

## Dados da Análise

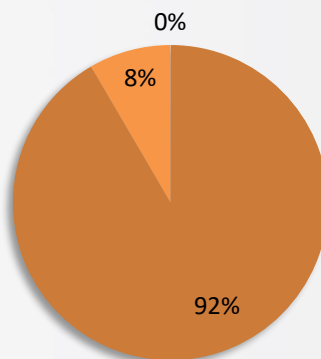
|                    |             |                             |         |
|--------------------|-------------|-----------------------------|---------|
| Data-base          | 30/01/2026  | Análise de Risco de Mercado |         |
| Data da Carteira   | 30/01/2026  |                             |         |
| Modelo             | Paramétrico | Value at Risk               | 770,37  |
| Nível de Confiança | 95%         | Value at Risk (%)           | 0,01    |
| Horizonte de Tempo | 21          |                             |         |
|                    |             | Stress Test                 | (49,25) |
|                    |             | Stress Test (%)             | (0,00)  |

# ANÁLISE DE CONTRAPARTES PRIVADAS

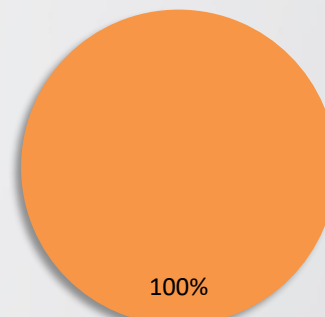
Por Título



Por Faixa



Por Indexador



■ Créd Priv Financ ■ Debêntures

■ Faixa 1 ■ Faixa 2 ■ Faixa 3

■ CDI

| Fitch      | S&P    | Moody's | Austin | Liberum | LF   | SR     | Rating Padrão | Faixa |
|------------|--------|---------|--------|---------|------|--------|---------------|-------|
| AAA (bra)  | brAAA  | Aaa.br  | AAA    | AAA     | AAA  | brAAA  | AAA           | 1     |
| AA+ (bra)  | brAA+  | AA+.br  | AA+    | AA+     | AA+  | brAA+  | AA+           | 2     |
| AA (bra)   | brAA   | AA.br   | AA     | AA      | AA   | brAA   | AA            |       |
| AA- (bra)  | brAA-  | AA-.br  | AA-    | AA-     | AA-  | brAA-  | AA-           |       |
| A+ (bra)   | brA+   | A+.br   | A+     | A+      | A+   | brA+   | A+            | 3     |
| A (bra)    | brA    | A.br    | A      | A       | A    | brA    | A             |       |
| A- (bra)   | brA-   | A-.br   | A-     | A-      | A-   | brA-   | A-            |       |
| BBB+ (bra) | brBBB+ | BBB+.br | BBB+   | BBB+    | BBB+ | brBBB+ | BBB+          | 4     |
| BBB (bra)  | brBBB  | BBB.br  | BBB    | BBB     | BBB  | brBBB  | BBB           |       |
| BBB- (bra) | brBBB- | BBB-.br | BBB-   | BBB-    | BBB- | brBBB- | BBB-          |       |
| BB+ (bra)  | brBB+  | BB+.br  | BB+    | BB+     | BB+  | brBB+  | BB+           | 5     |
| BB (bra)   | brBB   | BB.br   | BB     | BB      | BB   | brBB   | BB            |       |
| BB- (bra)  | brBB-  | BB-.br  | BB-    | BB-     | BB-  | brBB-  | BB-           |       |
| B+ (bra)   | brB+   | B+.br   | B+     | B+      | B+   | brB+   | B+            | 6     |
| B (bra)    | brB    | B.br    | B      | B       | B    | brB    | B             |       |
| B- (bra)   | brB-   | B-.br   | B-     | B-      | B-   | brB-   | B-            |       |
| CCC(bra)   | brCCC+ | CCC+.br | CCC    | CCC     |      | brCCC  | CCC           | 7     |
|            | brCCC  | CCC.br  |        |         |      |        |               |       |
|            | brCCC- | CCC-.br |        |         |      |        |               |       |
| CC(bra)    | brCC   | CC.br   | CC     | CC      |      | brCC   |               | 8     |
| C(bra)     | brC    | C.br    | C      | C       | C    | brC    |               |       |
| DDD(bra)   | R      |         | D      | D       | D    | brD    | D             |       |
| DD(bra)    | SD     |         |        |         |      |        |               | 8     |
| D(bra)     | D      |         |        |         |      |        |               |       |
| RD         |        |         |        |         |      |        |               | 9     |
| SEM RATING |        |         |        |         |      |        |               |       |

# MAIORES EXPOSIÇÕES – EMISSORES PRIVADOS

| Nome                                                          | MtM        | MtM (%) | Faixa Risco Credito |
|---------------------------------------------------------------|------------|---------|---------------------|
| BCO BRASIL SA                                                 | 206.195,31 | 1,36%   | Faixa 1             |
| BCO BRADESCO SA                                               | 124.863,13 | 0,82%   | Faixa 1             |
| BANCO VOTORANTIM S.A.                                         | 39.522,57  | 0,26%   | Faixa 2             |
| CIELO SA                                                      | 31.521,59  | 0,21%   | Faixa 1             |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF                                   | 25.080,13  | 0,16%   | Faixa 1             |
| BCO SANTANDER (BRASIL) SA                                     | 22.845,11  | 0,15%   | Faixa 1             |
| BCO DAYCOVAL SA                                               | 22.365,31  | 0,15%   | Faixa 2             |
| BCO SAFRA SA                                                  | 21.674,42  | 0,14%   | Faixa 1             |
| STONE SOCIEDADE DE CRÉDITO, FINANCIAMENTO E INVESTIMENTO S.A. | 20.547,10  | 0,14%   | Faixa 1             |
| BCO VOLKSWAGEN SA                                             | 19.920,96  | 0,13%   | Faixa 1             |
| BCO ITAU SA                                                   | 18.873,75  | 0,12%   | Faixa 1             |

## DISCLAIMER

*Essa apresentação é destinada a investidores qualificados e não deve ser entendida como recomendação de investimento, desinvestimento ou manutenção de ativos.*

*As informações constantes dessa apresentação resultaram da compilação de amostras de dados e de informações consolidadas realizadas conforme critérios especificados na própria apresentação. Não obstante, as informações aqui contidas não permitem a identificação ou individualização por terceiros de nenhuma das EFPCs analisadas, e devem ser interpretadas apenas como uma composição de amostra de dados.*

*Os dados aqui analisados são oriundos de uma amostra específica do mercado, que pode não representar fielmente o segmento de EFPCs. Nesse sentido, recomenda-se cautela na utilização das informações apresentadas. As conclusões oriundas desse estudo são de responsabilidade total de seu leitor.*

*Esse material é de propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e não deve ser reproduzido, ainda que parcialmente, ou retransmitido sem a prévia autorização de seus autores.*



**ADITUS**

+55 11 3818-1111 | [aditus@aditusbr.com](mailto:aditus@aditusbr.com)

Ed. Atrium IX, Rua do Rócio, 350 - 6º andar

CEP 04552-000 | São Paulo - SP