

BDAP11- BB ETF ÍNDICE DAP5 B3 FUNDO DE ÍNDICE R LI

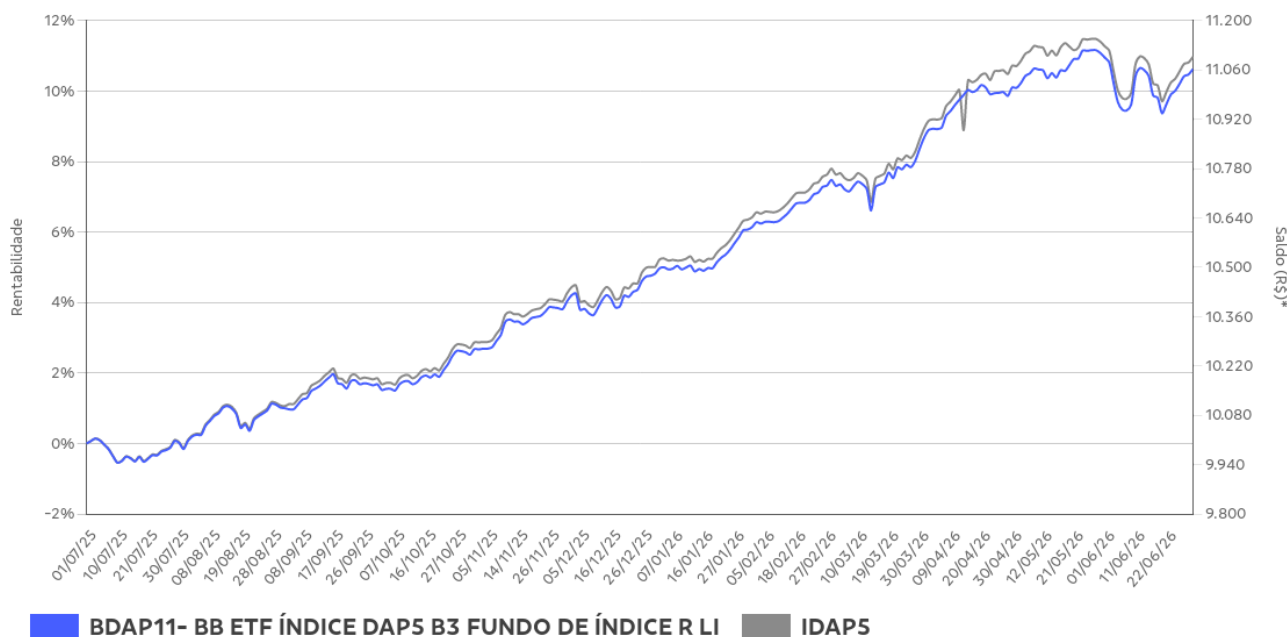
Refletir as variações e rentabilidade, deduzidas taxas e despesas, do Índice DAP5 B3 ("IDAP5 B3" ou "ÍNDICE"), calculado pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão ("B3").

-0,41%
Rentabilidade
junho

10,75%
Rentabilidade
12 meses

Público Alvo
Investidor B3 - Pessoa Física e
Jurídica

Rentabilidade



* Simulação de resultado bruto de uma aplicação de R\$10mil realizada há 12 meses.

Performance Mensal

Período	Fundo	IDAP5	desvio ¹
2026	5,54%	5,68%	-0,14pp
12 meses	10,75%	11,10%	-0,35pp
jun/26	-0,41%	-0,39%	-0,02pp
mai/26	0,89%	0,62%	0,27pp
abr/26	1,31%	1,64%	-0,33pp
mar/26	1,26%	1,21%	0,05pp
fev/26	1,17%	1,20%	-0,03pp
jan/26	1,20%	1,28%	-0,08pp
dez/25	0,94%	0,90%	0,04pp
nov/25	1,14%	1,16%	-0,02pp
out/25	1,01%	1,03%	-0,02pp
set/25	0,55%	0,66%	-0,11pp
ago/25	1,26%	1,29%	-0,03pp
jul/25	-0,04%	-0,01%	-0,03pp

Anos anteriores

Valores em %

	Fundo	IDAP5
2025	12,00%	12,28%
2024	4,10%	4,52%
2023	-	13,18%

O indicador IDAP5 é mera referência econômica e não parâmetro do fundo.

Invista agora pelo APP



¹ diferença entre a rentabilidade do fundo e o índice de referência, em pontos percentuais.

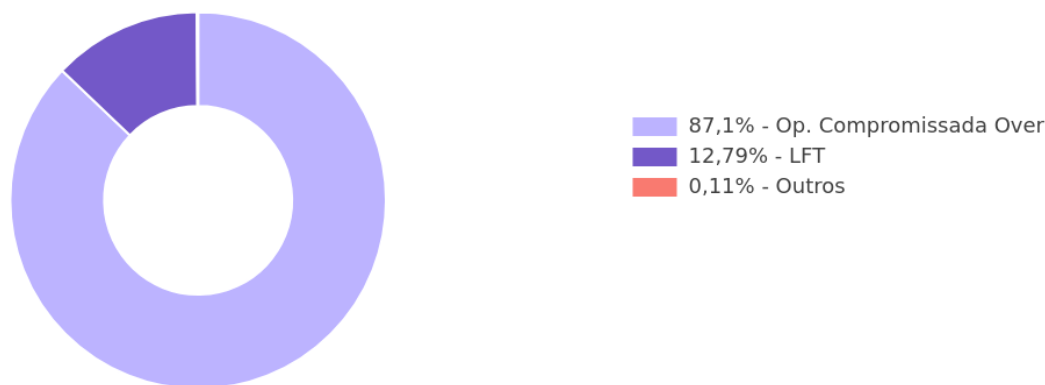
Cenário

O principal tema de mercado ao longo do mês foi a assinatura do memorando de entendimento entre EUA e Irã, elevando a possibilidade de fim do conflito. Como resultado, o preço do petróleo voltou para patamar próximo ao nível pré-guerra, enquanto houve redução nos preços de fertilizantes, melhora da aversão a risco global e diminuição do risco inflacionário. Conforme esperado, os dados de inflação seguiram pressionados ao longo do mês passado, com maiores impactos sendo sentidos, principalmente, na Europa, região importadora líquida de petróleo e gás natural.

Assim, em linha com o nosso cenário, o Banco Central Europeu (BCE) elevou a taxa de juros em 25bps para 2,25%. Já o FED manteve a taxa de juros inalteradas, e em sua primeira reunião como presidente da instituição, Kevin Warsh fez discurso relativamente duro, focando principalmente na estabilidade de preços, informando que não deseja utilizar o instrumento de forward guidance durante a sua gestão e anunciando a criação de grupos de trabalho para analisar temas que considera relevantes.

No Brasil, os dados de inflação foram relativamente melhores na margem, embora o detalhamento do IPCA siga sugerindo cautela na condução da política monetária. Somado a isso, o mercado de trabalho seguiu mostrando taxa de desemprego baixa e geração positiva de postos. Assim sendo, mantivemos as projeções para o PIB (2,1%) e o IPCA (5,3%) em 2026, mas com viés de alta para a inflação caso se confirme um El Niño severo, que poderia impulsionar os preços de alimentos no 2º semestre. Diante da piora do quadro inflacionário, o Copom adotou uma postura ainda mais cautelosa no comunicado e ata. Assim, passamos a projetar uma taxa terminal mais alta em 2026 (14,25% ante 14,00%).

Composição da Carteira



Indicadores e Projeções da BB Asset

Resumo	2024	2025	2026
Juros Nominais - Selic	10,89%	14,33%	14,11%
Juros Nominais - CDI	10,84%	14,26%	13,31%
Inflação - IGP-M	4,83%	-1,02%	4,29%
Inflação - IPCA	6,54%	4,30%	3,19%
Juros Reais Básicos - Selic/IGP-M	5,78%	15,51%	9,42%
Juros Reais Básicos - Selic/IPCA	4,09%	9,62%	10,58%
PIB	3,30%	2,20%	2,10%
Câmbio - US\$ Ptax Venda	6,18	5,47	5,30

Informações de Risco

Risco:

VaR (95% de confiança) ¹	-
Volatilidade no ano ²	2,84%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	2,47%
% de retornos positivos no ano	65%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	64%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-

Fontes: Banco do Brasil, Anbima, Sinqia e Quantumaxis

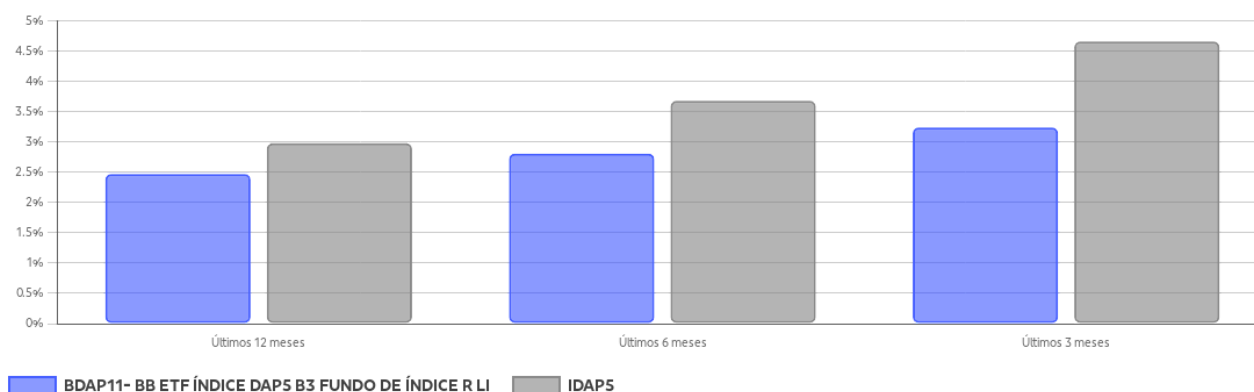
¹ VaR (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. a metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos, por esse motivo não são divulgados.

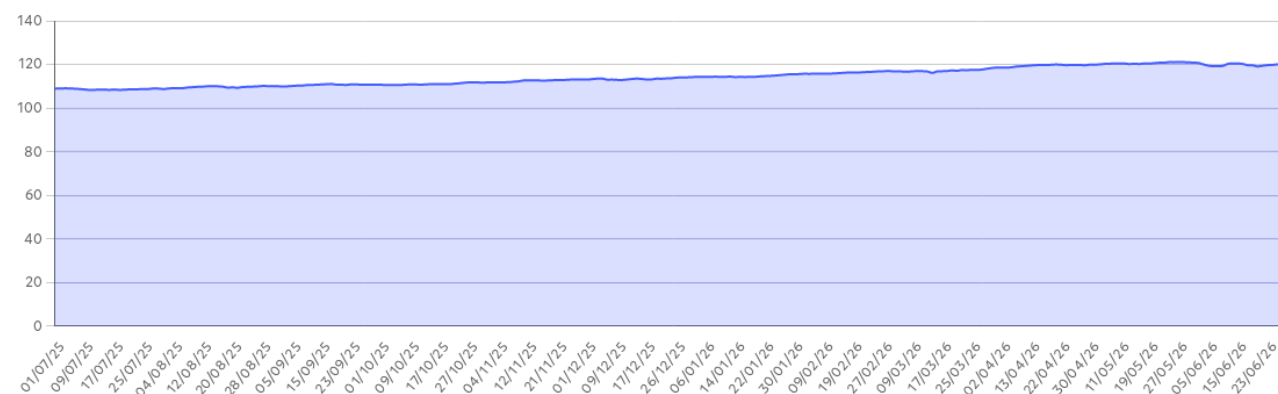
As descrições dos fatores de risco do fundo estão disponíveis no regulamento e podem ser consultados [aqui](#).

Volatilidade



Evolução Patrimonial

R\$ milhões



Patrimônio líquido médio dos últimos 12 meses: R\$ 114.329.207,80

Patrimônio líquido de fechamento do mês anterior: R\$ 120.458.438,30

CNPJ 51.921.067/0001-08	Início do fundo 26/09/2023	Tributação Curto Prazo
Classe CVM ETF Renda Fixa	Classe Anbima Fundos de Índices - ETF	ISIN BRBDAPCTF008

Condições Comerciais

Aplicação Inicial	R\$ 0,00	Cota de Aplicação	D+0
Aplicação Adicional	R\$ 0,00	Cota de Resgate	D+0
Resgate Mínimo	R\$ 0,00	Crédito do Resgate	D+4
Saldo Mínimo	R\$ 0,00	Taxa Global (a.a.) ¹	zero
Horário Limite (horário de Brasília)		Taxa de Performance	zero
Tipo de Cota	Fechamento	Taxa de Saída	zero

¹ É a soma das taxas de administração, de gestão e de distribuição. Essas taxas incidem sobre o valor total investido e são representadas por um percentual anual.

Avisos Importantes

A rentabilidade apresentada refere-se ao fechamento do último dia útil do mês de junho/2026.

1. Este é um relatório público e foi produzido pela BB Gestão de Recursos DTVM S.A.
2. Todas as recomendações e estimativas apresentadas derivam do julgamento de nossos analistas e podem ser alteradas a qualquer momento sem aviso prévio, em função de mudanças que possam afetar as projeções realizadas.
3. Este material tem por finalidade apenas informar e servir como instrumento que auxilie a tomada de decisão de investimento.
4. Leia o Formulário de Informações Complementares, a lâmina de Informações Essenciais, se houver, e o Regulamento antes de investir.
5. Descrição do tipo ANBIMA disponível no Formulário de Informações Complementares.
6. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.
7. O investimento em fundo não é garantido pelo Fundo Garantidor de Crédito - FGC.
8. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos e taxa de saída, se houver.
9. Para avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de período de, no mínimo, 12 (doze) meses.
10. O conteúdo disponibilizado não deverá ser reproduzido, distribuído ou publicado sem prévia autorização do Banco do Brasil S.A.

Legenda

 Rentabilidade não disponível para o período informado. De acordo com as normas da Anbima, fundos com menos de 6 meses não podem divulgar suas rentabilidades.

 Fundos fechados não admitem a adesão de novos cotistas. Os recursos já aplicados continuam rendendo normalmente e os resgates podem ser realizados a qualquer momento, observadas as regras e prazos de cotização constantes do regulamento.

 Símbolo de ASG - ambiental, social e governança corporativa.

 Investidor Qualificado: pessoa física ou jurídica com pelo menos R\$ 1 milhão em investimentos e que atesta essa condição por escrito, além de investidores que tenham qualificação técnica ou certificações aprovadas pela CVM.

Administração e Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM S.A

Distribuição: Agentes Autorizados - Corretoras

Custódia, Controladoria e Contabilidade: Banco do Brasil S.A

Gestor Responsável: Pedro Mendes Rauber

Auditoria Externa: Deloitte Touche Tohmatsu



Central de Relacionamento BB
4004.0001
0800 729 0001

SAC
0800 729 0722

Deficientes Auditivos/Fala
0800 729 0088

Ouvidoria BB
0800 729 5678

WhatsApp
61 4004 0001

Central de Atendimento para Benefícios e Auxílios
4003 5285
0800 729 5285



