



PREFEITURA DO RECIFE  
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS  
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS  
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

ART. 3º - B DA PORTARIA MPS N° 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N° 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b>	<b>Nº / ANO:</b>	<b>122 /2020 - GI</b>
<b>Unidade Gestora do RPPS</b>	<b>OF. Nº:</b>	<b>122 /2020 - GI</b>
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores <b>CNPJ: 05.244.336/0001-13</b>	<b>Data:</b>	<b>18/08/20</b>
<b>Valor:</b>		
R\$ 38.250.000,00	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
Trinta e oito milhões, duzentos e cinquenta mil reais		

Sim para todos os fundos desta APR

**HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:**

<b>Fundo:</b>	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO		
<b>CNPJ do Fundo:</b>	13.077.415/0001-05		
<b>Segmento:</b>	FI Renda Fixa - Geral		
<b>Tipo de Ativo:</b>	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"		
<b>Tipo de operação realizada:</b>	Resgate		
<b>Valor da operação:</b>	R\$ 38.250.000,00		
<b>Quantidade de Cotas:</b>	18.136.376,82264110		
<b>Valor da Cota (R\$):</b>	R\$	2,1090210230	
<b>Data da Operação:</b>	18/08/2020		
<b>Data de Liquidação:</b>	18/08/2020		
<b>Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):</b>	R\$ 2.546.644,01		
<b>(%) no Patrimônio Líquido do fundo:</b>	1501,977%		
<b>Limite Máximo por PL do fundo</b>	15,00%		
<b>Banco/Agência/Conta:</b>	Banco do Brasil S.A.	3234-4	7.909-X
<b>Administrador:</b>	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
<b>CNPJ do Administrador:</b>	30.822.936/0001-69		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Administrador:</b>	08/10/2019		
<b>Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Administrador com RPPS</b>	R\$ 60.752.506.000,00		
<b>% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.</b>	5,58%		
<b>Gestor:</b>	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
<b>CNPJ do Gestor:</b>	30.822.936/0001-69		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Gestor:</b>	08/10/2019		
<b>Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN</b>	Sim		
<b>Volume de Recursos do Gestor com RPPS</b>	R\$	59.140.140.003,04	
<b>% Recursos do Gestor com RPPS</b>	5,44%		
<b>Empresa de Rating</b>	Fitch Ratings		
<b>Conceito</b>	Excelente		
<b>Representação do conceito</b>	Excelente		
<b>O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN</b>	Sim		
<b>Distribuidor:</b>	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
<b>CNPJ do Distribuidor:</b>	00.000.000/0001-91		
<b>Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:</b>	16/10/2019		

Data de Início FI:	28/04/2011	
Taxa Administração do FI (%):	1,00	
Índice de Referência do FI :	CDI	
Tx Performance do FI (%):	Não possui	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0 dias	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	0	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Sim	
CNPJ do Fundo:	27.146.328/0001-77	
Segmento:	Renda Fixa	
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
% Carteira do Fundo:	100,00	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O fundo tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento que atendam aos limites e garantias exigidas pela Resolução 3922/10 do CMN. O fundo deve manter 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou índices de preços. Para tanto, irá aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento de renda fixa com essas mesmas características e em títulos públicos federais e/ou em suas operações compromissadas, no limite de 5% do patrimônio líquido.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Taxa de Juros (Risco 2)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Baixo
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo		Curto Prazo
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal		0,67%
Retorno Médio Anual		8,39%
Retorno Total		110,73%

Maior Retorno	1,17%
Menor Retorno	0,10%
Qtde. mês Positivo	111
Qtde. mês Negativo	0
Qtde. mês acima do Benchmark	1
Qtde. mês abaixo do Benchmark	110
Risco Mensal Período	0,26%
Risco Mensal 12 MESES	0,10%
Risco Anual do Período	0,91%
Retorno Relativo ao Benchmark	-7,72%
Sharpe	-1,05
Information Ratio	-14,13
Tracking Error	0,07%
VAR HISTÓRICO (95%)	1,10%
VAR 12 MESES (95%)	0,69%
Sharpe Modificado	-37,10
Beta (12 meses)	0,88
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,08%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos 15/07/2020
Outras Observações:	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo

O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO
CNPJ do Fundo:	10.418.335/0001-88
Segmento:	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações
Tipo de Ativo:	Fundo de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 38.000.000,00
Quantidade de Cotas:	14.094.292,21619570
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,6961268730
Data da Operação:	18/08/2020
Data de Liquidação:	19/08/2020
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 950.958.400,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	3,996%
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%
Banco/Agência/Conta:	Banco do Brasil S.A. 3234-4 7.909-X
Administrador:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Administrador:	30.822.936/0001-69
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	08/10/2019
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 60.752.506.000,00
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de	5,58%
Gestor:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	08/10/2019
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$ 59.140.140.003,04
% Recursos do Gestor com RPPS	5,44%
Empresa de Rating	Fitch Ratings
Conceito	Excelente
Representação do conceito	Excelente
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim
Distribuidor:	BANCO DO BRASIL S.A. (GRUPO BANCO DO BRASIL)
CNPJ do Distribuidor:	00.000.000/0001-91
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	08/10/2019
Data de Início FI:	10/06/2009
Taxa Administração do FI (%):	1,00
Índice de Referência do FI :	IGC
Tx Performance do FI (%):	Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado
Carência (dias):	0 dias
Data Listagem Bolsa:	Não listado
Resgate (dias):	4
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não
CNPJ do Fundo:	0,00
Segmento:	R\$ 0,00
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:	0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.

Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O fundo tem por objetivo buscar retorno próximo à variação do IGC - Índice de Governança Corporativa, divulgado pela BOVESPA, através de investimento, nos limites estabelecidos em seu regulamento, em carteira diversificada de ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores ou entidade mantenedora de mercado de balcão organizado autorizada pela CVM, sejam admitidas à negociação em segmento especial mantido nos moldes do Novo Mercado ou classificadas nos moldes dos Níveis Bovespa 2, 1 e/ou BOVESPA MAIS.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Investimento em Ações (Risco 5)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	
<b>Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior</b>		
Retorno Médio Mensal	0,57%	
Retorno Médio Anual	7,05%	
Retorno Total	92,06%	
Maior Retorno	11,85%	
Menor Retorno	-30,82%	
Qtde. mês Positivo	65	
Qtde. mês Negativo	50	
Qtde. mês acima do Benchmark	29	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	86	
Risco Mensal Período	5,76%	
Risco Mensal 12 MESES	14,99%	
Risco Anual do Período	19,96%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-12,48%	
Sharpe	-0,12	
Information Ratio	-1,31	
Tracking Error	1,14%	
VAR HISTÓRICO (95%)	10,22%	
VAR 12 MESES (95%)	10,46%	
Sharpe Modificado	-0,12	
Beta (12 meses)	0,85	
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,35%	
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Data da reunião do Comitê de Investimentos : 15/07/2020	
Outras Observações:		
<b>Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<b>Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"</b>		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não	
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não	
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não	
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não	
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não	
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<b>Art. 7º, VII, "a"</b>		
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo	
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo	
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo	
<b>Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco</b>		
<b>Art. 8º, IV, "a"</b>		
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo	

O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo

Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)

**PROponente**  
**Andreson Carlos Gomes de Oliveira**  
 Chefe de Divisão de Investimentos  
 CPF:052.430.264-25  
 Entidade Certificadora: ANBIMA  
 CPA 20 e CEA  
 Validade da Certificação: 05/12/2020

**Gestor Autorizado**  
**Jose Marcos Alves de Barros**  
 Chefe de Investimentos  
 CPF:334.326.354-00  
 Entidade Certificadora: ANBIMA  
 CPA 20 e CEA  
 Validade da Certificação: 21/11/2021

 **ASSINADO DIGITALMENTE POR**  
 JOSE MARCOS ALVES DE BARROS  
 CPF: 334.326.354-00 DATA: 21/08/2020 08:48  
 LOCAL: RECIFE-PE  
 REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

 **ASSINADO DIGITALMENTE POR**  
 ANDRESON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA  
 CPF: 052.430.264-25 DATA: 21/08/2020 09:46  
 LOCAL: RECIFE-PE  
 REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

Ilmo Senhor  
**PEDRO PAULO**  
Gerente de Relacionamento  
**Banco do Brasil S.A. – Agência Setor Público - Recife -PE**  
NESTA

Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 38.250.000,00 (Trinta e oito milhões e duzentos e cinquenta mil reais.), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05 e aplicar o valor de R\$ 38.000.000,00 (Trinta e oito milhões de reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 10.418.335/0001-88.

Ambos vinculados à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 122/2020

  
**JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS**  
GERENTE DE INVESTIMENTOS

  
**ÉLCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES**  
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

ASSINADO DIGITALMENTE POR  
JOSE MARCOS ALVES DE BARROS  
CPF: 334.326.354-00 DATA: 18/08/2020 08:01  
LOCAL: RECIFE-PE  
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

ASSINADO DIGITALMENTE POR  
ELCIO RICARDO LEITE GUIMARAES  
CPF: 224.849.814-49 DATA: 18/08/2020 08:38  
LOCAL: RECIFE-PE  
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)



Características	Informações Operacionais
CNPJ: 13.077.415/0001-05	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 1,00%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 272604	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 28/04/2011	

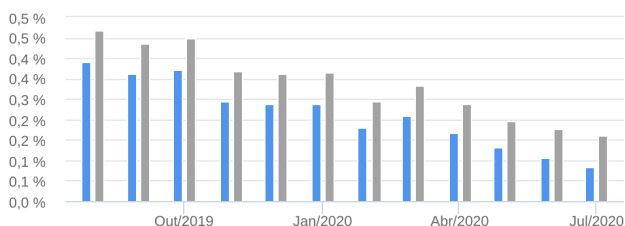
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19
Fundo	110,90	1,39	2,92	8,31	14,69	0,10	0,13	0,16	0,20	0,25	0,22	0,29	0,28	0,29	0,38	0,37	0,41
% do CDI	86,22	67,99	73,02	78,12	79,75	52,46	60,81	66,81	69,79	73,55	73,69	75,83	76,00	77,53	80,14	80,30	81,14
CDI	128,63	2,05	4,00	10,63	18,42	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50
Ibovespa	55,41	-11,74	2,61	32,42	51,53	8,27	8,76	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67
IBX	101,79	-11,21	3,31	35,98	54,50	8,41	8,97	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16
IGP-M	75,61	7,15	10,16	16,35	26,30	2,23	1,56	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,109021023	2.546.644,01	1.673.576,37	0,07%	-	0,03%	0,96	0,01%	0,38%	0,10%	0
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,48%	0,19%	0

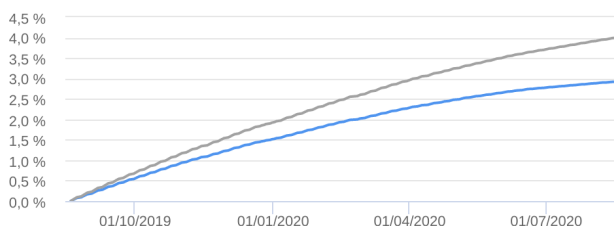
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

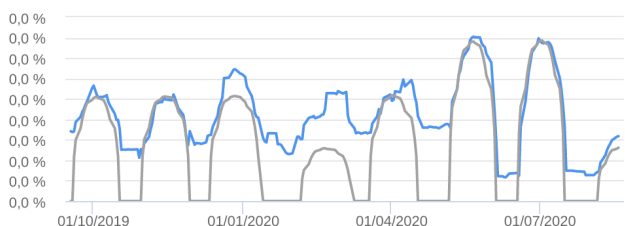
Retorno Mensal - 01/08/2019 a 18/08/2020 (mensal)



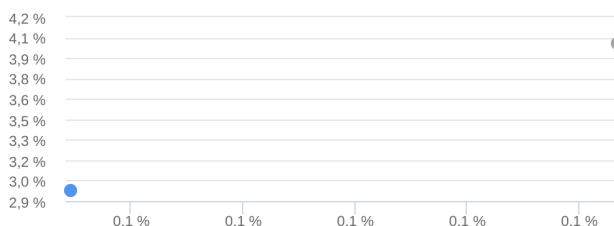
Retorno Acumulado - 20/08/2019 a 18/08/2020 (diária)



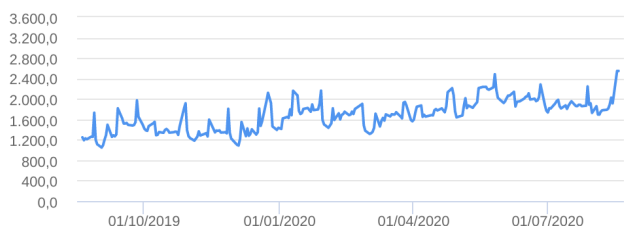
Volatilidade Anualizada - 20/08/2019 a 18/08/2020 (diária)



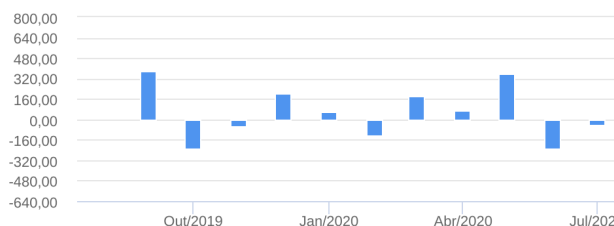
Risco x Retorno - 20/08/2019 a 18/08/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 20/08/2019 a 18/08/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/08/2019 a 18/08/2020 (mensal)



Composição da Carteira

jul/2020

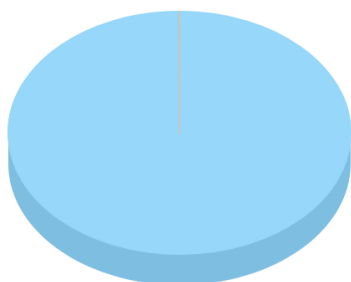
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.



Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		24 meses		06 meses	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01	0,09	100,57	2,04	99,44	3,96	99,02	10,50	98,80	0,05	R\$ 1.671.145.770,5

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.725.378,04	1.768.065,68	1.994.953,77	1.637.982,39	1.561.401,90	1.376.949,54	1.500.776,66	1.433.610,13	
Data da Divulgação	04/08/2020	02/07/2020	02/06/2020	05/05/2020	03/04/2020	04/03/2020	04/02/2020	03/01/2020	

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)									jul/2020
--	--	--	--	--	--	--	--	--	----------



Cotas de BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA	100,01 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Outros Valores a pagar	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Anbid	0,00 %

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 10.418.335/0001-88	Aplicação Mínima: R\$ 200,00
Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 200,00
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 200,00
Taxa de Administração: 1,00%	Resgate Mínimo: R\$ 200,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Ações Indexados	Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
Código de Referência: 228842	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du
Início do Fundo: 10/06/2009	

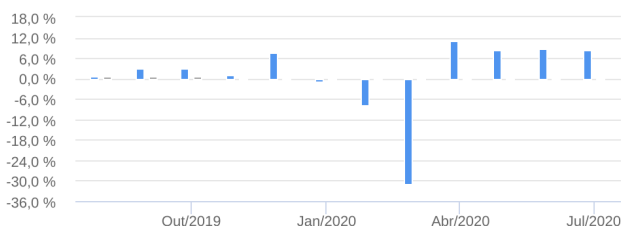
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19
Fundo	169,61	-12,35	3,29	36,81	46,56	8,44	8,89	8,21	10,99	-30,82	-7,77	-1,09	7,56	0,99	2,80	3,03	0,50
% do CDI	98,64	-601,18	82,55	346,83	253,25	4.344,07	4.188,98	3.481,68	3.856,33	-9.109,40	-2.643,69	-288,56	2.016,49	260,92	583,24	654,37	99,74
CDI	171,95	2,05	3,99	10,61	18,38	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50
Ibovespa	88,31	-12,79	1,64	31,29	47,70	8,27	8,76	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67
IBX	145,56	-12,23	2,33	34,81	50,71	8,41	8,97	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16
IGP-M	100,06	7,19	10,23	16,35	26,34	2,23	1,56	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2.696126873	950.958,40	715.266,21	43,39%	-47,23%	20,60%	-11,18	43,39%	10,99%	-30,82%	8
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,48%	0,19%	0

Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 01/08/2019 a 19/08/2020 (mensal)



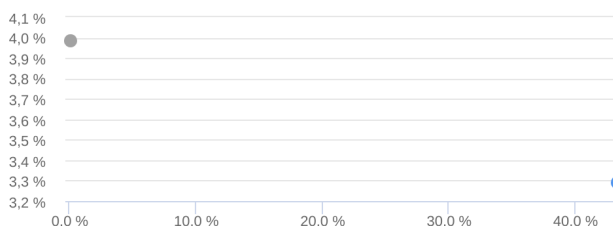
Retorno Acumulado - 21/08/2019 a 19/08/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 21/08/2019 a 19/08/2020 (diária)



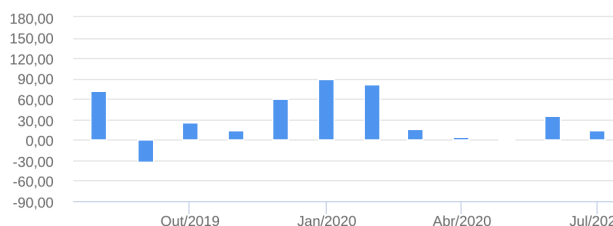
Risco x Retorno - 21/08/2019 a 19/08/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 21/08/2019 a 19/08/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/08/2019 a 19/08/2020 (mensal)



Composição da Carteira

jul/2020

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

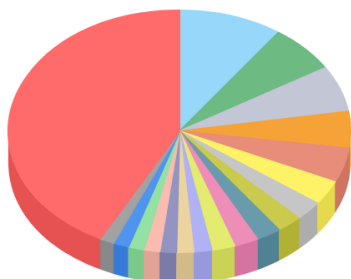
Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19
Ações	94,48%	94,68%	94,84%	94,62%	95,29%	94,15%	95,72%	94,59%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	3,05%	2,82%	3,11%	3,03%	2,89%	2,73%	2,81%	2,58%
Operações Compromissadas	2,22%	1,18%	1,14%	1,09%	0,90%	2,86%	3,32%	1,97%
Outras Aplicações	1,02%	0,83%	0,56%	0,54%	0,45%	0,63%	0,66%	0,66%
Valores a receber	0,48%	2,21%	1,89%	2,87%	0,71%	2,00%	0,76%	0,55%
Disponibilidades	0,14%	0,06%	1,43%	0,05%	0,55%	0,46%	0,51%	0,09%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,02%	-0,01%	0,00%	-0,04%	-0,02%	0,01%	-0,01%	-0,00%
Valores a pagar	-1,37%	-1,76%	-2,99%	-2,17%	-0,79%	-2,85%	-3,78%	-0,44%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	912.996,61	828.382,10	727.406,88	669.048,66	598.696,50	843.490,90	826.438,30	745.475,33
Data da Divulgação	05/08/2020	06/07/2020	08/06/2020	07/05/2020	07/04/2020	10/03/2020	07/02/2020	06/01/2020

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2020



VALE ON N1 - VALE3	9,94 %
B3 ON NM - B3SA3	6,48 %
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	6,27 %
PETROBRAS PN - PETR4	4,94 %
BRADESCO PN N1 - BBDC4	4,70 %
PETROBRAS ON - PETR3	3,29 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	2,63 %
WEG ON NM - WEGE3	2,45 %
ITAUSA PN N1 - ITSA4	2,36 %
BRASIL ON NM - BBAS3	2,35 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	2,22 %
JBS ON NM - JBSS3	1,72 %
GRUPO NATURAON NM - NTCO3	1,63 %
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	1,59 %
INTERMEDICA ON NM - GNDI3	1,51 %
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	1,50 %
LOCALIZA ON NM - RENT3	1,49 %
LOJAS AMERIC PN - LAME4	1,39 %
Lançamentos positivos menores que 1,39%	42,93 %