



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

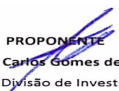

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	135 /2020 - GI
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	135 /2020 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13	Data:	15/09/20
Valor:		
R\$ 7.826.046,97	FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"	
Sete milhões, oitocentos e vinte e seis mil, quarenta e seis reais e noventa e sete centavos	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
Sim para todos os fundos desta APR		
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:		
Fundo:	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FI	
CNPJ do Fundo:	20.716.161/0001-93	
Segmento:	FI Imobiliários	
Tipo de Ativo:	FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"	
Tipo de operação realizada:	Resgate	
Valor da operação:	R\$ 27.500,00	
Quantidade de Cotas:	451,60437249	
Valor da Cota (R\$):	R\$	60,8940074000
Data da Operação:	15/09/2020	
Data de Liquidação:	15/09/2020	
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 63.025.297,73	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,044%	
Limite Máximo por PL do fundo	5,00%	
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 BAC	Sim	
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 62.570.305.000,00	
% 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.	5,56%	
Gestor:	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	
CNPJ do Gestor:	03.864.607/0001-08	
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	09/09/2020	
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Não	
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	78.1
% Recursos do Gestor com RPPS	0,88%	
Empresa de Rating	Standard&Poor's	
Conceito	AMP-2	
Representação do conceito	Muito bom	
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim	
Distribuidor:	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	
CNPJ do Distribuidor:	03.864.607/0001-08	
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	09/09/2020	

Data de Início FI:	11/09/2014	
Taxa Administração do FI (%):	0,85	
Índice de Referência do FI :	IPCA + 6,9506%	
Tx Performance do FI (%):	0,20	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	IPCA + 6,9506%	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	100,00	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	SIM	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	11/09/2024	
Data Listagem Bolsa:	01/09/2015	
Resgate (dias):	0	
Cód. Negociação Bolsa:	01/09/2015	
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 e 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:	Realizar investimentos imobiliários, objetivando auferir ganhos decorrentes da rentabilidade dos Ativos Imobiliários. Quando da aquisição de um Ativo Imobiliário representado por CRI, o Gestor levará em consideração os Critérios de Elegibilidade.
	Principais riscos do fundo:	Rendimento e Crédito Imobiliário e demais riscos contantes do regulamento (Risco: 3)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Médio Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,62%	
Retorno Médio Anual	7,74%	
Retorno Total	56,37%	

Maior Retorno	13,61%
Menor Retorno	-16,98%
Qtde. mês Positivo	57
Qtde. mês Negativo	15
Qtde. mês acima do Benchmark	38
Qtde. mês abaixo do Benchmark	34
Risco Mensal Período	3,52%
Risco Mensal 12 MESES	7,38%
Risco Anual do Período	12,20%
Retorno Relativo ao Benchmark	-17,52%
Sharpe	-0,12
Information Ratio	-0,29
Tracking Error	12,08%
VAR HISTÓRICO (95%)	6,48%
VAR 12 MESES (95%)	5,67%
Sharpe Modificado	-0,13
Beta (12 meses)	-8,12
Erro Quadrático Médio (EQM)	3,47%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recurso em razão do longo prazo de 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: 19/08/2020
Outras Observações:	Pagamento de juros
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
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?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Sim
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Sim
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
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
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 FIP 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
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
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 previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantêm 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 RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE
CNPJ do Fundo:	13.077.415/0001-05
Segmento:	FI Renda Fixa - Geral
Tipo de Ativo:	Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 7.826.046,97
Quantidade de Cotas:	3.708.736,47410695
Valor da Cota (R\$):	02/01/1900
Data da Operação:	15/09/2020
Data de Liquidação:	15/09/2020
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 2.025.032.290,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,386%
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 BAC	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 62.570.305.000,00
% 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.	5,56%
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\$ 60.958.9
% Recursos do Gestor com RPPS	5,39%
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 Risco 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:	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 performanc
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 e 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		
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior			
Retorno Médio Mensal	0,67%		
Retorno Médio Anual	8,32%		
Retorno Total	110,89%		
Maior Retorno	1,17%		
Menor Retorno	0,08%		
Qtde. mês Positivo	112		
Qtde. mês Negativo	0		
Qtde. mês acima do Benchmark	1		
Qtde. mês abaixo do Benchmark	111		
Risco Mensal Período	0,27%		
Risco Mensal 12 MESES	0,10%		
Risco Anual do Período	0,92%		
Retorno Relativo ao Benchmark	-7,80%		
Sharpe	-1,03		
Information Ratio	-14,18		
Tracking Error	0,07%		
VAR HISTÓRICO (95%)	1,11%		
VAR 12 MESES (95%)	0,67%		
Sharpe Modificado	-36,95		
Beta (12 meses)	0,89		
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 Data da reunião do Comitê de Investimentos : 19/08/2020		
Outras Observações:	Decorrente do recebimento de Contribuições Servidor no valor de R\$ 7.695.867,35. Contribuições da Câmara no valor de R\$ R\$ 103244,52. Pagamento de taxa de custódia no valor de R\$ 564,90 e recebimento de juros do fundo BB Recebíveis no valor de R\$ 27.500,00		
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco			
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		
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco			
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 F 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
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco 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 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 Andresson 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 José 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: 16/09/2020 09:03
LOCAL: RECIFE - PE
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)


ASSINADO DIGITALMENTE POR
ANDRESSON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA
CPF: 052.430.264-25 DATA: 16/09/2020 09:15
LOCAL: RECIFE - PE
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

Recife, 15 de setembro de 2020

Ofício nº 135/2020 GI

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

Senhor Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 7.826.046,97 (Sete milhões, oitocentos e vinte e seis mil, quarente e seis reais e noventa e sete centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05; vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 135/2020


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: 15/09/2020 18:17
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: 15/09/2020 21:32
LOCAL: RECIFE - PE
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

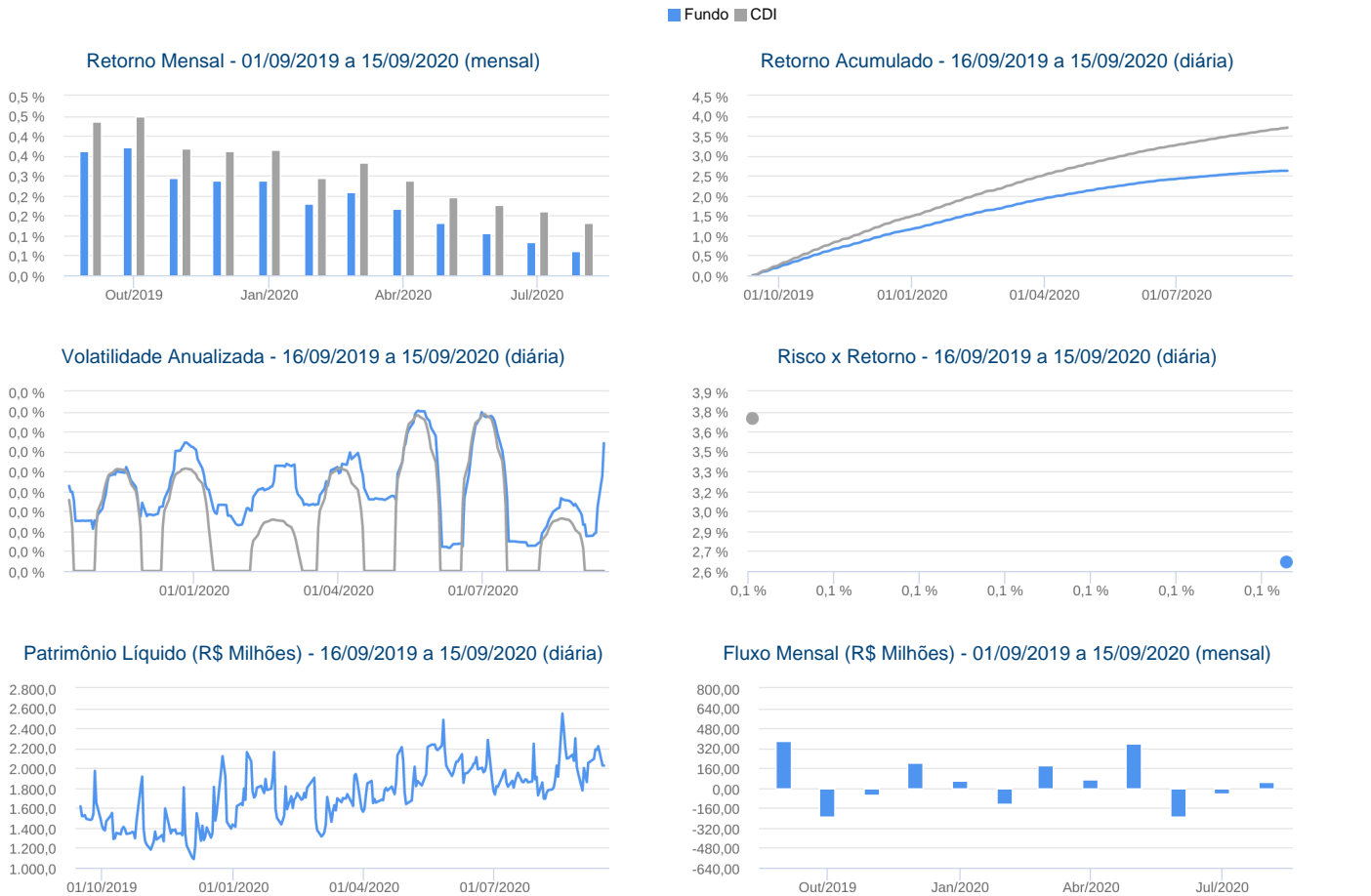


Características	Informações Operacionais
CNPJ: 13.077.415/0001-05	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 1,00%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (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	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19
Fundo	111,02	1,45	2,62	7,95	14,09	0,08	0,10	0,13	0,16	0,20	0,25	0,22	0,29	0,28	0,29	0,38	0,37
% do CDI	86,09	66,01	70,78	77,36	79,10	47,03	52,46	60,81	66,81	69,79	73,55	73,69	75,83	76,00	77,53	80,14	80,30
CDI	128,96	2,19	3,70	10,27	17,81	0,16	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46
Ibovespa	52,72	-13,27	-3,09	33,51	37,25	-3,44	8,27	8,76	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85	0,95	2,36	3,57
IBX	98,51	-12,65	-2,13	37,28	40,08	-3,38	8,41	8,97	8,52	10,27	-30,09	-8,22	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21
IGP-M	80,33	10,03	13,43	18,38	29,47	2,74	2,23	1,56	0,28	0,80	1,24	-0,04	0,48	2,09	0,30	0,68	0,00

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	2,110165288	2.025.032,29	1.731.404,61	0,07%	0,00%	0,03%	0,97	0,01%	0,38%	0,08%	0
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,48%	0,16%	0

Gráficos



Composição da Carteira ago/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.

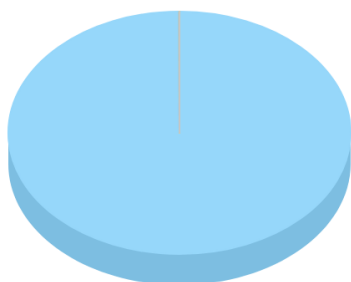
:: BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

15/09/2020

Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		Desde o início		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	0,06	86,22	2,17	98,96	3,66	98,84	21,64	98,39	0,05	R\$ 1.732.259.041,6

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	
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%	-0,00%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.775.186,41	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	
Data da Divulgação	02/09/2020	04/08/2020	02/07/2020	02/06/2020	05/05/2020	03/04/2020	04/03/2020	04/02/2020	

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)									
									ago/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 %