



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

| | | |
|--|---|--|
| AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR | Nº / ANO: | 153 /2020 - GI |
| Unidade Gestora do RPPS | OF. Nº: | 153 /2020 - GI |
| Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores CNPJ: 05.244.336/0001-13 | Data: | 20/10/20 |
| Valor: | | |
| R\$ 2.400.000,00 | | Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b" |
| Dois milhões e quatrocentos mil reais | | Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a" |
| Sim para todos os fundos desta APR | | |
| HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS: | | |
| Fundo: | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | |
| CNPJ do Fundo: | 11.328.882/0001-35 | |
| Segmento: | FI 100% Títulos Públicos | |
| Tipo de Ativo: | Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b" | |
| Tipo de operação realizada: | Resgate | |
| Valor da operação: | R\$ 2.400.000,00 | |
| Quantidade de Cotas: | 885.611,03939755 | |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ | 2,7099933190 |
| Data da Operação: | 16/10/2020 | |
| Data de Liquidação: | 16/10/2020 | |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ | 7.811.466.540,00 |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,031% | |
| 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: | 17/09/2020 | |
| Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN | Sim | |
| Volume de Recursos do Administrador com RPPS | R\$ 62.860.881.000,00 | |
| % 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. | 5,47% | |
| Gestor: | BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) | |
| CNPJ do Gestor: | 30.822.936/0001-69 | |
| Data do Termo de Credenciamento do Gestor: | 17/09/2020 | |
| Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN | Sim | |
| Volume de Recursos do Gestor com RPPS | R\$ | 61.395.556.999,47 |
| % Recursos do Gestor com RPPS | 5,32% | |
| 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: | 15/09/2020 | |

| | | |
|--|--|--|
| Data de Início FI: | 08/12/2009 | |
| Taxa Administração do FI (%): | 0,30 | |
| Índice de Referência do FI : | IRFM-1 | |
| 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: | 11.839.250/0001-36 | |
| Segmento: | Renda Fixa | |
| Tipo de Ativo: | Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b" | |
| % 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 busca retorno compatível com o do sub-índice IRFM-1. Para isso, aplica seus recursos em fundos que apliquem exclusivamente em títulos públicos federais, devendo, ainda, manter 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou índices de preços. |
| | Principais riscos do fundo: | Risco de Taxa de Juros (Risco 1) |
| | Risco do Fundo atribuído pelo Administrador | Risco Muito 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 | | 0,76% |
| Retorno Médio Anual | | 9,48% |
| Retorno Total | | 141,89% |

| | |
|---|--|
| Maior Retorno | 1,62% |
| Menor Retorno | 0,04% |
| Qtde. mês Positivo | 117 |
| Qtde. mês Negativo | 0 |
| Qtde. mês acima do Benchmark | 6 |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark | 111 |
| Risco Mensal Período | 0,29% |
| Risco Mensal 12 MESES | 0,17% |
| Risco Anual do Período | 1,02% |
| Retorno Relativo ao Benchmark | -2,69% |
| Sharpe | 0,22 |
| Information Ratio | -5,23 |
| Tracking Error | 0,06% |
| VAR HISTÓRICO (95%) | 1,24% |
| VAR 12 MESES (95%) | 0,82% |
| Sharpe Modificado | 1,91 |
| Beta (12 meses) | 0,98 |
| Erro Quadrático Médio (EQM) | 0,03% |
| 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 19/09/2020 |
| Outras Observações: | |
| 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? | Pergunta não se aplica ao fundo |
| Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ? | Pergunta não se aplica ao fundo |
| Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM? | Pergunta não se aplica ao fundo |
| Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)? | Pergunta não se aplica ao fundo |
| Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC? | Pergunta não se aplica ao fundo |
| Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito? | 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. 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 |
| 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 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 RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO |
| 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\$ 1.200.000,00 |
| Quantidade de Cotas: | 568.565,59511279 |
| Valor da Cota (R\$): | R\$ 2,1105744180 |
| Data da Operação: | 20/10/2020 |
| Data de Liquidação: | 20/10/2020 |
| Patrimônio Líquido do Fundo (R\$): | R\$ 1.931.297.000,00 |
| (%) no Patrimônio Líquido do fundo: | 0,062% |
| 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: | 17/09/2020 |
| Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN | Sim |
| Volume de Recursos do Administrador com RPPS | R\$ 62.860.881.000,00 |
| % 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. | 5,47% |
| Gestor: | BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL) |
| CNPJ do Gestor: | 30.822.936/0001-69 |
| Data do Termo de Credenciamento do Gestor: | 17/09/2020 |
| Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN | Sim |
| Volume de Recursos do Gestor com RPPS | R\$ 61.395.556.999,47 |
| % Recursos do Gestor com RPPS | 5,32% |
| 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 BACEN | 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: | 17/09/2020 |
| 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 do Fundo atribuído pelo Administrador | Risco de Taxa de Juros (Risco 2) 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 | 0,66% | |
| Retorno Médio Anual | 8,25% | |
| Retorno Total | 110,89% | |
| Maior Retorno | 1,17% | |
| Menor Retorno | 0,00% | |
| Qtde. mês Positivo | 112 | |
| Qtde. mês Negativo | 1 | |
| Qtde. mês acima do Benchmark | 1 | |
| Qtde. mês abaixo do Benchmark | 112 | |
| Risco Mensal Período | 0,27% | |
| Risco Mensal 12 MESES | 0,11% | |
| Risco Anual do Período | 0,94% | |
| Retorno Relativo ao Benchmark | -7,95% | |
| Sharpe | -1,01 | |
| Information Ratio | -13,30 | |
| Tracking Error | 0,07% | |
| VAR HISTÓRICO (95%) | 1,11% | |
| VAR 12 MESES (95%) | 0,65% | |
| Sharpe Modificado | -30,91 | |
| Beta (12 meses) | 0,97 | |
| 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 | 19/09/2020 |
| Outras Observações: | | |
| 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 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 |

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 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 do Fundo
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: 22/10/2020 08:55
LOCAL: RECIFE - PE
CODIGO: 474ea14f-39a0-4d17-a03a-be9109e77e70
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)

ASSINADO DIGITALMENTE POR
ANDRESON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA
CPF: 052.430.264-25 DATA: 22/10/2020 09:30
LOCAL: RECIFE - PE
CODIGO: e31b4023-55ef-49b3-aeb5-e80796bf013a
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 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\$ 2.400.000,00 (Dois milhões e quatrocentos mil reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 11.328.882/0001-35; e aplicar o valor de R\$ 1.200.000,00 (Um milhão e duzentos mil reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05; ambos vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 153/2020


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: 20/10/2020 08:54
LOCAL: RECIFE - PE
CODIGO: f61c9f97-dae6-4f14-b62c-b772b3962f63
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: 20/10/2020 09:40
LOCAL: RECIFE - PE
CODIGO: 187f5a40-07b2-4940-9cf1-a378fb0150ea
REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL Nº 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)



| Características | Informações Operacionais |
|--|---|
| CNPJ: 11.328.882/0001-35 | 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: 0,10% | Resgate Mínimo: R\$ 0,00 |
| Taxa de Administração (Máxima): 0,30% | Conversão da Cota para Aplicação: D+0 |
| Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados | Conversão da Cota para Resgate: D+0 |
| Código de Referência: 239003 | Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0 |
| Início do Fundo: 08/12/2009 | |

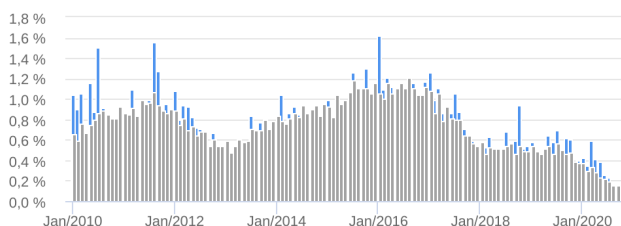
| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | set/20 | ago/20 | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 |
|---------------------|--------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo | 171,00 | 2,89 | 3,79 | 11,12 | 18,72 | 0,04 | 0,09 | 0,23 | 0,26 | 0,39 | 0,41 | 0,60 | 0,35 | 0,42 | 0,40 | 0,31 | 0,60 |
| % do IMA Geral ex-C | 78,92 | 123,86 | 124,56 | 61,36 | 67,86 | -6,03 | -12,92 | 14,03 | 28,45 | 40,13 | 48,97 | -30,91 | 79,35 | 83,83 | 43,69 | -43,76 | 35,36 |
| CDI | 161,81 | 2,37 | 3,36 | 9,82 | 17,14 | 0,16 | 0,16 | 0,19 | 0,21 | 0,24 | 0,28 | 0,34 | 0,29 | 0,38 | 0,37 | 0,38 | 0,48 |
| Ibovespa | 48,45 | -13,06 | -4,26 | 17,23 | 30,59 | -4,80 | -3,44 | 8,27 | 8,76 | 8,57 | 10,25 | -29,90 | -8,43 | -1,63 | 6,85 | 0,95 | 2,36 |
| IBX | 98,75 | -12,18 | -2,93 | 21,36 | 34,11 | -4,58 | -3,38 | 8,41 | 8,97 | 8,52 | 10,27 | -30,09 | -8,22 | -1,25 | 7,27 | 0,97 | 2,20 |
| IGP-M | 115,70 | 15,15 | 18,26 | 22,12 | 34,91 | 4,34 | 2,74 | 2,23 | 1,56 | 0,28 | 0,80 | 1,24 | -0,04 | 0,48 | 2,09 | 0,30 | 0,68 |

| 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 | 2,709993319 | 7.811.466,54 | 7.436.828,04 | 0,56% | -0,26% | 0,27% | 1,27 | 0,56% | 0,60% | 0,04% | 8 |
| CDI | - | - | - | 0,07% | - | 0,03% | 1,00 | 0,00% | 0,38% | 0,16% | 0 |

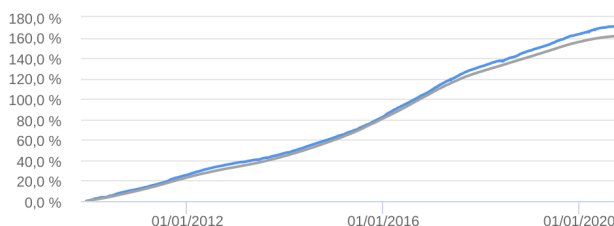
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

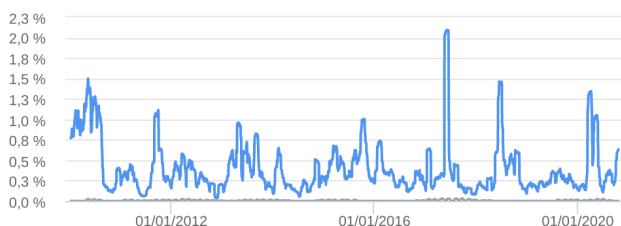
Retorno Mensal - 09/12/2009 a 20/10/2020 (mensal)



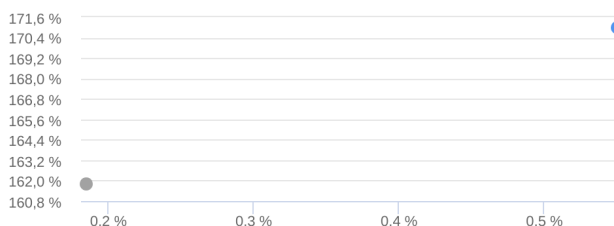
Retorno Acumulado - 09/12/2009 a 20/10/2020 (diária)



Volatilidade Anualizada - 09/12/2009 a 20/10/2020 (diária)



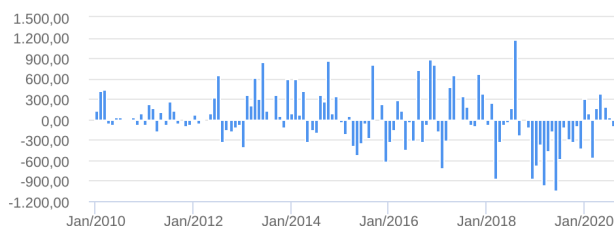
Risco x Retorno - 09/12/2009 a 20/10/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 09/12/2009 a 20/10/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 09/12/2009 a 20/10/2020 (mensal)



Composição da Carteira

set/2020

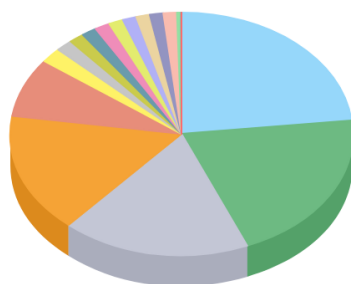
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

20/10/2020

| Performance dos Fundos em Carteira | | Retorno (%) / % do Benchmark - CDI | | | | | | | | | |
|------------------------------------|---------|------------------------------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------------|
| FUNDO | % do PL | Mês | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | Desde o início |
| | | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Volatilidade | PL Médio |
| BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 100,00 | 0,07 | 73,74 | 154,85 | 104,91 | 154,85 | 104,91 | 154,85 | 104,91 | - | |

| Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) | | | | | | | | | |
|--|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|----------|
| Tipo de Aplicação | set/20 | ago/20 | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | |
| Cotas de Fundos | 100,00% | 100,00% | 100,00% | 100,00% | 100,00% | 100,00% | 100,00% | 100,00% | 100,00% |
| Valores a pagar | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 7.413.658,57 | 7.749.783,93 | 7.835.713,66 | 7.792.694,55 | 7.581.218,92 | 7.168.032,69 | 6.969.533,40 | 7.492.585,72 | |
| Data da Divulgação | 05/10/2020 | 02/09/2020 | 04/08/2020 | 02/07/2020 | 02/06/2020 | 05/05/2020 | 03/04/2020 | 04/03/2020 | |
| Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%) | | | | | | | | | set/2020 |



| | |
|--|---------|
| NTN-F - Venc.: 01/01/2021 | 23,23 % |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022 | 20,51 % |
| LTN - Venc.: 01/10/2020 | 17,72 % |
| LTN - Venc.: 01/04/2021 | 15,90 % |
| LTN - Venc.: 01/10/2021 | 7,87 % |
| LTN - Venc.: 01/07/2021 | 1,99 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2021 | 1,58 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2024 | 1,43 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2025 | 1,43 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2026 | 1,42 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2022 | 1,37 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2021 | 1,30 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2025 | 1,29 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2026 | 1,28 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2023 | 1,26 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2023 | 0,41 % |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DI Futuro | 0,01 % |
| Mercado Futuro - Posições compradas - DIFUTJ21 | 0,00 % |
| Lançamentos positivos menores que 0,00% | 0,00 % |

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.

| 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 | |

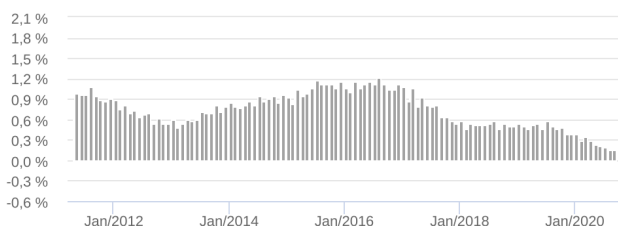
| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | set/20 | ago/20 | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 |
|---------------------|--------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo | 111,06 | 1,47 | 2,22 | 7,44 | 13,37 | 0,00 | 0,08 | 0,10 | 0,13 | 0,16 | 0,20 | 0,25 | 0,22 | 0,29 | 0,28 | 0,29 | 0,38 |
| % do IMA Geral ex-C | 64,82 | 62,77 | 73,06 | 41,07 | 48,48 | 0,04 | -11,01 | 6,14 | 14,31 | 16,26 | 23,61 | -12,87 | 48,66 | 57,09 | 31,31 | -42,05 | 22,68 |
| CDI | 129,37 | 2,37 | 3,36 | 9,82 | 17,14 | 0,16 | 0,16 | 0,19 | 0,21 | 0,24 | 0,28 | 0,34 | 0,29 | 0,38 | 0,37 | 0,38 | 0,48 |
| Ibovespa | 53,09 | -13,06 | -4,26 | 17,23 | 30,59 | -4,80 | -3,44 | 8,27 | 8,76 | 8,57 | 10,25 | -29,90 | -8,43 | -1,63 | 6,85 | 0,95 | 2,36 |
| IBX | 99,59 | -12,18 | -2,93 | 21,36 | 34,11 | -4,58 | -3,38 | 8,41 | 8,97 | 8,52 | 10,27 | -30,09 | -8,22 | -1,25 | 7,27 | 0,97 | 2,20 |
| IGP-M | 88,71 | 15,15 | 18,26 | 22,12 | 34,91 | 4,34 | 2,74 | 2,23 | 1,56 | 0,28 | 0,80 | 1,24 | -0,04 | 0,48 | 2,09 | 0,30 | 0,68 |

| 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 | 2,110574418 | 1.931.297,00 | 1.777.098,12 | 0,16% | -0,17% | 0,08% | 1,02 | 0,14% | 0,29% | 0,00% | 0 |
| CDI | - | - | - | 0,07% | - | 0,03% | 1,00 | 0,00% | 0,38% | 0,16% | 0 |

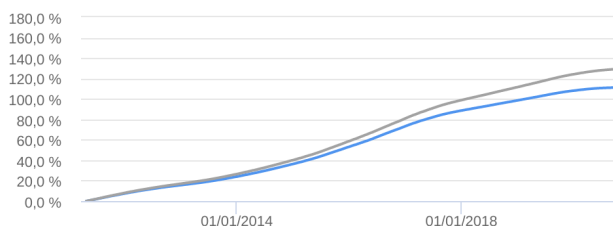
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

Retorno Mensal - 29/04/2011 a 20/10/2020 (mensal)



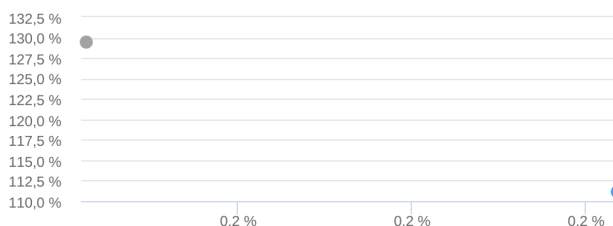
Retorno Acumulado - 29/04/2011 a 20/10/2020 (diária)



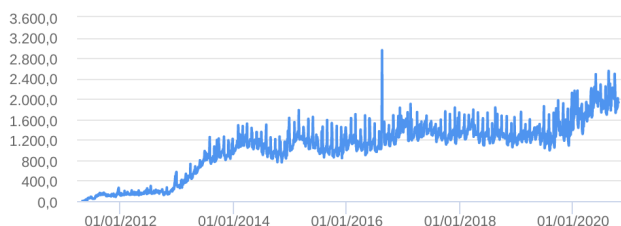
Volatilidade Anualizada - 29/04/2011 a 20/10/2020 (diária)



Risco x Retorno - 29/04/2011 a 20/10/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 20/10/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/04/2011 a 20/10/2020 (mensal)



Composição da Carteira

set/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.

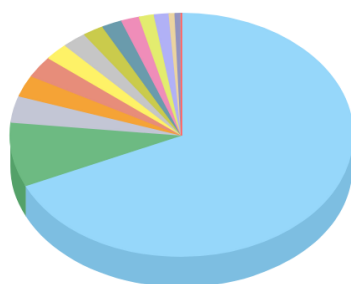
:: BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

20/10/2020

| Performance dos Fundos em Carteira | | Retorno (%) / % do Benchmark - CDI | | | | | | | | | |
|--|---------|------------------------------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------------|
| FUNDO | % do PL | Mês | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | Desde o início |
| | | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Volatilidade | PL Médio |
| BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA | 100,01 | 0,10 | 98,03 | 21,78 | 98,05 | 21,78 | 98,05 | 21,78 | 98,05 | - | |

| Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL) | | | | | | | | | |
|--|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------|
| Tipo de Aplicação | set/20 | ago/20 | jul/20 | jun/20 | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/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% | -0,00% | -0,01% | -0,01% | -0,01% | -0,01% |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 1.878.414,58 | 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 | |
| Data da Divulgação | 05/10/2020 | 02/09/2020 | 04/08/2020 | 02/07/2020 | 02/06/2020 | 05/05/2020 | 03/04/2020 | 04/03/2020 | |

| Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%) | | | | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| set/2020 | | | | | | | | | |



| | |
|--|---------|
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022 | 68,16 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2021 | 8,54 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2023 | 3,53 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2021 | 2,85 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2022 | 2,85 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2022 | 2,27 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2023 | 2,27 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2025 | 1,97 % |
| Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025 | 1,92 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2024 | 1,70 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2024 | 1,41 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2026 | 1,38 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2025 | 0,56 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2026 | 0,56 % |
| Outros Valores a receber | 0,01 % |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 0,00 % |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | 0,00 % |
| Outros Valores a pagar | 0,00 % |
| Lançamentos positivos menores que 0,00% | 0,00 % |

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.