



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:	099 /2019 - GI	
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	099 /2019 - GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	16/04/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13				
Valor:				
R\$ 70.000.000,00	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"			
Setenta milhões de reais				
Sim para todos os fundos desta APR				
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:				
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO			
CNPJ do Fundo:	13.322.205/0001-35			
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\$ 70.000.000,00			
Quantidade de Cotas:	28.216.691,51590430			
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,48080			
Data da Operação:	16/04/2019			
Data de Liquidação:	17/04/2019			
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	7.195.971.060,00		
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,973%			
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:	25/10/2018			
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 56.854.639.000,00			
% 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.	5,82%			
Gestor:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)			
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69			
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	25/10/2018			
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim			
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	54.952.382.976,91		
% Recursos do Gestor com RPPS	5,66%			
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:	30/10/2018			

Data de Início FI:	28/04/2011	
Taxa Administração do FI (%):	0,20	
Índice de Referência do FI :	IDKA IPCA 2A	
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):	1	
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 como objetivo proporcionar rentabilidade de suas cotas compatível com o do sub-índice IDKA 2A. Para atingir esse objetivo, aplica a totalidade de seus recursos exclusivamente em títulos públicos federais, registrados no SFHIC e/ou em suas operações compromissadas. Deverá, ainda, manter no mínimo 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	0,96%	
Retorno Médio Anual	12,13%	
Retorno Total	145,13%	

Maior Retorno		3,50%
Menor Retorno		-0,91%
Qtde. mês Positivo		84
Qtde. mês Negativo		10
Qtde. mês acima do Benchmark		35
Qtde. mês abaixo do Benchmark		59
Risco Mensal Período		0,78%
Risco Mensal 12 MESES		0,80%
Risco Anual do Período		2,72%
Retorno Relativo ao Benchmark		-4,69%
Sharpe		0,72
Information Ratio		-1,23
Tracking Error		0,56%
VAR HISTÓRICO (95%)		2,25%
VAR 12 MESES (95%)		2,06%
Sharpe Modificado		0,99
Beta (12 meses)		0,85
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,17%
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 RECIAPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	11/03/2019
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?

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?

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?

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

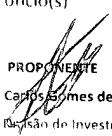
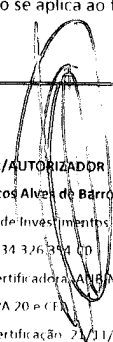
Pergunta não se aplica ao fundo

Pergunta não se aplica ao fundo

Pergunta não se aplica ao fundo


Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO		
CNPJ do Fundo:	07.442.078/0001-05		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 70.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	13.210.843.99861660		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 5,29867		
Data da Operação:	17/04/2019		
Data de Liquidação:	17/04/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	4.967.224.290,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,409%		
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:	25/10/2018		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 56.854.639.000,00		
% 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.	5,82%		
Gestor:	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)		
CNPJ do Gestor:	30.822.936/0001-69		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	25/10/2018		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	54.952.382.976,91	
% Recursos do Gestor com RPPS	5,66%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Excelente		
Representação do conceito	Excelente		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	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:	25/10/2018		
Data de Início FI:	24/07/2005		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		
Índice de Referência do FI :	IMA B		
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):	1	
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 busca retorno dos investimentos através do sub-índice IMA-B. Para isso, aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais, registrados no SELIC e/ou em suas operações compromissadas. Deve, ainda, manter, no mínimo, 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 do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco de Taxa de Juros (Risco 5) 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	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,96%	
Retorno Médio Anual	12,13%	
Retorno Total	145,13%	
Maior Retorno	3,50%	
Menor Retorno	-0,91%	
Qtde. mês Positivo	84	
Qtde. mês Negativo	10	
Qtde. mês acima do Benchmark	35	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	59	
Risco Mensal Período	0,78%	
Risco Mensal 12 MESES	0,80%	
Risco Anual do Período	2,72%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-4,69%	
Sharpe	0,72	
Information Ratio	-1,23	
Tracking Error	0,56%	
VAR HISTÓRICO (95%)	2,25%	
VAR 12 MESES (95%)	2,06%	
Sharpe Modificado	0,99	
Beta (12 meses)	0,85	
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,17%	
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 RFCIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	11/03/2019

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, mantém 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/AUTORIZADOR José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF 334 326 934 00 Entidade Certificadora ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2021

Recife, 16 de abril de 2019

Ofício RECIPREV nº 099/2019 – GI



Senhor Gerente,

Solicitamos resgatar o valor de R\$ 70.000.000,00 (Setenta milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO e aplicar o valor de R\$ 70.000.000,00 (Setenta milhões de reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.442.078/0001-05; vinculado à conta 7.909-X.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 099/2019

Atenciosamente,



JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS

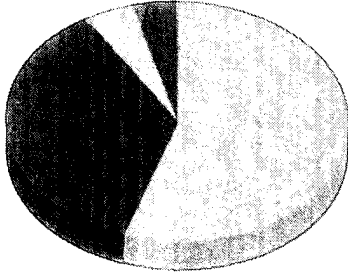


FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR
DIRETOR VICE PRESIDENTE

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

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

mar/2019



NTN-B - Venc.: 15/05/2021	54,98 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2020	36,01 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	4,65 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	4,14 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2019	0,22 %
Mercado Futuro - Posições compradas - CUPOM DE DI x IPCA DAP	0,00 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ22	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Outros Valores a pagar	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas, consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo QUEMDEB, podendo este não ser responsável por qualquer das consequências de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendações de investimento ou opinião de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo. Gastos do carteira de qualquer natureza decorrem com o custo da administração do fundo. Resultados obtidos no passado não representam garantia de rentabilidade futura. As estratégias de investimentos adotadas pelo fundo podem resultar em perdas para seus investidores superiores ao capital aplicado e a consequente interrupção das operações de investimento do fundo de investimento. Ao investir é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento no aplicativo invest.br. Para saber mais sobre o fundo de investimento, consulte a análise de desempenho (12 doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os detalhes das informações, consulte o site invest.br.

Características

CNPJ: 07.442.078/0001-05
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anterior: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 242901
 Início do Fundo: 24/07/2005

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 10.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+1 do
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 do

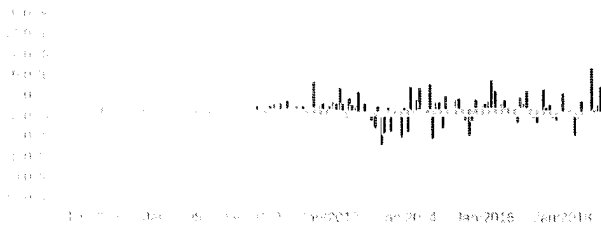
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18	abr/18
Fundo	429,87	5,44	13,48	25,33	50,48	0,56	0,50	4,36	1,62	0,91	7,07	-0,16	-0,46	2,29	-0,35	-3,17	-0,15
% do CDI	132,09	295,98	210,81	165,39	162,56	119,13	100,58	802,15	327,30	184,04	1.301,92	-34,52	-81,50	422,99	-67,86	-611,77	-29,06
CDI	325,43	1,84	6,40	15,32	31,05	0,47	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52	0,52
Ibovespa	274,40	6,14	12,58	44,29	85,96	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87	0,88
IRX	405,56	6,25	13,64	45,36	87,63	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91	0,82
IGP-M	115,13	2,47	8,28	9,23	13,99	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38	0,57

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	5,298673349	4.967.224,29	4.029.666,74	5,92%	-5,81%	2,81%	-9,23	5,92%	7,07%	-3,17%	7
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

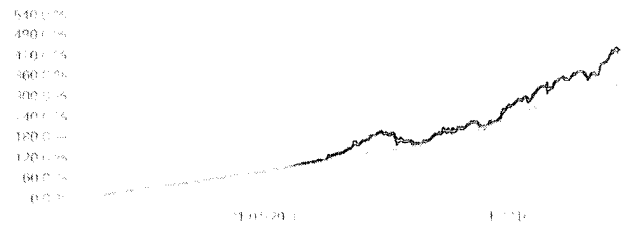
Gráficos

Fundo CDI

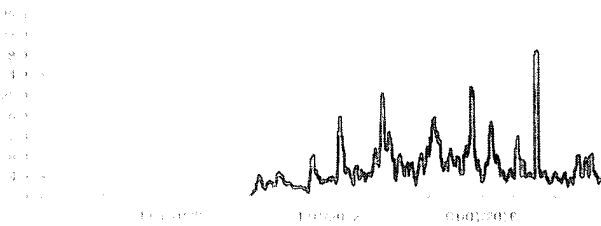
Retorno Mensal - 27/06/2005 a 17/04/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 27/06/2005 a 17/04/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 27/06/2005 a 17/04/2019 (diária)

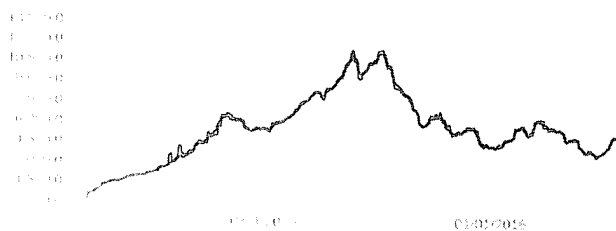


Risco x Retorno - 27/06/2005 a 17/04/2019 (diária)

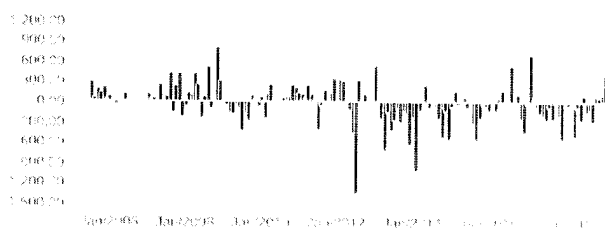


As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e atualidade das mesmas assumida pelo OBIANFI/BB pelo Fundo desta maneira e por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro produto financeiro. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer instituição financeira ou qualquer outra entidade. O valor líquido do fundo não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias de investimentos utilizadas com o propósito de obter o maior retorno possível podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente redução do valor líquido do fundo por serem investidas em ativos de risco e por serem investidas em ativos de risco. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para análises de risco, consulte o relatório de risco e a análise de risco disponível a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os cálculos foram utilizadas informações dos últimos 12 (doze) meses.

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 27/06/2005 a 17/04/2019 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 27/06/2005 a 17/04/2019 (mensal)



Composição da Carteira

mar/2019

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	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18
Títulos Públicos	87,90%	90,21%	97,55%	98,29%	96,97%	98,33%	99,59%	99,57%
Operações Compromissadas	12,03%	9,72%	2,36%	1,62%	2,94%	1,57%	0,32%	0,34%
Outras Aplicações	0,07%	0,07%	0,08%	0,09%	0,10%	0,10%	0,09%	0,09%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,00%	-0,00%	0,01%	-0,00%	-	-	-	-
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	4.887.849,43	4.614.280,76	4.159.431,81	3.870.963,79	3.733.451,66	3.596.631,65	3.646.686,50	3.764.381,11
Data da Desligação	02/04/2019	08/03/2019	05/02/2019	07/01/2019	04/12/2018	05/11/2018	05/10/2018	06/09/2018

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela BBIMB, pelo grupo desta instituição ou por qualquer dos membros de seu grupo empresarial. As informações respectivas não devem ser entendidas como recomendação, distribuição ou oferta de fundos de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Tipos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor do carteira, de qualquer instituição financeira ou qualquer outra entidade. O rendimento obtido no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias de diversificação utilizadas como parte da política de investimentos de todos os investimentos podem resultar em significativas perdas para seus colistas superiores ao capital aplicado e a consequente cobrança do colista de qualquer instituição financeira ou de qualquer outro valor mobiliário. Ao assinar, é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar em quaisquer. Cada colista deve ler atentamente o regulamento do fundo e realizar a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (R\$). Para os detalhes, favor consultar o site da BBIMB, Fundação BBIMB.

