

ANÁLISE E CREDENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 10.418.362/0001-50 - BB Previdenciário Multimercado

Segmento: Renda Variável

Tipo de Ativo: FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III

Data do Termo: 30/07/2021

Conclusão do Credenciamento: Fundo enquadrado em relação à Resolução 3922/2010.

INSTITUIÇÕES

Administrador: 30.822.936/0001-69 - BB Gestão DTVM

Gestor: 30.822.936/0001-69 - BB Gestão DTVM

Art. 15º da Resolução 3922/2010: Ambas as instituições atendem ao inciso I do parágrafo 2º.

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Aplicação Inicial Mínima (R\$): 10.000,00

Aplicação Adicional Mínima (R\$): 0,00

Data de Início: 02/03/2009

Índice de Referência: CDI

Carência: Não há

Prazo de Resgate: D+4

Categoria de Investidor: Geral

Taxa de Saída: 0,00

Taxa de Administração: 0,60%

Taxa de Performance: Não há

Investe em cotas de outros fundos: Não

Possui ativos de Emissores Privados: Sim

Sim - Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira

Não - Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registradas 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

Obs.: Informações referentes à 17/12/2020.

CONCLUSÃO DA ANÁLISE

Análise do regulamento e demais documentos disponibilizados pelo gestor do fundo de investimento e os riscos inerentes às operações previstas

Para alcançar seus objetivos, o fundo aplicará seus recursos em uma carteira composta, isolada ou cumulativamente, pelos seguintes ativos: - Títulos Públicos Federais - Títulos Privados - Operações Compromissadas - Operações com Derivativos - Cotas de FIDC - FIC FIDC - Cotas FII - DPGE - Bônus ou recibos de subscrição, Certificados de Depósitos de Ações, BDR e Ações. A carteira formada por esses ativos deverá apresentar prazo médio superior a 365 dias, devendo ser adotada gestão ativa que envolva vários fatores de risco, sem a concentração em nenhum fator em especial ou em fatores diferentes. O fundo fica sujeito ao risco sistêmico, decorrente de todo o mercado, ao risco referente aos ativos investidos pelo gestor. Há mais riscos que podem ser consultados no regulamento do fundo, mas o destaque cabe aos citados anteriormente.

Adequação das características do fundo frente às necessidades de liquidez do RPPS

O fundo possui liquidez em D+4.

Adequação da política de seleção, alocação e diversificação de ativos e, quando for o caso, a política de concentração de ativos

A composição da carteira está condizente com o regulamento e objetivo propostos.

Avaliação dos dados comparativos no que se refere aos custos, retorno e risco de fundos de investimento similares

O fundo objeto da análise foi comparado com 5 outros fundos, de mesmo benchmark (CDI) e enquadramento (8°, III) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,60%, ficou abaixo da média de 0,69% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 2,04%, performou acima da média de 2,02%. Base de comparação:

00.836.263/0001-35 - Votorantim Eagle Crédito Privado Multimercado - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 2,88

01.541.649/0001-82 - Bradesco FIC Golden Profit Conservador Mult. - Tx Adm: 1,20 - Rent 12M: 2,56

00.973.117/0001-51 - Itaú FIC Juros e Moedas Institucional Mult. - Tx Adm: 0,35 - Rent 12M: 2,40

02.998.164/0001-85 - Bradesco Plus I Multimercado - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 1,82

01.606.543/0001-10 - Bradesco FIC Alocação Moderada Multimercado - Tx Adm: 1,00 - Rent 12M: 0,41

Verificação da compatibilidade entre o objetivo de retorno do fundo de investimento, a política de investimento do fundo, o limite de risco divulgado pelo gestor, quando couber, e eventual adequação do parâmetro utilizado para a cobrança da taxa de performance

O fundo tem como objetivo buscar a valorização de suas cotas através da aplicação dos recursos em uma carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, que busque retorno superior à variação do CDI, através de investimentos em diversas classes de ativos financeiros, inclusive renda variável. Não há cobrança de taxa de performance.

Verificação das hipóteses de eventos de avaliação, amortização e liquidação, inclusive antecipada, quando aplicável

O fundo não possui carência para resgate. Sua liquidez é em D+4.

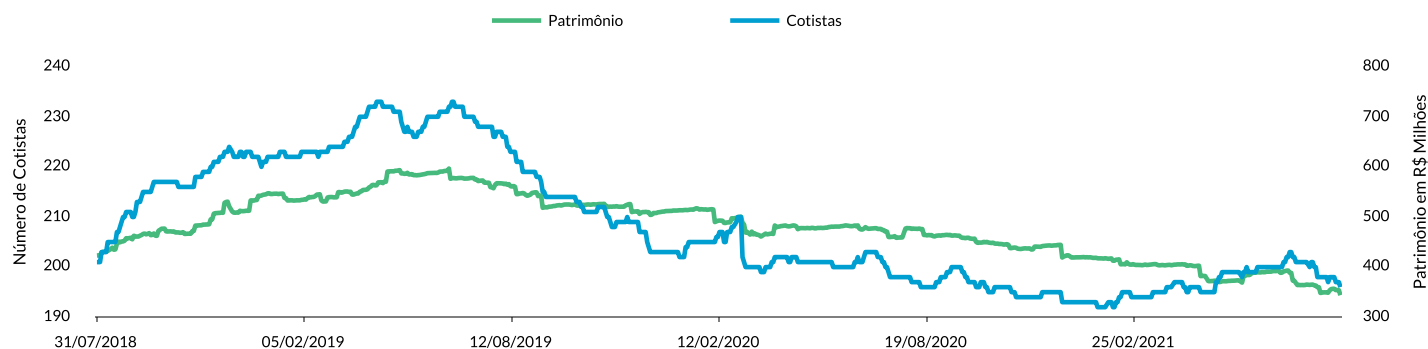
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

Foram observados 5 fundos da gestora 30.822.936/0001-69 - BB Gestão DTVM, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 03.752.361/0001-82, 09.005.838/0001-42, 06.015.368/0001-00, 05.962.491/0001-75, 11.046.635/0001-46. Em matéria de performance, 5 ficaram acima do benchmark.

Em caso de fundos de investimento cujas carteiras sejam representadas, exclusivamente ou não, por cotas de outros fundos de investimento, deverá ser verificado que a carteira dos fundos investidos atende aos requisitos previstos em Resolução do CMN

Não se aplica.

PATRIMÔNIO LÍQUIDO E COTISTAS



PERÍODO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	NÚMERO DE COTISTAS
Atual	364.489.538,74	200
Médio em 12 meses	418.536.740,85	196
Médio em 24 meses	460.790.095,21	201

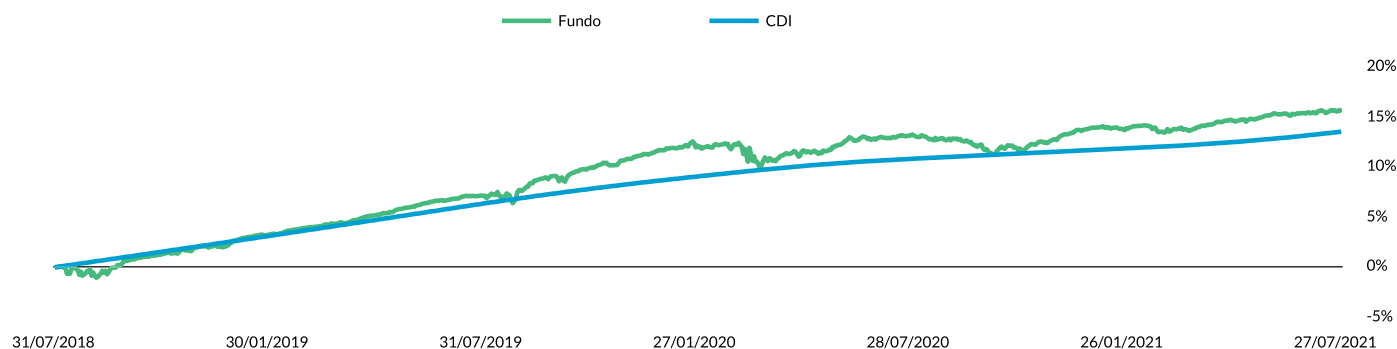
RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2019	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,82	0,59	0,44	0,79	0,77	0,69	0,41	0,53	1,30	0,77	0,80	0,78	9,03
CDI	0,54	0,49	0,47	0,52	0,54	0,47	0,57	0,50	0,47	0,48	0,38	0,38	5,97
% CDI	150,36	120,49	92,95	151,89	142,62	146,32	72,43	104,59	279,06	159,88	209,33	207,09	151,28

2020	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,13	0,18	-1,10	0,70	0,57	0,46	0,37	-0,42	-0,77	-0,21	1,01	1,10	2,01
CDI	0,38	0,29	0,34	0,28	0,24	0,22	0,19	0,16	0,16	0,16	0,15	0,16	2,77
% CDI	33,82	59,74	-322,04	244,17	239,40	215,01	190,29	-263,06	-490,26	-131,08	676,76	668,90	72,74

2021	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-0,11	-0,28	0,45	0,57	0,43	0,20	0,28						1,54
CDI	0,15	0,13	0,20	0,21	0,27	0,30	0,34						1,61
% CDI	-76,43	-208,55	226,50	275,24	160,94	65,65	81,72						95,56

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Títulos Públicos	249.565.779,13	68,47
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	45.160.734,81	12,39
Cotas de Fundos	14.620.910,15	4,01
Operações Compromissadas	12.217.108,88	3,35
Debêntures	33.056.622,27	9,07
Ações	9.446.525,00	2,59
Disponibilidades	503.000,00	0,14
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	651.027,72	0,18
Valores a receber	338.111,83	0,09
Mercado Futuro - Posições vendidas	35.198,00	0,01
Valores a pagar	-696.675,60	-0,19
Mercado Futuro - Posições compradas	-374.000,00	-0,10
Opções - Posições titulares	0,00	0,00
Opções - Posições lançadas	-38.335,00	-0,01

Obs.: Informações referentes à 30/07/2021.

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO

Ao assinar o Credenciamento, os responsáveis atestam que:

- i) Possuem conhecimento dos aspectos que caracterizam este Fundo de Investimento, em relação ao conteúdo de seu Regulamento e de fatos relevantes que possam contribuir para seu desempenho, além de sua compatibilidade ao perfil da carteira e à Política de Investimentos do RPPS;
- ii) Este documento não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos no fundo, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância das condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência e os requisitos e limites previstos na Resolução do CMN, a aderência à Política de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.
- iii) Estão cientes de que a rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura, e que não há qualquer tipo de garantia, implícita ou explícita, prestada pelo emissor deste relatório e/ou empresas coligadas, ou por qualquer mecanismo de seguro, ou ainda pelo Fundo Garantidor de Crédito.

NOME	CPF	ASSINATURA