

BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I

39.255.695/0001-98

## Resumo

Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM

Auditoria: KPMG

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM

Início: 30/11/2020

Custodiante: Banco do Brasil

Resolução: Artigo 9º, Inciso III

## Taxas

Taxa de Administração: 1,00%

Índice de Performance: 100% do MSCI All Countries World Index

Taxa de Performance: 10,00%

Taxa de Resgate: Não possui

Carência: Não há

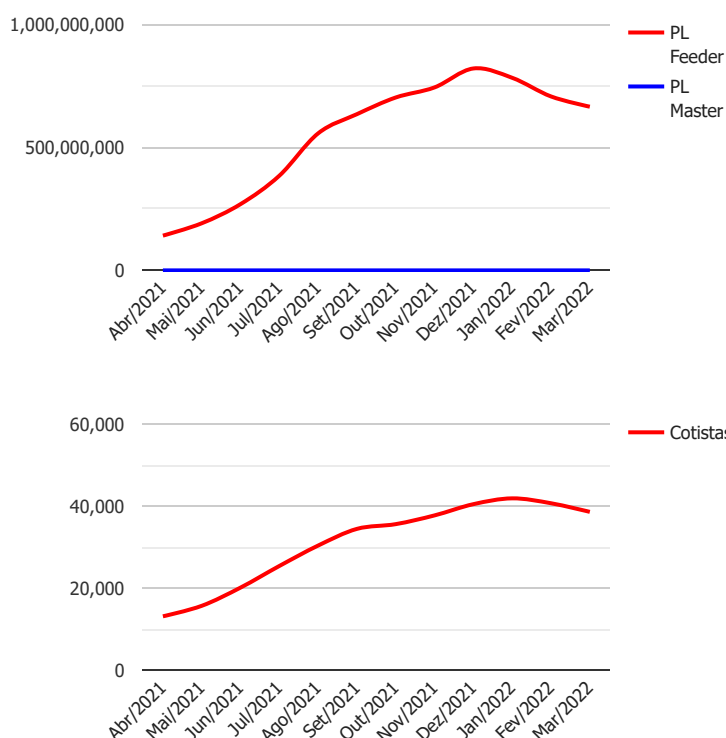
Benchmark: GLOBAL BDRX

Público Alvo: Investidores em geral

Investidor Qualificado: Não

## Evolução PL e Cotistas

MÊS	Fundo Feeder		Fundo Master
	COTISTA	PL FEEDER	PL MASTER
Abr/2021	13.151	141.362.598,21	
Mai/2021	15.709	191.582.197,72	
Jun/2021	20.157	269.443.832,58	
Jul/2021	25.432	385.077.403,80	
Ago/2021	30.419	557.309.483,71	
Set/2021	34.487	635.392.765,15	
Out/2021	35.644	703.179.700,26	
Nov/2021	37.778	744.250.108,86	
Dez/2021	40.516	821.176.545,31	
Jan/2022	41.933	783.148.331,71	
Fev/2022	40.740	707.400.204,21	
Mar/2022	38.634	665.701.908,64	



BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I

39.255.695/0001-98

### Informações Operacionais

Depósito Inicial: 0,00

Conversão de Cota para Aplicação: D+0

Movimentação Mínima: 0,00

Conversão de Cota para Resgate: D+0

Disponibilidade dos Recursos Aplicados: D+0

Disponibilidade dos Recursos Resgatados: D+2 du

### Histórico

Máximo Retorno Diário: 4,14% em 25/02/2022

Retorno acumulado desde o início: 20,83%

Número de dias com Retorno Positivo: 181

Número de dias com retorno negativo: 154

Mínimo Retorno Diário: -5,02% em 15/01/2021

Volatilidade desde o início: 17,54%

### Performance comparativa - Valores em ( % )

FUNDO E BENCHMARK'S	MÊS	ANO	3M	6M	12M	24M	VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,79	-3,26	-3,26	4,68	10,71	-	-
ÍNDICE DE REFERÊNCIA (GLOBAL BDRX)	-3,98	-19,32	-19,32	-9,41	-5,15	56,83	45,26
IPCA + 5,04% A.A. (META ATUARIAL)	2,06	4,46	4,46	8,88	16,91	30,24	3,64

O fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	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?	Não

BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I

39.255.695/0001-98

## Comentário sobre os fundamentos do fundo

### Regulamento:

Para alcançar seus objetivos, o FUNDO aplicará seus recursos em fundos de investimento (FIs) que tenham como objetivo compor uma carteira de ativos financeiros direcionada, preferencialmente, por ativos de renda variável de âmbito global. Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do **BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BDR NÍVEL I, CNPJ: 39.272.928/0001-60**.

### Características:

Os FIs nos quais o FUNDO investe poderão atuar no mercado de derivativos para proteger parte de seu patrimônio, eliminar os impactos cambiais do BDR ou para reproduzir uma posição em ações com a parcela de sua carteira que estiver direcionada para ativos financeiros de renda fixa, sendo vedada a exposição, a esses mercados, superior ao patrimônio líquido do FUNDO.

### Composição da Carteira 31/12/2021:

O administrador do Fundo se utiliza da prerrogativa contida na ICVM nº 555, artigo 56º, parágrafo 3º, inciso II, que permite a ocultação da carteira por até 90 dias. Devido à criação recente do fundo, ainda não é possível obter informações relevantes sobre as alocações do fundo.

A carteira do fundo em questão é composta majoritariamente por cotas de **BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BDR NÍVEL I, CNPJ: 39.272.928/0001-60**:

Brazilian Depositary Receipts **(64,16% do PL)**

Investimento no Exterior **(24,49% do PL)**

Operação compromissada **(5,42% do PL)**

Valores a pagar/receber **(2,87% do PL)**

Derivativos **(1,74% do PL)**

Outros **(1,0% do PL)**

### Classificação:

Ações Exterior

### Rentabilidade:

A rentabilidade do fundo encontra-se acima do seu indicador de desempenho (MSCI ACWI) no acumulado do ano.

### Taxas:

A taxa de administração do FUNDO é de 1,00% ao ano, incidente sobre o valor do patrimônio líquido, calculada e cobrada por dia útil, à razão de 1/252. Será devida taxa de performance de 10%, com base no resultado do FUNDO, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do índice MSCI ACWI, calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.

### Risco:

Os principais riscos em que o FUNDO incorre são de Mercado.

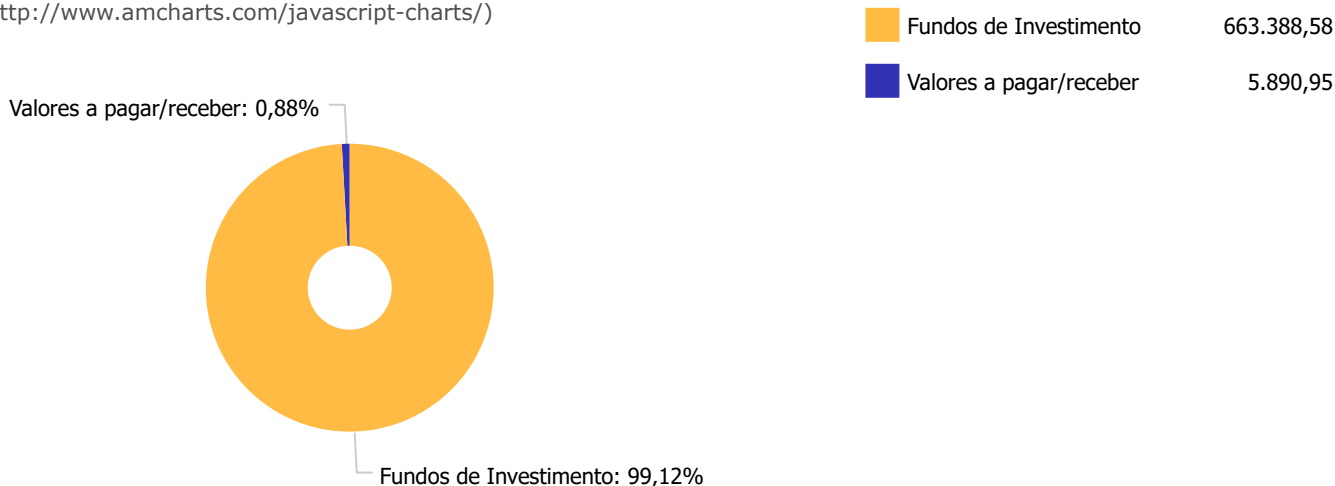
**Enquadramento:** O regulamento do fundo está enquadrado quanto ao disposto no **Artigo 9º, Inciso III da Resolução CMN nº 4.963/2021**, não havendo, portanto, impedimento em receber investimentos por parte do RPPS (**regulamento v. 23/nov/2020**).

BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I

39.255.695/0001-98

Carteira (Master)

(<http://www.amcharts.com/javascript-charts/>)



Principais ativos em carteira (Master)	Valor	Participação (%)
Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BDR NÍVEL I	649.107,59	97,51
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.280,99	2,15
Outros Valores a receber	3.482,71	0,52
Outras Disponibilidades	2.406,34	0,36
Valores a pagar / Auditoria	1,88	0,00
Outros Valores a receber	0,01	0,00
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,01	0,00
Valores a pagar / IR a recolher	-5,26	0,00
Valores a pagar / PROV.CVM 29/04/22	-5,61	0,00
Valores a pagar / Controladoria	-5,81	0,00

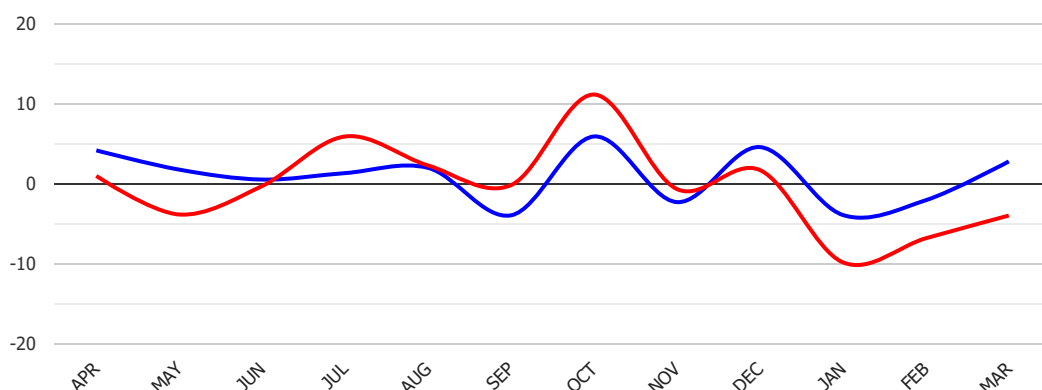
**Total da Carteira: 623.647.576,22**

Sub-segmento	Valor	%	Característica
AÇÕES - EXTERIOR	20.191.376,31	3,24	EXTERIOR - R\$ 20.191.376,31 - 3,2365%

BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I

39.255.695/0001-98

### Rentabilidade



	Retorno Efetivo					Retorno Efetivo				Taxa Administração
	Mês	Ano	6 Meses	1 Ano	2 Anos	Retorno Acumulado	Volatilidade	Sharpe		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,79	-3,26	4,68	10,71		20,83			1,00	
Global BDRX	-3,98	-19,32	-9,41	-5,15	56,83		45,26			

2021/2022	APR	MAY	JUN	JUL	AUG	SEP	OCT	NOV	DEC	JAN	FEB	MAR	ANO	ACU
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,17	1,76	0,52	1,33	1,98	-3,95	5,91	-2,30	4,58	-3,91	-2,06	2,79	-3,26	10,71
Global BDRX	0,98	-3,85	-0,28	5,91	2,28	-0,17	11,15	-0,67	1,71	-9,83	-6,82	-3,98	-19,32	-5,15

### Enquadramento do fundo pela resolução 4.963 - Estratégia de alocação - Limite 2022

Artigo	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Inferior %	Alvo %	Superior %	GAP Superior \$
Artigo 9º, Inciso III	10,00	14.302.577,40	2,29	1,88	2,50	10,00	48.062.180,22

Dado o PL do FUNDO MASTER (base fevereiro /2021) e o possível investimento do RPPS, há suporte de até R\$ 99.855.286,30 para novos investimentos no FUNDO.

BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I

39.255.695/0001-98

### Avaliação do fundo dentro do contexto da carteira do RPPS de RIO BRANCO

A política de investimentos do RPPS elaborada para o exercício de 2022 permite alocação máxima no limite superior de até 10% em fundos enquadrados no Artigo 9º, Inciso III da Resolução CMN 4.963/2021. Atualmente, a carteira apresenta 2,29% (base março/2022), havendo margem para novos investimentos até o limite superior de R\$ 48.062.180,22.

Dado o PL do FUNDO (base março/2022) e o possível investimento do RPPS, há suporte de até R\$ 117.476.807,41 para novos investimentos no FUNDO.

Atualmente, o RPPS não tem investimentos neste fundo, onde possui aproximadamente 3,24% da carteira em fundos com estratégias semelhantes (Ações Exterior).

Fundos como esse podem ser uma boa opção no caso de uma carteira já diversificada em empresas brasileiras, podendo ingressar em um novo mercado e buscar rentabilidade em uma economia alternativa. Aplicações neste segmento devem complementar o portfólio do RPPS, diminuindo a correlação de fundos

Em razão do RPPS possuir diversificação da carteira, mantendo uma considerável exposição composta por empresas brasileiras, recomendamos o aporte em fundos desse segmento.

Caso o RPPS opte pelo investimento, recomendamos que os recursos sejam resgatados do segmento de longo prazo.

A administradora/gestora cumpre os requisitos exigidos na lista exaustiva das instituições que atendem as novas condições estabelecidas na Resolução CMN nº 4963 de novembro de 2021, disposto no Artigo 21, § 2º, Inciso I, portanto, o fundo está apto para receber aportes do RPPS.

Na opção de realizar o investimento, o administrador e gestor do fundo deverão estar credenciados, em obediência aos requisitos da Resolução CMN nº 4.963/21, Artigo 1º, § 1º, Inciso VI, e § 3º, Portaria MPS 519/2011 e alterações, considerados aptos pelo órgão colegiado competente do RPPS.

Santos, 27 de abril de 2022



Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.

## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Na opção de realizar o investimento, o administrador e gestor do fundo deverão estar credenciados, em obediência aos requisitos da Resolução CMN nº 4.963/21, Artigo 1º, § 1º, Inciso VI, e § 3º, Portaria MPS 519/2011 e alterações, considerados aptos pelo órgão colegiado competente do RPPS.

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.