

BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I

21.470.644/0001-13

Resumo

Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM

Auditoria: PriceWaterhouseCoopers

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM

Início: 22/01/2015

Custodiante: Banco do Brasil

Resolução: Artigo 9º, Inciso III

Taxas

Taxa de Administração: 0,50%

Índice de Performance: Não possui

Taxa de Performance: Não possui

Taxa de Resgate: Não possui

Carência: Não há

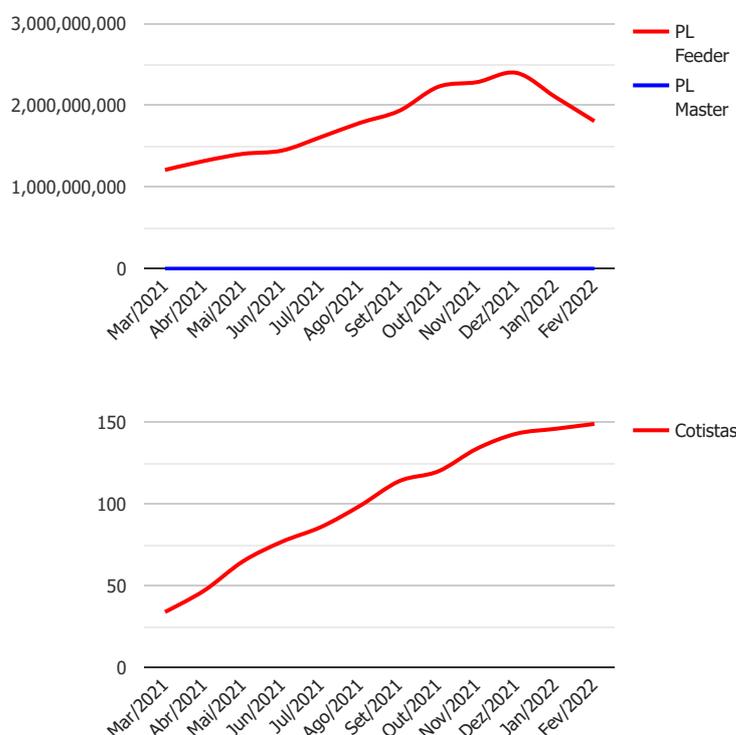
Benchmark: GLOBAL BDRX

Público Alvo: Investidores institucionais

Investidor Qualificado: Não

Evolução PL e Cotistas

MÊS	COTISTA	Fundo Feeder		Fundo Master	
		PL FEEDER	PL MASTER	PL FEEDER	PL MASTER
Mar/2021	34	1.208.962.567,14			
Abr/2021	47	1.318.518.662,10			
Mai/2021	65	1.405.843.228,00			
Jun/2021	77	1.446.364.329,95			
Jul/2021	86	1.612.274.177,80			
Ago/2021	99	1.785.522.167,06			
Set/2021	114	1.931.910.756,74			
Out/2021	120	2.226.162.911,63			
Nov/2021	134	2.283.804.012,24			
Dez/2021	143	2.396.743.051,17			
Jan/2022	146	2.101.438.004,03			
Fev/2022	149	1.805.884.267,88			



BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I

21.470.644/0001-13

Informações Operacionais

Depósito Inicial: 200,00

Movimentação Mínima: 0,00

Disponibilidade dos Recursos Aplicados: D+0

Conversão de Cota para Aplicação: D+1 du

Conversão de Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilidade dos Recursos Resgatados: D+4 du

Histórico

Máximo Retorno Diário: 6,99% em 09/04/2015

Número de dias com Retorno Positivo: 944

Mínimo Retorno Diário: -7,03% em 12/03/2020

Retorno acumulado desde o início: 378,04%

Número de dias com retorno negativo: 836

Volatilidade desde o início: 19,39%

Performance comparativa - Valores em (%)

FUNDO E BENCHMARK'S	MÊS	ANO	3M	6M	12M	24M	VaR
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,75	-15,69	-13,16	-4,48	2,91	70,50	45,11
ÍNDICE DE REFERÊNCIA (GLOBAL BDRX)	-6,82	-15,98	-14,54	-5,81	1,83	72,27	44,48
IPCA + 5,47% A.A. (META ATUARIAL)	1,42	2,42	3,67	8,58	16,61	29,30	3,44

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

Não

BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I

21.470.644/0001-13

Comentário sobre os fundamentos do fundo

Regulamento

O FUNDO tem como objetivo oferecer aos cotistas, a médio e longo prazo, performance consistente e competitiva em relação ao mercado acionário global, dentro das oscilações e riscos inerentes a este mercado.

Aplica seus recursos, preponderantemente, no mercado acionário norte-americano através de BDRs níveis I, II e III de empresas globais e/ou listadas nas bolsas internacionais negociadas no mercado local, com consequente exposição à variação cambial.

Composição da Carteira 31/01/2022

O administrador do fundo investido utiliza-se da prerrogativa contida na ICVM nº 555, art. 56º, parágrafo 3º, inciso II, que permite a ocultação da carteira por até 90 dias.

Brazilian Depositary Receipts (98,47% do PL)

Operação compromissada (2,05% do PL)

Fundos de Investimento (0,35% do PL)

Derivativos (0,02% do PL)

Valores a pagar/receber (-0,90% do PL)

Rentabilidade: Apresenta-se em linha com seu índice de referência (GLOBAL BDRX) na maioria dos períodos analisados.

Taxas: A taxa de administração (0,5%) está em linha com as taxas praticadas pelo mercado para fundos com estratégia semelhantes. A taxa máxima de custódia a ser cobrada do FUNDO será de 0,01% ao ano sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO. Não há cobrança de taxas de performance, de ingresso ou de saída.

Risco: Os principais riscos que o fundo incorre estão relacionados à "mercado".

Enquadramento: O regulamento do fundo está enquadrado quanto ao disposto na Resolução CMN nº 3.922/2010 e suas alterações, **Artigo 9º - A, Inciso III**, não impedindo aporte de recursos pelos RPPSs (**regulamento v. 08/dez/2020**). O regulamento do fundo analisado também está devidamente enquadrado quanto ao disposto no **Artigo 9º, Inciso III**, da resolução CMN nº 4.963/21

BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I

21.470.644/0001-13

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 e alterações. Atualmente, a carteira apresenta 0,74% (base Fevereiro/2022), havendo margem para novos investimentos limite superior de R\$ 55.809.043,55

Dado o PL do FUNDO (base Fevereiro/2022), e o possível investimento do RPPS, há suporte de até R\$318.685.459,04 para novos investimentos no FUNDO.

Atualmente, o RPPS não tem investimentos neste fundo, onde possui aproximadamente 0,74% da carteira em fundos com estratégias semelhantes (Ações Exterior).

Fundos ESG (*Environmental, Social and Governance*) têm a finalidade de fazer investimentos em empresas envolvidas com o meio ambiente, com a sociedade e com parâmetros elevados de governança. A exposição em fundos com esta estratégia é benéfica por possuir em seu portfólio empresas comprometidas as boas práticas sustentáveis e sociais.

Diante da análise dos fundamentos do fundo e do contexto do mesmo na carteira do RPPS, sugerimos o aporte no fundo, bem como o aumento da exposição em fundos desse segmento. Em razão do RPPS possuir diversificação da carteira em fundos atrelados a economia doméstica. Ressaltamos a importância do investimento no exterior para diversificação e mitigação dos riscos contidos no portfólio de investimentos.

Caso o RPPS opte pelo investimento, recomendamos que os recursos sejam resgatados do segmento de médio 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, 18 de março 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.