

CADASTRO DE FUNDO/CLASSE DE INVESTIMENTO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 42.592.315/0001-15 - BB FIC Curto Prazo Automático

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Fundo/Classe de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7, I, b

Data do Termo: 30/09/2024

Conclusão do Cadastro: Fundo enquadrado em relação à Resolução 4963/2021.

INSTITUIÇÕES

Administrador: 30.822.936/0001-69 - BB Gestão DTVM

Gestor: 30.822.936/0001-69 - BB Gestão DTVM

Art. 21º da Resolução 4963/2021: Ambas as instituições atendem ao inciso I do parágrafo 2º.

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Data de Início: 21/09/2021

Carência: Não há

Categoria de Investidor: Geral

O Fundo/Classe possui Subclasse: Não

Taxa de Administração: 1,75%

Taxa de Performance: Não há

Índice de Referência: CDI

Prazo de Resgate: D+0

Investe em cotas de outros fundos: Sim

46.133.770/0001-03 – Renda Fixa – 7, III, a – 100,00%

Obs.: Informações referentes à 30/09/2024.

CONCLUSÃO DA ANÁLISE

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

O fundo tem por objetivo proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação dos recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro, utilizando-se de cotas de fundos de investimento Renda Fixa Curto Prazo, cujas carteiras sejam compostas exclusivamente por títulos públicos federais e/ou operações compromissadas lastreadas em TPF.

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

O fundo possui liquidez em D+0.

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. O Fundo deverá manter, no mínimo, 90% (noventa por cento) de seu patrimônio líquido investido nestes ativos.

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 6 outros fundos, de mesmo benchmark (CDI) e enquadramento (7, I, b) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 1,75%, ficou acima da média de 0,17% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 8,39%, performou abaixo da média de 11,46%. Base de comparação:

29.241.799/0001-90 - Itaú FIC Legend Institucional - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 12,74
03.233.070/0001-88 - Porto Seguro Soberano Renda Fixa - Tx Adm: 0,15 - Rent 12M: 11,27
24.634.187/0001-43 - Sicredi Liquidez Empresarial Referenciado Renda Fixa - Tx Adm: 0,15 - Rent 12M: 11,20
08.212.681/0001-63 - Sicredi Liquidez - Tx Adm: 0,02 - Rent 12M: 11,19
37.927.707/0001-58 - BTG Pactual Institucional Tesouro Selic Simples - Tx Adm: 0,08 - Rent 12M: 11,18
21.743.480/0001-50 - Banrisul Absoluto - Tx Adm: 0,15 - Rent 12M: 11,18

Obs.: Rentabilidades com data de fechamento 30/08/2024.

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 objetivo do Fundo é aplicar seus recursos em cotas de FIs que apresentem carteira composta, exclusivamente, por títulos públicos federais indexados ao CDI/SELIC ou em títulos públicos federais prefixados indexados e/ou sintetizados para CDI/SELIC e em operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais, com prazo máximo a decorrer de 375 (trezentos e setenta e cinco) dias e carteira com prazo médio inferior a 60 (sessenta) dias. Possui taxa de administração que pode variar de 1,75% a 4% do patrimônio líquido ao ano.

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

O fundo não possui carência para resgate. A liquidez ocorre em D+0.

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, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 02.296.928/0001-90, 05.943.661/0001-74, 04.061.762/0001-59, 07.111.384/0001-69, 03.543.447/0001-03. Em matéria de performance, 1 ficou 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

O gestor é responsável pela aplicação dos fundos Master, de acordo com as normas estabelecidas no Regulamento do Fundo. Na data de análise o fundo está aplicando em fundos enquadrados pela CMN.

PATRIMÔNIO LÍQUIDO E COTISTAS



PERÍODO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	NÚMERO DE COTISTAS
Atual	147.917.573.712,69	73133
Médio em 12 meses	149.177.798.414,41	41053
Médio em 24 meses	136.575.647.402,26	42120

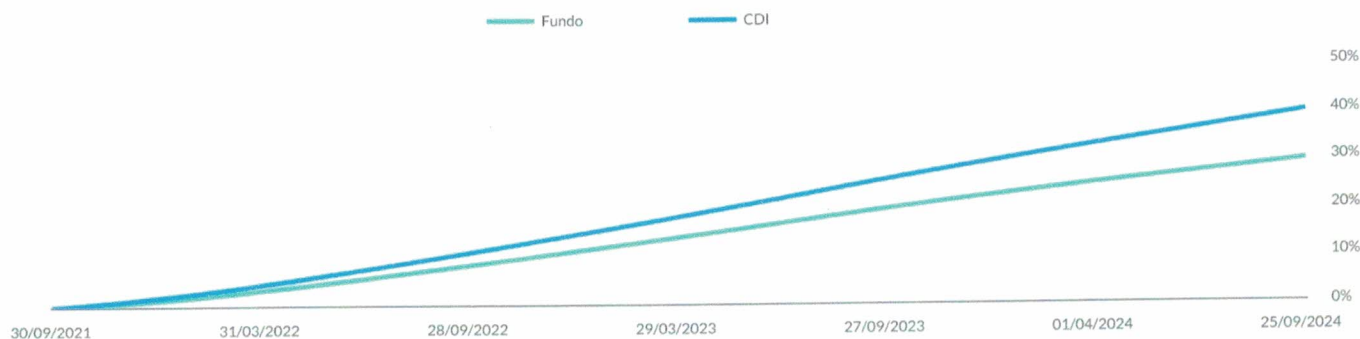
RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,56	0,60	0,74	0,63	0,80	0,79	0,81	0,92	0,85	0,81	0,81	0,89	9,61
CDI	0,73	0,75	0,92	0,83	1,03	1,01	1,03	1,17	1,07	1,02	1,02	1,12	12,37
% CDI	76,61	79,78	80,60	74,94	77,33	77,86	78,29	79,14	79,35	79,42	79,57	79,51	77,71

2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,89	0,73	0,93	0,73	0,90	0,85	0,85	0,90	0,77	0,78	0,71	0,69	10,17
CDI	1,12	0,92	1,17	0,92	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	13,05
% CDI	79,33	79,39	79,55	79,65	79,86	79,58	79,11	79,02	78,58	78,14	77,45	76,54	77,96

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,74	0,61	0,63	0,66	0,62	0,58	0,67	0,64					5,88
CDI	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	0,91	0,87					7,10
% CDI	76,41	75,71	75,05	74,45	73,97	74,06	73,74	73,99					82,81

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Cotas de Fundos	147.915.284.748,39	100,00
Valores a receber	10.344.801,04	0,01
Disponibilidades	3.854.312,11	0,00
Valores a pagar	-10.674.715,19	-0,01

Obs.: Informações referentes à 30/09/2024.



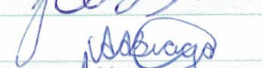

RESPONSÁVEIS PELO CADASTRO

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
Jose Carlos Dias	809.826.546-34	
Dulce da Cruz F. Machado	249.437.448-00	
Jenifer Damyze Dias	050801456-50	
Amanda Aparecida Braga	088.135.846-01	
Magda de Lourdes Faria	712.466.306-72	