BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP CORPORATIVO 400 MIL

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

INFORMATIVO MENSAL

Outubro 2019

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Objetivos: O fundo tem por objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos que compõem sua carteira, de forma a acompanhar as variações diárias do CDI, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento.

Política de Investimento: Aplicará em cotas de fundos de investimentos que mantenham uma carteira composta por, no mínimo, 80% do patrimônio líquido, isolada ou cumulativamente, em títulos de emissão do Tesouro Nacional, do Banco Central do Brasil ou em títulos e valores mobiliários de renda fixa cujo emissor esteja classificado na categoria baixo risco de crédito ou equivalente, bem como manter, no mínimo, 95% da carteira em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais que acompanhem, direta ou indiretamente, a variação da taxa de juros dos CDI.

Público Alvo: O fundo é destinado aos clientes do segmento de pessoas jurídicas do Banco do Brasil que busquem acompanhar a tendência da variação do Certificado de Depósito Interbancário - CDI.

Data de início:	29/09/2000	
Classe / Sub Classe CVM:	Renda Fixa	Referenciado
Código/Tipo ANBIMA:	81892	Renda Fixa Duração Baixa Grau de Invest.
Tributação:	Longo Prazo	
PL Médio (12 meses)	R$ 4.329.675.897,19	
PL Fechamento:	R$ 4.136.215.586,18	

CONDIÇÕES COMERCIAIS

Aplicação Inicial*	R$ 100.000,00	**Taxa de Administração**	0,50% a.a.
Aplicação Adicional	R$ 0,01	**Taxa de Performance**	Não há
Resgate Mínimo	R$ 0,01	**Taxa de Ingresso**	Não há
Saldo Mínimo	R$ 1.000,00	**Taxa de Saída**	Não há
Cota de Aplicação	D+0	**Carência**	Não há
Cota de Resgate	D+0	**Tipo de Cota**	Fechamento
Crédito do Resgate	D+0	**Horário Limite**	17:00 h

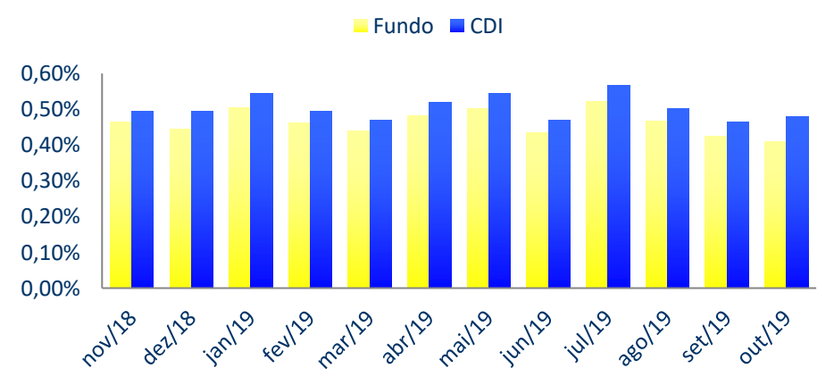
* Conforme o disposto no item XII - Outras Informações do formulário de informações complementares do fundo.

RENTABILIDADE

A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS

Ano	Taxa Nominal	CDI	Acumulada 5 anos	
2014	10,62%	10,81%	**Fundo**	**CDI**
2015	13,09%	13,24%	65,29%	67,35%
2016	13,62%	14,00%	**2019**	
2017	9,74%	9,93%	**Fundo**	**CDI**
2018	5,98%	6,42%	**4,75%**	**5,16%**

Mês	Fundo	CDI	%CDI
out/19	**0,41%**	**0,48%**	**85,69%**
set/19	0,43%	0,46%	91,77%
ago/19	0,47%	0,50%	93,00%
jul/19	0,52%	0,57%	91,85%
jun/19	0,43%	0,47%	92,72%
mai/19	0,50%	0,54%	92,63%
abr/19	0,48%	0,52%	93,03%
mar/19	0,44%	0,47%	93,49%
fev/19	0,46%	0,49%	93,34%
jan/19	0,50%	0,54%	92,77%
dez/18	0,44%	0,49%	90,00%
nov/18	0,46%	0,49%	94,11%
últimos 12 meses	**5,70%**	**6,20%**	



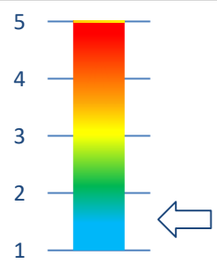
O INDICADOR CDI É MERA REFERÊNCIA ECONÔMICA E NÃO PARÂMETRO DO FUNDO.

(1) V@R (VALUE AT RISK) SINTETIZA A MAIOR PERDA ESPERADA DENTRO DE UM PERÍODO DE TEMPO E INTERVALO DE CONFIANÇA. A METODOLOGIA UTILIZADA É A DE SIMULAÇÃO HISTÓRICA PARA INTERVALO DE 1 DIA E NÍVEL DE CONFIANÇA DE 95%.
(2) GRAU MÉDIO DE VARIAÇÃO DA COTA DO FUNDO.
(3) ÍNDICE QUE TEM POR OBJETIVO AJUSTAR O RETORNO DO FUNDO PELO SEU RISCO, OU SEJA, QUANTO MAIOR O RETORNO E MENOR O RISCO DO INVESTIMENTO, MELHOR SERÁ SEU ÍNDICE DE SHARPE. ÍNDICES COM VALORES MENORES QUE ZERO NÃO TÊM SIGNIFICADO INTERPRETATIVO, POR ISSO NÃO SÃO DIVULGADOS.

AS DESCRIÇÕES DOS FATORES DE RISCO DO FUNDO ESTÃO DISPONÍVEIS NO REGULAMENTO E PODE SER CONSULTADO EM WWW.BB.COM.BR.
FONTES: BACEN, ANBIMA, CETIP, DRIVEAM, QUANTUMAXIS e BLOOMBERG.

INFORMAÇÕES DE RISCO

V@R (95% de confiança)(1)	0,0024%
Volatilidade no ano(2)	0,03%
Volatilidade nos últimos 12 m(2)	0,03%
% de retornos positivos no ano	100,00%
% de retornos positivos nos últimos 12 m	100,00%
Índice de Sharpe nos últimos 12 m(3)	-

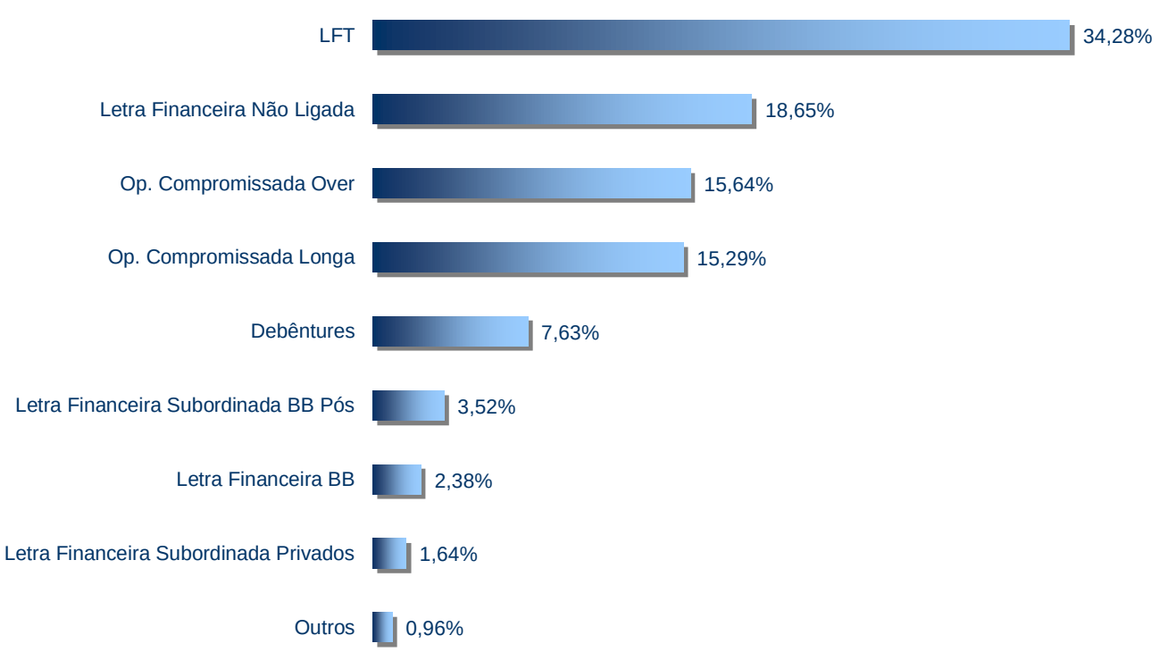


COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

POSIÇÃO EM 31.10.2019

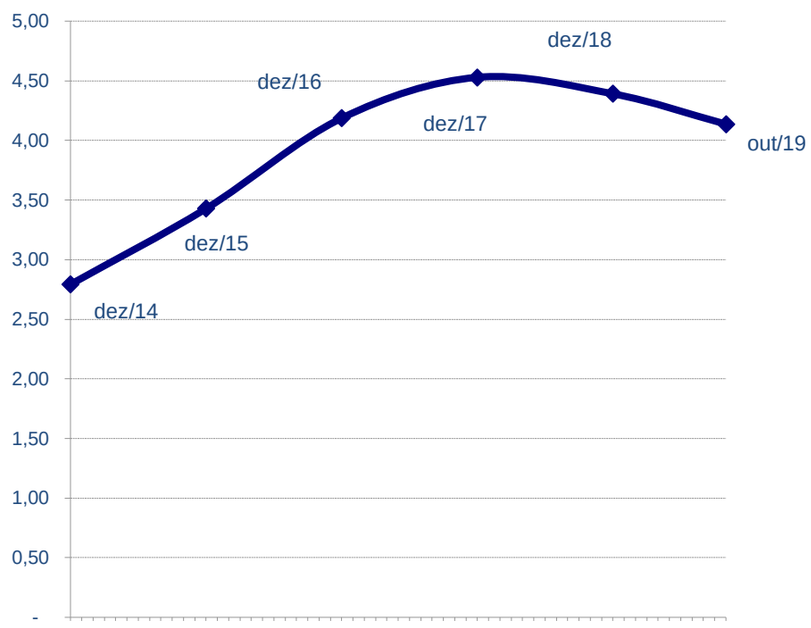
59% BB TOP DI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP FI

41% BB TOP RF MODERADO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO



EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

ÚLTIMOS 5 ANOS R$ BILHÕES



A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RESULTADOS FUTUROS. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. O INVESTIMENTO EM FUNDO NÃO É GARANTIDO PELO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO. LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS, SE HOUVER, E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR.

Administração e Gestão:	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.
Distribuição:	Banco do Brasil S.A.
Custódia, Controladoria e Contabilidade:	Banco do Brasil S.A.
Gestor Responsável:	Manoel Aparecido Rodrigues
Auditoria Externa:	KPMG Auditores Independentes

BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.
Praça XV de Novembro, 20 - 3º andar - Centro - Rio de Janeiro (RJ) 20010-010
Tel: (21) 3808-7500 Fax (21) 3808-7600
e-mail: bbdtvm@bb.com.br
Central de Atendimento BB
Capitais e Regiões Metropolitanas: 4004 0001
Demais localidades: 0800 729 0001
Deficientes auditivos ou de fala: 0800 729 0088

Av. Paulista, 1230 - 10º andar - Bela Vista - São Paulo (SP) 01310-901
Tel: (11) 4298-7550
e-mail: bbdtvmsp@bb.com.br
Internet: www.bb.com.br
Central de Atendimento ao Cotista: 0800 729 3886
Ouvidoria: 0800 729 5678
SAC: 0800 729 0722

Signatory of: PRI Principles for Responsible Investment