



Relatório Anual

BB ETF RENDA FIXA PRÉ ÍNDICE FUTURO DE TAXAS DE JUROS S&P/B3 FUNDO DE ÍNDICE (CNPJ nº 26.845.780/0001-64)

Em conformidade com o Artigo 39 da Instrução desta CVM n. 359, de 22 de janeiro de 2002, apresentamos o relatório anual do **BB ETF Renda Fixa PRÉ Índice Futuro de Taxas de Juros S&P/B3 Fundo de Índice**.

I – Análise da Carteira do fundo em face da estratégia adotada e dos objetivos da política de investimento

O fundo BB ETF Renda Fixa PRÉ Índice Futuro de Taxas de Juros S&P/B3 Fundo de Índice é uma comunhão de recursos destinada à aplicação em carteira de ativos financeiros, com o objetivo de refletir as variações e rentabilidade, por replicação integral da composição da carteira do índice deduzidas taxas e despesas, do S&P/B3 Índice de Futuros de Taxa De Juros – DI 3 Anos ER (“**SPBDI1FP**” ou “**ÍNDICE**”), calculado pela S&P Dow Jones Índices (“**S&PDJI**”).

Conforme capítulo IV, do regulamento do fundo, o **BB ETF Renda Fixa PRÉ Índice Futuro de Taxas de Juros S&P/B3 Fundo de Índice**, registrado sob o código ISIN BRFIXACTF002, é um indicador de retorno de um investimento em uma carteira teórica calculada pela S&P Dow Jones Índices (“**S&PDJI**”), composta por Contrato Futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (“**DI1**”).

II – Apresentação de desempenho, compreendendo as informações constantes no inciso XXV do art 39 da ICVM 359

O fundo busca refletir o desempenho do Índice de referência (SPBDI1FP) e tem seguido aderente ao seu “índice de referência”. A atividade de formador de mercado do BB ETF Renda Fixa PRÉ Índice Futuro de Taxas de Juros S&P/B3 Fundo de Índice é exercida pela BTG PACTUAL.

- a) **Tabela comparativa da evolução diária do valor patrimonial da cota, dos valores de fechamento de negociação no mercado secundário, do patrimônio líquido do fundo, bem como do valor em pontos do índice subjacente até a data da última cota disponível e o valor teórico de sua carteira.**



Data	Patrimônio Líquido	Valor Cota	Cotação Fechamento do Fundo Mercado Secundário	Índice (Pontos)
28/03/2024	157.447.962,48	16,07	15,85	667,15
27/03/2024	157.421.243,95	16,06	16,06	667,02
26/03/2024	157.434.059,13	16,06	16,08	667,07
25/03/2024	157.669.051,53	16,09	16,11	668,05
22/03/2024	157.377.489,89	16,06	16,04	666,81
21/03/2024	157.406.849,91	16,06	16,08	666,92
20/03/2024	157.504.132,71	16,07	16,06	667,33
19/03/2024	157.228.794,89	16,04	16,03	666,15
18/03/2024	156.873.938,80	16,01	16,01	664,63
15/03/2024	157.022.921,57	16,02	16,01	665,25
14/03/2024	157.351.903,45	16,06	16,04	666,63
13/03/2024	157.852.251,47	16,11	16,09	668,74
12/03/2024	157.700.027,38	16,09	16,09	668,08
11/03/2024	157.555.765,98	16,08	16,05	667,46
08/03/2024	157.306.610,12	16,05	16,10	666,39
07/03/2024	157.559.665,78	16,08	16,10	667,45
06/03/2024	157.616.137,62	16,08	16,07	667,68
05/03/2024	157.614.398,19	16,08	16,06	667,65
04/03/2024	157.271.396,71	16,05	16,06	666,19
01/03/2024	157.226.632,89	16,04	16,06	665,99
29/02/2024	156.995.108,20	16,02	16,00	665,00
28/02/2024	156.657.633,61	15,99	16,00	663,57
27/02/2024	156.764.788,96	16,00	15,93	664,02
26/02/2024	156.295.960,32	15,95	15,93	662,04
23/02/2024	156.578.187,72	15,98	15,96	663,22
22/02/2024	156.594.068,51	15,98	16,00	663,28
21/02/2024	156.829.303,52	16,00	16,00	664,27
20/02/2024	156.649.768,95	15,98	16,00	663,51
19/02/2024	156.355.903,20	15,95	16,15	662,25
16/02/2024	156.212.803,60	15,94	15,93	661,64
15/02/2024	156.421.082,91	15,96	15,93	662,51
14/02/2024	156.285.778,32	15,95	15,93	661,93
09/02/2024	156.560.206,48	15,98	15,99	663,09
08/02/2024	156.440.136,32	15,96	15,96	662,58
07/02/2024	156.753.349,82	16,00	15,97	663,90



06/02/2024	156.783.735,79	16,00	15,99	664,02
05/02/2024	156.393.096,85	15,96	15,95	662,36
02/02/2024	156.484.665,99	15,97	15,97	662,74
01/02/2024	156.899.830,60	16,01	15,99	664,49
31/01/2024	156.702.098,00	15,99	16,01	663,65
30/01/2024	156.293.699,78	15,95	15,93	661,91
29/01/2024	156.364.306,97	15,96	15,99	662,19
26/01/2024	156.531.909,04	15,97	16,13	662,88
25/01/2024	156.283.003,33	15,95	15,94	661,80
24/01/2024	155.824.250,04	15,90	15,92	659,83
23/01/2024	155.685.966,00	15,89	15,88	659,23
22/01/2024	155.471.941,44	15,86	15,89	658,31
19/01/2024	155.781.931,03	15,90	15,90	659,62
18/01/2024	155.608.833,42	15,88	15,88	658,87
17/01/2024	155.401.884,47	15,86	15,67	657,99
16/01/2024	155.406.991,23	15,86	15,88	658,01
15/01/2024	156.129.505,35	15,93	15,98	661,06
12/01/2024	156.036.287,37	15,92	15,93	660,66
11/01/2024	155.543.835,67	15,87	15,89	658,56
10/01/2024	155.357.518,67	15,85	15,88	657,76
09/01/2024	155.342.857,17	15,85	15,87	657,70
08/01/2024	155.513.163,88	15,87	15,89	658,41
05/01/2024	155.672.278,97	15,88	15,88	659,08
04/01/2024	155.586.345,51	15,88	15,90	658,71
03/01/2024	155.687.169,34	15,89	15,86	659,13
02/01/2024	155.723.528,80	15,89	15,91	659,10
29/12/2023	155.873.335,93	15,91	15,88	659,44
28/12/2023	155.807.338,56	15,90	15,88	659,44
27/12/2023	155.950.491,93	15,91	15,91	660,41
26/12/2023	155.749.939,22	15,89	15,90	659,35
22/12/2023	155.503.193,93	15,87	15,86	658,30
21/12/2023	155.448.791,87	15,86	15,86	658,06
20/12/2023	155.448.346,01	15,86	15,68	658,05
19/12/2023	155.319.150,05	15,85	15,92	657,49
18/12/2023	155.070.984,90	15,82	15,80	656,43
15/12/2023	155.047.322,14	15,82	15,84	656,32
14/12/2023	154.755.560,43	15,79	15,83	655,08
13/12/2023	154.653.614,51	15,78	15,75	654,64
12/12/2023	154.018.900,63	15,72	15,74	651,95



11/12/2023	153.691.797,02	15,68	15,70	650,55
08/12/2023	153.514.143,26	15,66	15,65	649,79
07/12/2023	153.679.206,62	15,68	15,71	650,48
06/12/2023	153.515.782,33	15,66	15,70	649,78
05/12/2023	153.184.518,27	15,63	15,62	648,37
04/12/2023	153.192.992,99	15,63	15,66	648,40
01/12/2023	153.586.067,91	15,67	15,67	650,05
30/11/2023	153.372.845,57	15,65	15,65	649,13
29/11/2023	153.109.592,84	15,62	15,64	648,00
28/11/2023	152.799.933,02	15,59	15,59	646,68
27/11/2023	152.716.454,59	15,58	15,60	646,31
24/11/2023	152.284.292,44	15,54	15,53	644,47
23/11/2023	152.085.429,76	15,52	15,54	643,61
22/11/2023	152.021.288,08	15,51	15,51	643,31
21/11/2023	151.672.671,14	15,48	15,51	641,82
20/11/2023	152.054.954,13	15,52	15,54	643,42
17/11/2023	152.249.837,25	15,54	15,52	644,23
16/11/2023	151.842.817,00	15,49	15,51	642,48
14/11/2023	151.549.003,74	15,46	15,48	641,23
13/11/2023	150.684.600,47	15,38	15,40	637,56
10/11/2023	150.655.997,80	15,37	15,36	637,42
09/11/2023	150.227.076,68	15,33	15,34	635,59
08/11/2023	148.704.460,86	15,33	15,35	635,62
07/11/2023	148.498.461,55	15,31	15,32	634,73
06/11/2023	147.952.547,00	15,25	15,27	632,39
03/11/2023	148.358.708,16	15,29	15,32	634,11
01/11/2023	147.409.524,35	15,20	15,16	630,04
31/10/2023	146.623.302,24	15,12	15,10	626,67
30/10/2023	146.665.602,32	15,12	15,10	626,84
27/10/2023	147.496.665,16	15,21	15,22	630,39
26/10/2023	148.233.699,08	15,28	15,26	633,53
25/10/2023	147.260.933,56	15,18	15,26	629,35
24/10/2023	147.134.086,66	15,17	15,17	628,79
23/10/2023	146.537.157,51	15,11	15,12	626,23
20/10/2023	146.542.148,41	15,11	15,13	626,24
19/10/2023	145.789.793,63	15,03	15,05	623,02
18/10/2023	146.470.355,81	15,10	15,10	625,92
17/10/2023	146.621.283,98	15,12	15,26	626,55
16/10/2023	147.282.171,30	15,18	15,12	629,37



13/10/2023	146.812.917,07	15,14	15,25	627,35
11/10/2023	147.290.299,90	15,18	15,24	629,38
10/10/2023	147.553.722,80	15,21	15,05	630,50
09/10/2023	147.082.159,29	15,16	15,03	628,47
06/10/2023	105.627.110,51	15,09	15,04	625,43
05/10/2023	105.519.174,26	15,07	15,08	624,79
04/10/2023	105.519.207,15	15,07	14,79	624,79
03/10/2023	105.037.389,44	15,01	15,16	621,94
02/10/2023	105.587.033,10	15,08	15,22	625,08
29/09/2023	106.134.553,00	15,16	15,04	628,42
28/09/2023	105.594.501,95	15,08	15,05	625,23
27/09/2023	105.422.835,36	15,06	15,29	624,21
26/09/2023	106.103.821,90	15,16	15,30	628,24
25/09/2023	106.526.772,39	15,22	15,31	630,73
22/09/2023	106.768.476,31	15,25	15,23	632,16
21/09/2023	106.695.439,90	15,24	15,33	631,72
20/09/2023	106.955.026,80	15,28	15,25	633,25
19/09/2023	106.820.732,48	15,26	15,33	632,45
18/09/2023	107.034.544,02	15,29	15,33	633,70
15/09/2023	107.060.044,75	15,29	15,37	633,84
14/09/2023	107.199.563,93	15,31	15,30	634,66
13/09/2023	107.203.728,26	15,31	15,30	634,67
12/09/2023	107.023.377,13	15,29	15,28	633,59
11/09/2023	106.705.458,87	15,24	15,34	631,70

b) Tabela comparativa contendo o volume diário negociado das cotas do fundo e do índice de referência, bem como o percentual do primeiro em relação ao segundo, até a última data disponível.

Data	Volume de Ações Listadas no Índice Negociadas na BOVESPA (R\$)	Volume de Cotas do Fundo Negociadas na BOVESPA (R\$)	Rel. do Volume Fundo vs Índice (%)
28/03/2024	25.335.209.071	16.230	0,0001%
27/03/2024	16.657.161.254	14.640	0,0001%
26/03/2024	19.800.743.918	482	0,0000%
25/03/2024	14.113.043.772	78.761	0,0006%
22/03/2024	12.874.174.040	32	0,0000%



21/03/2024	28.250.202.285	10.246	0,0000%
20/03/2024	22.535.811.541	1.733	0,0000%
19/03/2024	27.931.873.178	5.223	0,0000%
18/03/2024	27.788.062.930	108.183	0,0004%
15/03/2024	28.044.194.045	10.871	0,0000%
14/03/2024	35.943.387.945	6.545	0,0000%
13/03/2024	24.919.575.671	11.199	0,0000%
12/03/2024	28.719.327.825	3.786	0,0000%
11/03/2024	13.486.938.323	232.629	0,0017%
08/03/2024	35.163.418.447	7.993	0,0000%
07/03/2024	18.775.146.185	70.020	0,0004%
06/03/2024	18.272.469.952	199.419	0,0011%
05/03/2024	15.714.532.429	222.200	0,0014%
04/03/2024	11.419.717.485	99.895	0,0009%
01/03/2024	22.581.646.716	850	0,0000%
29/02/2024	24.611.813.405	3.884	0,0000%
28/02/2024	15.414.420.508	1.278	0,0000%
27/02/2024	24.739.507.622	14.852	0,0001%
26/02/2024	13.946.909.972	82.437	0,0006%
23/02/2024	10.646.720.478	194.141	0,0018%
22/02/2024	18.369.984.472	16.416	0,0001%
21/02/2024	11.828.414.583	48	0,0000%
20/02/2024	14.941.550.165	39.430	0,0003%
19/02/2024	6.749.383.754	184.557	0,0027%
16/02/2024	28.840.787.895	24.675	0,0001%
15/02/2024	15.001.539.772	37.905	0,0003%
14/02/2024	8.583.432.130	22.284	0,0003%
09/02/2024	12.159.346.844	23.602	0,0002%
08/02/2024	23.009.733.591	34.351	0,0001%
07/02/2024	14.143.018.582	32.592	0,0002%
06/02/2024	15.976.852.064	19.356	0,0001%
05/02/2024	13.944.991.123	305.267	0,0022%
02/02/2024	33.593.654.459	19.947	0,0001%
01/02/2024	22.269.135.146	173.635	0,0008%
31/01/2024	21.570.112.073	23.541	0,0001%
30/01/2024	16.339.774.083	16.520	0,0001%
29/01/2024	13.404.279.988	305.840	0,0023%
26/01/2024	20.387.927.690	2.096	0,0000%
25/01/2024	20.763.967.145	64.006	0,0003%



24/01/2024	18.179.936.945	73.425	0,0004%
23/01/2024	19.792.044.588	1.699	0,0000%
22/01/2024	15.431.185.714	554.657	0,0036%
19/01/2024	17.755.316.626	37.485	0,0002%
18/01/2024	16.839.452.551	32	0,0000%
17/01/2024	27.991.285.669	63.925	0,0002%
16/01/2024	23.184.555.200	152.655	0,0007%
15/01/2024	7.223.074.636	193.458	0,0027%
12/01/2024	15.568.732.202	223	0,0000%
11/01/2024	28.273.971.871	15.509	0,0001%
10/01/2024	15.685.350.368	206	0,0000%
09/01/2024	13.792.148.872	39.636	0,0003%
08/01/2024	13.274.114.682	19.123	0,0001%
05/01/2024	20.408.175.827	36.492	0,0002%
04/01/2024	16.637.435.763	180.290	0,0011%
03/01/2024	14.904.806.812	4.666	0,0000%
02/01/2024	14.566.551.333	11.528	0,0001%
29/12/2023	16.516.826.040	65.429	0,0004%
28/12/2023	16.516.826.040	0	0,0000%
27/12/2023	12.191.668.773	4.039	0,0000%
26/12/2023	4.993.281.850	40.494	0,0008%
22/12/2023	2.046.050.323	24.042	0,0012%
21/12/2023	4.563.658.793	88.626	0,0019%
20/12/2023	3.996.736.847	13.303	0,0003%
19/12/2023	5.078.037.989	34.640	0,0007%
18/12/2023	2.849.476.859	1.285.156	0,0451%
15/12/2023	8.794.788.047	3.340	0,0000%
14/12/2023	10.179.589.547	7.155	0,0001%
13/12/2023	6.652.078.870	64.288	0,0010%
12/12/2023	5.748.549.224	3.153	0,0001%
11/12/2023	2.782.900.086	49.831	0,0018%
08/12/2023	2.913.826.004	376	0,0000%
07/12/2023	3.213.379.378	55.758	0,0017%
06/12/2023	2.562.613.036	29.773	0,0012%
05/12/2023	4.175.115.872	111.898	0,0027%
04/12/2023	2.442.550.106	40.303	0,0017%
01/12/2023	6.485.033.638	69.669	0,0011%
30/11/2023	9.006.317.485	38.135	0,0004%
29/11/2023	8.575.188.253	15.151	0,0002%



28/11/2023	5.701.013.711	43.303	0,0008%
27/11/2023	6.843.041.252	47.189	0,0007%
24/11/2023	3.698.721.496	450	0,0000%
23/11/2023	3.225.092.279	33.725	0,0010%
22/11/2023	6.230.450.419	1.151	0,0000%
21/11/2023	3.631.339.137	78.596	0,0022%
20/11/2023	3.151.606.090	156.333	0,0050%
17/11/2023	3.680.515.790	357.286	0,0097%
16/11/2023	2.917.502.655	113.704	0,0039%
14/11/2023	5.700.766.091	15.308	0,0003%
13/11/2023	1.581.170.517	72.622	0,0046%
10/11/2023	3.040.197.655	62.054	0,0020%
09/11/2023	5.769.971.825	15.447	0,0003%
08/11/2023	6.780.986.709	774.992	0,0114%
07/11/2023	3.580.613.632	520	0,0000%
06/11/2023	3.079.799.646	366.345	0,0119%
03/11/2023	6.272.525.709	10.187	0,0002%
01/11/2023	11.216.367.670	76	0,0000%
31/10/2023	9.551.556.944	14.156	0,0001%
30/10/2023	9.841.833.827	17.120	0,0002%
27/10/2023	7.667.880.254	20.963	0,0003%
26/10/2023	5.713.358.688	35.995	0,0006%
25/10/2023	3.206.809.015	0	0,0000%
24/10/2023	7.130.868.891	201.798	0,0028%
23/10/2023	6.831.108.962	19.031	0,0003%
20/10/2023	7.520.424.074	606.085	0,0081%
19/10/2023	17.059.089.218	24.488	0,0001%

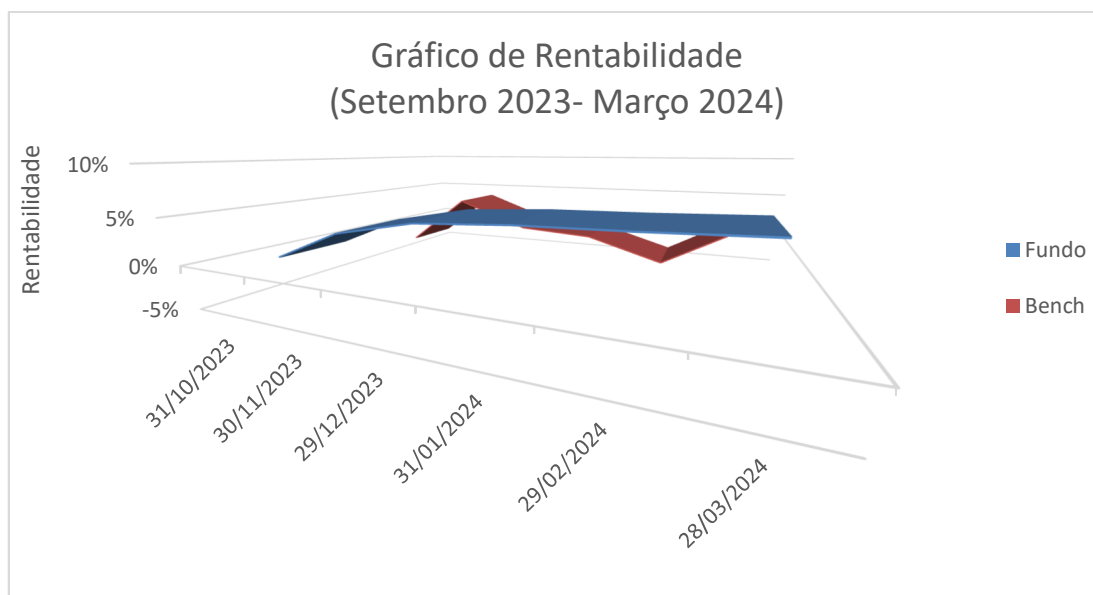
c) Tabela contendo a rentabilidade mensal do fundo comparado ao índice subjacente:

Evolução do Valor da Cota e da Rentabilidade							
Data	Patrimônio Líquido	Rentabilidade			Índice	Benchmark	
		Valor Cota	Variação Mês %	Variação Acumulada		Variação Mês	Variação Acumulada
29/09/2023	106.134.553,00	15,16	-	-	2297,20	-	-
31/10/2023	146.623.302,24	15,12	-0,26%	-0,26%	2238,42	-2,56%	-2,56%
30/11/2023	153.372.845,57	15,65	3,51%	3,23%	2325,57	3,89%	3,89%
29/12/2023	155.873.335,93	15,91	1,66%	4,95%	2337,68	0,52%	0,52%



31/01/2024	156.702.098,00	15,99	0,50%	5,47%	2336,74	-0,04%	-0,04%
29/02/2024	156.995.108,20	16,02	0,19%	5,67%	2270,52	-2,83%	-2,83%
28/03/2024	157.447.962,48	16,07	0,31%	6,00%	2333,19	2,76%	2,76%

d) Gráfico de evolução da rentabilidade acumulada do fundo comparado ao índice subjacente, desde a admissão para negociação em bolsa ou mercado de balcão organizado até a última cota disponível:



III – Explicações sobre o eventual erro de aderência ou diferença de rentabilidade, nos termos do art. 35

A estratégia de investimento do fundo é passiva e consiste em replicar o índice de referência BB ETF Renda Fixa PRÉ (SPBDI1FP). O fundo manteve-se dentro dos limites estabelecidos no artigo 35 da instrução CVM 359. O desempenho do fundo pode ser diferente daquele do índice de referência em decorrência das despesas previstas no regulamento do fundo. No período, o fundo acumulou as seguintes diferenças:

Fundo vs. Índice			
Fundo	Índice	Diferença de Rentabilidade	
0,50%	-0,07%	0,57%	Nos últimos 60 dias
6,00%	2,76%	3,24%	De 11/09/2023 a 31/03/2024



IV - Taxas de administração em moeda corrente e em percentual do Patrimônio líquido do fundo

A taxa de administração refere-se a gestão e administração do fundo e é apropriada e paga diariamente, sendo calculada sobre o patrimônio líquido diário à razão de no mínimo de 0,30% ao ano e no máximo de 0,40% ao ano.

Data	PL Médio Mensal em R\$	Taxa de Administração (em R\$/no mês)
set/23	85.285.996,54	6.291,33
out/23	137.079.416,53	5.445,08
nov/23	151.012.524,82	4.361,65
dez/23	154.650.573,93	1.400,28
jan/24	155.815.877,52	1.535,15
fev/24	156.576.600,51	1.305,13
mar/24	157.422.061,72	1.405,47

V – Outras informações

No exercício, não houve, contra ou a favor do Fundo, litígios, ações trabalhistas e quaisquer outros processos, bem como qualquer outro fato que pudesse ser considerado como contingência na esfera judicial.

Segue, anexo, demonstrações contábeis, acompanhadas do parecer do auditor independente.

Rio de Janeiro, 30 de maio de 2024

BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A.
ADMINISTRADORA