|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ANEXO 1 ‐ ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO**  (A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação) | | | | | | | |
| **Nome Fundo** | | BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA ‐ B | | | | | **CNPJ**                   07.861.554/0001‐22 |
| **Administrador** | | BB Gestão de Recursos DTVM s.a | | **Nº Termo Cred.** | | 002/2019 | **CNPJ**                   30.822.936/0001‐69 |
| **Gestor** | | BB Gestão de Recursos DTVM s.a | | **Nº Termo Cred.** | | 002/2019 | **CNPJ**                   30.822.936/0001‐69 |
| **Custodiante** | | BB Gestão de Recursos DTVM s.a | | | | | **CNPJ**                   30.822.936/0001‐69 |
|  | |  | | | | |  |
| **Classificação do Fundo Resolução CMN 4.604/2017:** | | | | | | | |
|  | Art. 7º, I, “b” | | |  | Art. 8º, I,“b” | | |
|  | Art. 7º, I,“c” | | |  | Art. 8º, II,“a” | | |
|  | Art. 7º, III,“a” | | |  | Art. 8º, II,“b” | | |
|  | Art. 7º, III,“b” | | |  | Art. 8º, III | | |
| X | Art. 7º, IV,“a” | | |  | Art. 8º, IV,“a” | | |
|  | Art. 7º, IV,“b” | | |  | Art. 8º, IV,“b” | | |
|  | Art. 7º, VII,“a” | | |  | Art. 8º, IV,“c” | | |
|  | Art. 7º, VII,“b” | | |  | Art. 9º‐A, I | | |
|  | Art. 7º, VII,“c” | | |  | Art. 9º‐A, II | | |
|  | Art. 8º, I,“a” | | |  | Art. 9º‐A, III | | |
|  |  | | |  |  | | |
| **Identificação dos documentos analisados**  **referentes ao Fundo:** | | | **Data do Documento** | | **Página na internet em que o documento foi consultado ou**  **disponibilizado pela instituição** | | |
| *1. Questionário Padrão Due Diligence para Fundo de*  *Investimento – Seção 2 da ANBIMA* | | | 01/01/2019 | | Disponibilizado pela Instituição | | |
| *2. Regulamento* | | | 23/05/2016 | | http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg\_sistema=fundosreg | | |
| *3. Lâmina de Informações essenciais* | | | 31/01/2019 | | http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg\_sistema=fundosreg | | |
| *4. Formulário de informações complementares* | | | 23/05/2016 | | http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg\_sistema=fundosreg | | |
| *5. Perfil Mensal* | | | 31/01/2019 | | http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg\_sistema=fundosreg | | |



|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *6. Demonstração de Desempenho* | | Referente a 2018 | | http://www37.bb.com.br/portalbb/fundosInvestimento/fundosinvestimento/gf07,  802,10340,10340,12,0.bbx?fundo=144 | | |
| *7. Relatórios de Rating* | | Não Disponibilizado pela Instituição | | Não Disponibilizado pela Instituição | | |
| *8. Demonstrações Contábeis* | | 31/03/2018 | | http://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg\_sistema=fundosreg | | |
|  | |  | |  | | |
| **II.5 Forma de Distribuição do Fundo**( art.3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011) | | | | | | |
| Nome/Razão Social do distribuidor: | | Banco do Brasil S.A. | | | | |
| CPF/CNPJ: | | 00.000.000/0001.91 | | | | |
| Informações sobre a Política de Distribuição: | | O FUNDO incorporará ao seu patrimônio os dividendos, juros sobre capital próprio ou outros rendimentos porventura  advindos de ativos e/ou operações que integrem a carteira do FUNDO. | | | | |
|  | |  | | | | |
| **Resumo das informações do Fundo de Investimento** | | | | | | |
| Data de Constituição: | 01/03/2006 | | Data de Início das Atividades: | | 09/03/2006 | |
| Política de Investimentos do  Fundo | Índice de referencia/objetivo de rentabilidade | | | | | |
| Para alcançar seus objetivos, o FUNDO deverá compor uma carteira com, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de seu patrimônio líquido  representado por ativos financeiros de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, a variação diária da taxa de juros doméstica e/ou  índice de preços. | | | | | |
| Público‐alvo: | Regimes Próprios de Previdência Social | | | | | |
| Condições de Investimento  (Prazos/Condições para  resgate) | Prazo de Duração do Fundo | | | | | Indeterminado |
| Prazo de Carência (dias) | | | | | 0 |
| Prazo para Conversão de Cotas (dias) | | | | | 0 |
| Prazo para Pagamento dos Resgates (dias) | | | | | 2 |
| Prazo Total (dias) | | | | | 2 |



|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Condições de Investimento  (Custos/Taxas) | Taxa de entrada (%) | | | 0 |
| Taxa de saída (%) | | | 0 |
| Taxa de Administração (%) | | | 0,30% a.a. |
| Taxa de Performance | | | |
| Índice de referencia | Frequência | Linha‐d'água | |
| Não Possui | Não se aplica | Não se aplica | |
| Aderência do Fundo aos quesitos  estabelecidos na    Resolução    do  CMN relativos, dentre outros, aos  gestores    e    administradores    do  fundo,    aos    ativos    de    crédito  privado que compõem sua carteira | O desempenho do fundo de investimento é considerado bom, de forma que nos últimos dois anos rentabilizou 27,28%, enquanto seu  benchmark rentabilizou no mesmo período 27,53%, se mostrando aderente ao seu Benchmark. O fundo não possui prazo de carência,  mostrando compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do RPPS. O Índice de Liquidez do Fundo foi obtido por meio do somatório  dos índices de liquidez apurados para cada ativo ou grupo de ativos financeiros. | | | |
| Alterações ocorridas relativas às  instituições      administradoras      e  gestoras do fundo: | Não Houve | | | |
| Análise      de      fatos      relevantes  divulgados: | 28/01/2011 ‐ Alteração nos Prazos de Cotização do Resgate e Crédito do Resgate | | | |
| Análise da aderência do fundo ao  perfil da carteira do RPPS e à sua  Política de Investimentos: | O fundo se encontra aderente ao perfil da carteira e a Política de Investimentos do RPPS. | | | |
| Principais    riscos    associados    ao  Fundo: | Risco de Taxa de Juros; Risco de Investimento em Títulos Indexados à Inflação; Risco de Descasamento em relação ao benchmark; Risco de  Liquidez; Risco de juros posfixados (CDI, TMS); Risco Proveniente do uso de Derivativos; Risco de Crédito; Risco de Conjuntura; Risco  Sistêmico e Risco Regulatório. | | | |



|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Histórico de Rentabilidade do Fundo:** | | | | | | | |
| **Ano** | **Nº de Cotistas** | **Patrimônio Líquido (R$)** | | **Valor da Cota do**  **Fundo (R$)** | **Rentabilidade (%)** | **Variação %**  **do índice**  **de**  **referência** | **Contribuição em relação ao**  **índice de referência ou**  **desempenho do fundo como**  **% do índice de referência** |
| **2018** | 189 | R$                              941.547.891,34 | | 4,469361928 | 12,83% | 13,06% | 98,23% |
| **2017** | 235 | R$                          1.070.534.298,25 | | 3,961246657 | 12,80% | 12,79% | 100,04% |
| **2016** | 244 | R$                          1.109.454.048,62 | | 3,51175135 | 24,46% | 24,81% | 98,59% |
| **2015** | 240 | R$                              901.755.196,20 | | 2,821596809 | 862,00% | 8,88% | 97,10% |
| **2014** | 250 | R$                          1.157.342.854,64 | | 2,597578893 | 14,45% | 14,54% | 99,38% |
|  |  |  | |  |  |  |  |
| **Análise da Carteira do Fundo de Investimento** | | | | | | | |
| **Composição da carteira (atual)** | | | **Espécie de ativos** | | | | **% do PL** |
| Títulos Públicos | | | | 83,06% |
| Debêntures | | | | 11,57% |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | | | | 4,28% |
| Operações Compromissadas | | | | 1,03% |
| Outras aplicações | | | | 0,07% |
|  | | |  | |  | |  |
| **Caso o Fundo aplique em cotas de outros**  **Fundos de Investimento** | | | **CNPJ Fundo(s)** | | **Classificação Resolução CMN** | | **% do PL** |
| ‐ | | ‐ | | ‐ |
| ‐ | | ‐ | | ‐ |
| ‐ | | ‐ | | ‐ |
| ‐ | | ‐ | | ‐ |
| ‐ | | ‐ | | ‐ |



|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Maiores emissores de títulos de crédito**  **privado em estoque do Fundo** | **Emissor (CPF/CNPJ)** | | **Classificação Resolução CMN** | **% do PL** |
| **‐** | | ‐ | ‐ |
| **‐** | | ‐ | ‐ |
| **‐** | | ‐ | ‐ |
| **‐** | | ‐ | ‐ |
| **‐** | | ‐ | ‐ |
| Carteira do Fundo é aderente à Política de Investimentos  estabelecida em seu regulamento e com a classificação na  Resolução CMN | | SIM | | |
| Prazo médio da carteira de títulos do Fundo (em meses (30) dias) | | 126,35 | | |
| Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras  do RPPS | | O fundo não possui prazo de carência, mostrando compatibilidade com as obrigações presentes e  futuras do RPPS. | | |
| **Nota de Risco de Crédito** | | **Agência de risco** | | **Nota** |
| Não Precisa | | Não Precisa |
| **Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:** | | O fundo analisado possui características de acordo com a Política de Investimentos do RPPS e sua  compatibilidade ao perfil da carteira comparado com os demais fundos distribuídos no mercado, com  os mesmo índice de Benchmark. | | |
| **Comentários Adicionais** | | Declaro que tenho 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. | | |



|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Declaro que tenho 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.** | | | | |
| **Data:** | | **11/02/2019** | | |
| **Responsáveis pela Análise:** | **Cargo** | | **CPF** | **Assinatura** |
|  |  | |  |  |
|  |  | |  |  |
|  |  | |  |  |

**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**



**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**

**Membro do Comitê de Investimentos**