

ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - SIMPLIFICADO

(A ser anexado ao termo de credenciamento da instituição e atualizado quando da alocação)

Nome Fundo	BNB Institucional FIC FI Renda Fixa Referenciado DI		CNPJ: 21.307.581/0001-89
Administrador	Santander Securities Services Brasil DTVM S.A.	Nº Termo Cred.	CNPJ: 62.318.407/0001-19
Gestor	Banco do Nordeste do Brasil S.A.	Nº Termo Cred.	CNPJ: 07.237.373/0001-20
Custodiante	Santander Securities Services Brasil DTVM S.A.		CNPJ: 62.318.407/0001-19

Comentado [u1]: (Continuação do Processo de Credenciamento)
A análise deve ser feita para cada fundo individualmente, preenchendo com as informações a que se refere. Uma vez que as características são as mais diversas, utilize somente os campos apropriados.

Comentado [u2]: Caso o administrador e gestor serem os mesmos, deixar o campo em branco.

Comentado [u3]: Assinale a opção a que se refere ao fundo em questão.

Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/10	
<input type="checkbox"/> FI 100% títulos do TN	<input type="checkbox"/> FI Ações referenciadas
<input type="checkbox"/> FI Renda Fixa/Referenciados	<input type="checkbox"/> FI de Índices Referenciados em Ações
<input type="checkbox"/> FI de Índices Referenciados em Renda Fixa	<input type="checkbox"/> FI em Ações
<input type="checkbox"/> FI de Renda Fixa	<input type="checkbox"/> FI Multimercado
<input type="checkbox"/> FI de Índices Referenciados em Renda Fixa	<input type="checkbox"/> FI em Participações
<input type="checkbox"/> FI em Direitos Creditórios	<input type="checkbox"/> FI Imobiliário
<input type="checkbox"/> FI Renda Fixa "Crédito Privado"	<input type="checkbox"/> Outros Ativos:

Identificação dos documentos analisados referentes ao Fundo:	Data do doc.	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	31/01/2018	www.bnb.gov.br/fundos
2. Regulamento	01/03/2018	www.bnb.gov.br/fundos
3. Lâmina de Informações essenciais	28/02/2018	www.bnb.gov.br/fundos
4. Formulário de informações complementares	01/03/2018	www.bnb.gov.br/fundos
5. Perfil Mensal		
6. Demonstração de Desempenho	31/12/2017	www.bnb.gov.br/fundos
7. Relatórios de Rating		
8. Demonstrações Contábeis	30/09/2017	www.bnb.gov.br/fundos

Comentado [u4]: Levantar os principais pontos da política de investimento, incluindo as possibilidades de aplicação, vedações impostas, entre outros fatores determinantes. A análise deve ter como foco o índice de referência adotado no fundo e no objetivo proposto por ele.

Resumo das informações do Fundo de Investimento			
Data de Constituição:	13/10/2014	Data de Início das Atividades:	23/12/2014
Política de Investimentos do Fundo	Índice de referência/objetivo de rentabilidade: CDI / acompanhar a variação do CDI. Aplicação de 95% do PL em cotas do fundo BNB Master 80 FI RF Ref DI, de forma a acompanhar, direta ou indiretamente, as variações do CDI ou SELIC.		
Público-alvo:	Destinado a pessoas jurídicas correntistas do Banco do Nordeste que desejam investir em fundo com risco, preponderantemente, inerente a títulos públicos federais pós-fixados.		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo de Duração do Fundo	indeterminado	
	Prazo de Carência (dias)	não	
	Prazo para Conversão de Cotas (dias)	D+0	
	Prazo para Pagamento dos Resgates (dias)	D+0	
	Prazo Total (dias)	D+0	
Condições de Investimento (Taxas)	Taxa de entrada (%)	não	
	Taxa de saída (%)	não	
	Taxa de administração (%)	0,35% a.a.	
	Taxa de Performance		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d'água
Alterações relativas ao Admin/Gestor do fundo:			

Consultas a fatos relevantes divulgados:						
Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à Política de Investimentos:						
Principais riscos associados ao Fundo:						
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
2017	45	197.164.486,59	1,390000	9,65	9,95	97,01
2016	14	46.213.595,69	1,270000	13,34	14,00	95,29
2015	9	40.133.204,28	1,120000	11,82	13,23	89,37
2014	---	---	1,001680	0,17	0,22	76,36
2013	---	---	---	---	---	---
Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:						
Análise da Carteira do Fundo de Investimento						
Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos					% do PL
	Cotas do fundo BNB Master 80 FI RF Ref DI					96,59
	Operações Compromissadas em Títulos Públicos Federais					3,41
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ Fundo(s)		Classificação Resolução CMN		% do PL	
	19.273.091/0001-67		FI Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"		25,6	
	2.					
	3.					
Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo	Emissor (CPF/CNPJ)		Tipo de Emissor		% do PL	
Carteira do Fundo é aderente à Política de Investimentos estabelecida em seu regulamento e com a classificação na Resolução CMN						
Prazo médio da carteira de títulos do Fundo (em meses (30 dias))			146,5 meses (30 dias)			
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS						
Nota de Risco de Crédito	Agência de risco				Nota	
Comentários Adicionais						

Comentado [u5]: É sugerido histórico de 5 anos somente, mas pode ser alterado conforme o interesse do analista.

Comentado [u6]: Resultado da análise da situação financeira do fundo (histórico, patrimônio, rentabilidade, índice de referência).

Comentado [u7]: Existem fatos relevantes, processos judiciais ou cenários micro ou macroeconômicos que possam vir a afetar o desempenho do fundo? Existe algum risco eminente no qual pode mudar a perspectiva da análise feita aqui?

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:			
Responsáveis pela Análise:	Cargo	CPF	Assinatura