|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - SIMPLIFICADO**  **(A ser anexado ao termo de credenciamento da instituição e atualizado quando da alocação)** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Nome Fundo** | | | | Bradesco Institucional Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Renda Fixa IMA-B 5 | | | | | | | | | | | | | | | CNPJ: 20.216.216/0001-04 | |
| **Administrador** | | | | Banco Bradesco S.A. | | | | | | | | | | Nº Termo Cred. | |  | | | CNPJ: 60.746.948/0001-12 | |
| **Gestor** | | | | BRAM – Bradesco Asset Management S.A. - DTVM | | | | | | | | | | Nº Termo Cred. | |  | | | CNPJ: 62.375.134/0001-44 | |
| **Custodiante** | | | | Banco Bradesco S.A. | | | | | | | | | | | | | | | CNPJ: 60.746.948/0001-12 | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/10** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | FI 100% títulos do TN | | | | | | | |  | | | FI Ações referenciados | | | | | | | |
|  | | FI Renda Fixa/Referenciados | | | | | | | |  | | | FI de Índices Referenciados em Ações | | | | | | | |
|  | | FI de Índices Referenciados em Renda Fixa | | | | | | | |  | | | FI em Ações | | | | | | | |
|  | | FI de Renda Fixa | | | | | | | |  | | | FI Multimercado | | | | | | | |
|  | | FI de Índices Referenciados em Renda Fixa | | | | | | | |  | | | FI em Participações | | | | | | | |
|  | | FI em Direitos Creditórios | | | | | | | |  | | | FI Imobiliário | | | | | | | |
|  | | FI Renda Fixa “Crédito Privado” | | | | | | | |  | | | 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* |  |  | | *2. Regulamento* |  |  | | *3. Lâmina de Informações essenciais* |  |  | | *4. Formulário de informações complementares* |  |  | | *5. Perfil Mensal* |  |  | | *6. Demonstração de Desempenho* |  |  | | *7. Relatórios de Rating* |  |  | | *8. Demonstrações Contábeis* |  |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Resumo das informações do Fundo de Investimento** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Data de Constituição: | | | | | | | | 04/8/2014 | | | Data de Início das Atividades: | | | | | | | | 08/8/2014 | |
| Política de Investimentos do Fundo | | | | | | | | Índice de referência/objetivo de rentabilidade: IMA-B 5 | | | | | | | | | | | | |
| O FUNDO tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas rentabilidade que busque superar a variação do IMA-B 5, por meio das oportunidades oferecidas pelos mercados domésticos de taxa de juros pós-fixadas e pré-fixadas, e índices de preço, excluindo estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável. | | | | | | | | | | | | |
| Público-alvo: | | | | | | | | O FUNDO destina-se a Entidades Abertas e Fechadas de Previdência Complementar, regimes próprios de Previdência Social instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios, clientes Corporate e/ou Fundos de Investimento e Carteiras Administradas. | | | | | | | | | | | | |
| Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate) | | | | | | | | Prazo de Duração do Fundo | | | | | | | | | | | Indeterminado | |
| Prazo de Carência (dias) | | | | | | | | | | | Não possui | |
| Prazo para Conversão de Cotas (dias) | | | | | | | | | | | 0 d.u. após solicitação | |
| Prazo para Pagamento dos Resgates (dias) | | | | | | | | | | | 1 d.u. após solicitação | |
| Prazo Total (dias) | | | | | | | | | | | Não se aplica | |
| Condições de Investimento (Taxas) | | | | | | | | Taxa de entrada (%) | | | | | | | | | | | Não possui | |
| Taxa de saída (%) | | | | | | | | | | | Não possui | |
| Taxa de administração (%) | | | | | | | | | | | 0,20% a.a. | |
| Taxa de Performance – Não possui | | | | | | | | | | | | |
| 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** | | | |
| **01/2017** | | | 70 | | 277.234.044,20 | | | | 1,37992260 | | | 1,17% | | | 1,09% | | 107,86% | | | |
| **12/2016** | | | 69 | | 280.924.433,97 | | | | 1,36392840 | | | 15,33% | | | 14,00% | | 109,47% | | | |
| **12/2015** | | | 45 | | 132.299.190,18 | | | | 1,1826626 | | | 14,45% | | | 13,23% | | 109,24% | | | |
| **12/2014** | | | 17 | | 38.641.327,91 | | | | 1,03333490 | | | 3,33% | | | 4,32% | | 77,13% | | | |
| **2013** | | | --- | | --- | | | | --- | | | --- | | | --- | | --- | | | |
| Análise conclusiva e comparativa com outros fundos: | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Análise da Carteira do Fundo de Investimento** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Composição da carteira (atual)** | | | | | | **Espécie de ativos** | | | | | | | | | | | | | | **% do PL** |
| Títulos públicos federais | | | | | | | | | | | | | | 96,63% |
| Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais | | | | | | | | | | | | | | 2,69% |
| Derivativos | | | | | | | | | | | | | | 1,59% |
| Títulos de crédito privado | | | | | | | | | | | | | | 0,63% |
| Cotas de fundos de investimento 409 | | | | | | | | | | | | | | 0,08% |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento** | | | | | CNPJ Fundo(s) | | | | | Classificação Resolução CMN | | | | | | | | | | % do PL |
| 15.714.258/0001-27 | | | | | Bram Fundo de Investimentos Renda Fixa Ima B 5 | | | | | | | | | | 100% |
| --- | | | | | --- | | | | | | | | | | --- |
| --- | | | | | --- | | | | | | | | | | --- |
| --- | | | | | --- | | | | | | | | | | --- |
| **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) | | | | | | | | | | | | | | | 26,36 meses | | | | |
| Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | |
| **Nota de Risco de Crédito** | | | | | | | **Agência de risco** | | | | | | | | | | | | **Nota** | |
| Não aplicável | | | | | | | | | | | | --- | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **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.**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Data:** | |  | |
| **Responsáveis pela Análise:** | **Cargo** | **CPF** | **Assinatura** |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |