|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO[[1]](#footnote-1)**  **(A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação)** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Nome Fundo** | | | BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP | | | | | | | | | | | | | | | CNPJ: 08.960.975/0001-73 | |
| **Administrador** | | | BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL S.A | | | | | | | | | | Nº Termo Cred. | | 05/2020 | | | CNPJ: 92.702.067/0001-96 | |
| **Gestor** | | | BANRISUL S.A CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS E CÂMBIO | | | | | | | | | | Nº Termo Cred. | | 06/2020 | | | CNPJ: 93.026.847/0001-26 | |
| **Custodiante** | | | BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL S.A | | | | | | | | | | | | | | | CNPJ: 92.702.067/0001-96 | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Classificação do Fundo Resolução CMN 3.922/2010** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | 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 | | | | | | | |
|  | 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 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* |  | *www.banrisul.com.br* | | *2. Regulamento* |  | *www.banrisul.com.br* | | *3. Lâmina de Informações essenciais* |  | *www.banrisul.com.br* | | *4. Formulário de informações complementares* |  | *www.banrisul.com.br* | | *5. Perfil Mensal* |  | *www.banrisul.com.br* | | *6. Demonstração de Desempenho* |  | *www.banrisul.com.br* | | *7. Relatórios de Rating* |  | *www.banrisul.com.br* | | *8. Demonstrações Contábeis* |  | *www.banrisul.com.br* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **II.5 - Forma de Distribuição do Fundo** (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Nome/Razão Social do distribuidor: | | | | | | | Banco do Estado do Rio Grande do Sul S.A. | | | | | | | | | | | | |
| CPF/CNPJ: | | | | | | | 92.702.067/0001-96 | | | | | | | | | | | | |
| Informações sobre a Política de Distribuição: | | | | | | | A distribuição dos Fundos de Investimento é realizada exclusivamente pelo Banco do Estado do Rio Grande do Sul S.A., por meio de suas agências e canais digitais. | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Resumo das informações do Fundo de Investimento** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Data de Constituição: | | | | | | 20/07/2007 | | | | Data de Início das Atividades: | | | | | | | | 03/09/2007 | |
| Política de Investimentos do Fundo | | | | | | Índice de referência/objetivo de rentabilidade: | | | | | | | | | | | | | |
| Tem por objetivo acompanhar a variação do sub-índice IMA-Geral (Índice de Mercado Anbima Geral) aplicando, no mínimo, 95% da carteira em títulos públicos e privados, relacionados a este indicador. As aplicações em títulos privados estão limitadas a 50% do patrimônio líquido. | | | | | | | | | | | | | |
| Público-alvo: | | | | | | Regimes Próprios de Previdência Estadual e Municipal | | | | | | | | | | | | | |
| Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate) | | | | | | Prazo de Duração do Fundo | | | | | | | | | | | | NA | |
| Prazo de Carência (dias) | | | | | | | | | | | | NA | |
| Prazo para Conversão de Cotas (dias) | | | | | | | | | | | | D+0 | |
| Prazo para Pagamento dos Resgates (dias) | | | | | | | | | | | | D+0 | |
| Prazo Total (dias) | | | | | | | | | | | | NA | |
| Condições de Investimento (Custos/Taxas) | | | | | | Taxa de entrada (%) | | | | | | | | | | | | NA | |
| Taxa de saída (%) | | | | | | | | | | | | NA | |
| Taxa de administração (%) | | | | | | | | | | | | 0,20% A.A | |
| Taxa de Performance | | | | | | | | | | | | | |
| Índice de referencia | | | Frequência | | | | | | | | Linha-d`água | | |
| NA | | | NA | | | | | | | | NA | | |
| 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 | | | | | | Aderente | | | | | | | | | | | | | |
| Alterações ocorridas relativas às instituições administradoras e gestoras do fundo: | | | | | | Nada consta de relevante | | | | | | | | | | | | | |
| Análise de fatos relevantes divulgados: | | | | | | Nada consta | | | | | | | | | | | | | |
| Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos: | | | | | | Adere, dentro dos limites do risco associado | | | | | | | | | | | | | |
| Principais riscos associados ao Fundo: | | | | | | Índices de preços - IPCA | | | | | | | | | | | | | |
| **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** | | | |
| **2019** | | 94 | | 233.788.081,55 | | | | 3,9212 | | | 12,03% | | | 12,82% | | 93,84% | | | |
| **2018** | | 77 | | 132.976.548,61 | | | | 3,5000 | | | 9,70% | | | 10,03% | | 96,71% | | | |
| **2017** | | 73 | | 152.847.691,79 | | | | 3,1905 | | | 12,94% | | | 12,81% | | 101,01% | | | |
| **2016** | | 88 | | 137.805.265,55 | | | | 2,8247 | | | 20,30% | | | 20,99% | | 96,71% | | | |
| **2015** | | 92 | | 127.991.368,73 | | | | 2,3480 | | | 9,30% | | | 9,31% | | 99,83% | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Análise da Carteira do Fundo de Investimento** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Composição da carteira (atual)** | | | | **Espécie de ativos** | | | | | | | | | | | | | | | **% do PL** |
| LTN | | | | | | | | | | | | | | | 27,20% |
| LFT | | | | | | | | | | | | | | | 24,58% |
| NTN-B | | | | | | | | | | | | | | | 19,18% |
| LFT (Operações Compromissadas) | | | | | | | | | | | | | | | 14,44% |
| NTN-F | | | | | | | | | | | | | | | 13,00% |
|  | | | | Debêntures Simples | | | | | | | | | | | | | | | 1,65% |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento** | | | | CNPJ Fundo(s) | | | | | Classificação Resolução CMN | | | | | | | | | | % do PL |
| 1. NA | | | | | NA | | | | | | | | | | NA |
| 1. NA | | | | | NA | | | | | | | | | | NA |
| 1. NA | | | | | NA | | | | | | | | | | NA |
| ..... | | | | |  | | | | | | | | | |  |
| **Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo** | | | | Emissor (CPF/CNPJ) | | | | | Tipo de Emissor | | | | | | | | | | % do PL |
| Júlio Simões Logística S.A. -  52.548.435/0001-79 | | | | | Transporte e Logística | | | | | | | | | | 0,97% |
| Cachoeira Paulista Transmissora Energia –  05.336.882/0001-84 | | | | | Concessionária de Rodovias | | | | | | | | | | 0,57% |
|  | | | | |  | | | | | | | | | |  |
|  | | | | |  | | | | | | | | | |  |
| 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) | | | | | | | | | | | | | | | 53,7 meses | | | | |
| Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS | | | | | | | | | Compatível. | | | | | | | | | | |
| **Nota de Risco de Crédito** | | | | | **Agência de risco** | | | | | | | | | | | | | **Nota** | |
| NA | | | | | | | | | | | | | NA | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Análise conclusiva e comparativa com outros fundos:** | | | | | Fundo apto e em conformidade aos ativos disponível no mercado com o mesmo objetivo | | | | | | | | | | | | | | |
| **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:** | | **11/12/2020** | |
| **Responsáveis pela Análise:** | **Cargo** | **CPF** | **Assinatura** |
| **Luís Antônio Kleinübing** | **Presidente** | **539.326.920-04** |  |
| **Luciane Vogt** | **Gestor** | **885.700.290-04** |  |
| **Walter Dreyer** | **Membro do Comitê de Investimentos** | **394.013.320-53** |  |
| **Júlia Dezingrini** | **Membro do Comitê de Investimentos** | **539.664.730-20** |  |

Este formulário tem por objetivo colher informações para a análise do credenciamento de instituições pelos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS). Não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos sob a gestão ou administração da instituição, devendo o RPPS, ao efetuar a aplicação de recursos, certificar-se da observância das condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência e os requisitos e limites previstos na Resolução do CMN, a aderência à Politica Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

1. [↑](#footnote-ref-1)