

| ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO (A ser anexado ao termo de credenciamento da instituição e atualizado quando da alocação) | | | | | |
|--|---|--|----------------------------|--|--------------------|
| Nome Fundo | BB INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA | | | CNPJ | 02.296.928/0001-90 |
| Administrador | BB DTVM S.A | Nº Termo | ---- | CNPJ | 30.822.936/0001-69 |
| Gestor | BB DTVM S.A | Nº Termo | ---- | CNPJ | 30.822.936/0001-69 |
| Custodiante | Banco do Brasil S.A | | | CNPJ | 00.000.000/0001-91 |
| Classificação do Fundo Resolução CMN 4.963*: | | Artigo 7º, Inciso III, 'a' | | | |
| | 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 | | |
| *Observação: A Classificação informada se refere à carteira do Fundo na presente data. | | | | | |
| 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 – ANBIMA (Anexo I) | | | 31/12/2021 | www.bbdtvm.com.br | |
| 2. Regulamento | | | 28/02/2019 | www.bbdtvm.com.br | |
| 3. Lâmina de Informações essenciais | | | dez-22 | www.bbdtvm.com.br | |
| 4. Formulário de informações complementares | | | dez-22 | www.bbdtvm.com.br | |
| 5. Perfil Mensal | | | dez-22 | www.bbdtvm.com.br | |
| 6. Demonstração de Desempenho | | | dez-22 | www.bbdtvm.com.br | |
| 7. Relatórios de Rating | | | NA | NA | |
| 8. Demonstrações Contábeis | | | Dezembro | www.bbdtvm.com.br | |
| 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: | | Fundo distribuído através de Agências de Relacionamento e Canais de Autoatendimento. | | | |
| Resumo das informações do Fundo de Investimento | | | | | |
| Data de Constituição: | | 19/07/2001 | Data de início atividades: | | 19/07/2001 |
| Política de Investimentos do Fundo: (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.) | | Índice de referência/objetivo de rentabilidade: | CDI | | |
| | | O Fundo tem como objetivo proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. As aplicações deverão se subordinar às faixas de alocação estabelecida sem seu regulamento, sendo que, no mínimo, 80% de seu patrimônio líquido devem ser representados por ativos relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à taxa de juros doméstica. | | | |
| Público-alvo: | | O Fundo destina-se a receber recursos de Entidades Fechadas e Abertas de Previdência Complementar, Regimes Próprios de Previdência Social, Companhias Seguradoras e de Capitalização e outras pessoas jurídicas considerados investidores qualificados. | | | |
| Condições de investimento (prazos/ condições para resgate) | | Prazo Duração do Fundo | | Indeterminado | |
| | | Prazo de carência (dias) | | Não há | |
| | | Prazo para conversão de cotas aplicação (dias) | | D+0 | |
| | | Prazo para conversão de cotas resgate (dias) | | D+0 | |
| | | Prazo para pagamento dos resgates (dias) | | D+0 | |
| | | Prazo Total (dias) | | D+0 | |
| Condições de Investimento (Taxas) | | Taxa de entrada (%) | | Não há | |
| | | Taxa de saída (%) | | Não há | |
| | | Taxa de administração (%) | | 0,20% a.a. | |
| | | Taxa de administração máxima (%) | | 0,20% a.a. | |
| | | Taxa de Performance (%) | | Não há | |
| | | Informações Taxa de Performance | | | |
| | | Índice de referência | Frequência | Linha-d'água | |
| NA | | NA | | NA | |
| Aderência do Fundo aos quesitos estabelecidos na Resolução CMN relativos, dentre outros, aos gestores e administradores do fundo, aos ativos de crédito privado que compõem sua carteira. | | | | | |

| Alterações ocorridas relativas às instituições Administradora e Gestora do fundo: | | NA | | | | |
|--|----------------|---|------------------------------|-----------------------------|------------------------------------|---|
| Fatos relevantes divulgados: | | 21/06/2016 - Provisão para créditos de liquidação duvidosa; 06/07/2016 - Provisão para créditos de liquidação duvidosa - complemento; 08/01/2018 - Alteração dos valores de movimentação do Fundo a partir de 15/01/2018 | | | | |
| Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos: | | | | | | |
| Principais riscos associados ao Fundo: | | Risco de Taxa de Juros; Risco de Crédito; Risco de juros posfixados (CDI, TMS); Risco de Investimento em Títulos Indexados à Inflação; Risco Proveniente do uso de Derivativos; Risco de Concentração; Risco de Liquidez; Risco de Conjuntura; Risco Sistemico; 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 |
| dez/22 | 137 | R\$ 2.433.411.616,00 | 10,792 | 1,13% | 1,12% | 100,89% |
| 2021 | 91 | R\$ 994.840.968,08 | 9,575 | 4,86% | 6,42% | 75,70% |
| 2020 | 73 | R\$ 618.900.800,89 | 9,131 | 2,44% | 4,40% | 55,35% |
| 2019 | 93 | R\$ 937.126.571,09 | 8,914 | 5,83% | 4,40% | 132,50% |
| 2018 | 106 | R\$ 1.102.840.927,81 | 8,423 | 6,65% | 2,77% | 240,07% |
| 2017 | 126 | R\$ 1.107.556.847,77 | 7,898 | 10,20% | 5,97% | 170,85% |
| Análise conclusiva e comparativa com outros fundos: Resultado da análise da situação financeira do fundo (histórico, patrimônio, rentabilidade, índice de referência). | | | | | | |
| Análise da Carteira do Fundo de Investimento | | | | | | |
| Composição da carteira (atual) | | Espécie de ativo | | | % do PL | |
| | | LFT | | | 40,26% | |
| | | Op. Compromissada Over | | | 31,00% | |
| | | Letra Financeira Não Ligada | | | 16,10% | |
| | | Debêntures | | | 10,40% | |
| | | DPGE Pós Fixado Bancos Privados | | | 1,66% | |
| | | ---- | | | 0,00% | |
| | | Outros | | | 0,58% | |
| Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento | | CNPJ desse(s) Fundo(s) | | Classificação Resolução CMN | | % do PL |
| | | ---- | | ---- | | ---- |
| | | ---- | | ---- | | ---- |
| | | ---- | | ---- | | ---- |
| | | ---- | | ---- | | ---- |
| | | ---- | | ---- | | ---- |
| 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) | | | | NA | | |
| Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS | | | | | | |
| Nota de Risco de Crédito | | Agência de risco | | | Nota | |
| | | NA | | | NA | |
| Comentários Adicionais (Existem fatos relevantes, processos judiciais ou cenários micro ou macroeconômicos que possam vir a afetar o desempenho do fundo? Existe algum risco eminente na qual pode mudar a perspectiva da análise feito 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 |
| | | | | | | |
| | | | | | | |