


ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
(A ser anexado ao termo de credenciamento da instituição e atualizado quando da alocação)

| | | | | | |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|-------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
| Nome Fundo | BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | | | CNPJ | 06.015.368/0001-00 |
| 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 8º, Inciso III | | | |
| Art. 7º, I, "b" | | Art. 8º, II | | | |
| Art. 7º, I, "c" | | Art. 9º, I | | | |
| Art. 7º, II | | Art. 9º, II | | | |
| Art. 7º, III, "a" | | Art. 9º, III | | | |
| Art. 7º, III, "b" | X | Art. 10, I | | | |
| Art. 7º, IV | | Art. 10, II | | | |
| Art. 7º, V, "a" | | Art. 10, III | | | |
| Art. 7º, V, "b" | | Art. 11 | | | |
| Art. 7º, V, "c" | | Art. 12 | | | |
| Art. 8º, I | | | | | |
| *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 – Seção 2 da ANBIMA | | | 31/12/2020 | www.bbdtvm.com.br | |
| 2. Regulamento | | | 06/08/2019 | www.bbdtvm.com.br | |
| 3. Lâmina de Informações essenciais | | | jan-21 | www.bbdtvm.com.br | |
| 4. Formulário de informações complementares | | | jan-21 | www.bbdtvm.com.br | |
| 5. Perfil Mensal | | | jan-21 | www.bbdtvm.com.br | |
| 6. Demonstração de Desempenho | | | jan-21 | www.bbdtvm.com.br | |
| 7. Relatórios de Rating | | | NA | NA | |
| 8. Demonstrações Contábeis | | | Março | 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: | 28/06/2006 | Data de início atividades: | 26/06/2006 | | |
| 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 buscando rentabilidade superior a variação do CDI, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento (FIs), com perfis diferenciados e que apresentem em sua composição ativos com prazo médio de carteira superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias, utilizando-se de uma estratégia de investimento diversificada. Para isso, o fundo aplicará seus recursos em FIs que apresentem uma carteira composta, isolada ou cumulativamente, pelos seguintes ativos financeiros: títulos públicos federais, títulos privados, operações compromissadas, operações com derivativos, cotas de fundos de investimento, cotas de fundos de investimento em direitos creditórios e operações em mercados de derivativos, ficando excluídas operações sujeitas a risco do mercado acionário brasileiro. Os ativos componentes da carteira dos FIs deverão apresentar prazo médio superior a 365 (trezentos e | | | | |
| Público-alvo: | O fundo é destinado a clientes pessoas físicas, jurídicas, Regimes Próprios de Previdência Social ("RPPS") e Entidades Fechadas de Previdência Complementar ("EFPC") do Banco do Brasil, que desejem diversificar suas aplicações financeiras utilizando-se de um único instrumento e que busquem retorno no longo prazo, por meio de investimento em diversas classes de ativos financeiros. | | | | |
| 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+1 |
| | Prazo para conversão de cotas resgate (dias) | | | | D+1 |
| | Prazo para pagamento dos resgates (dias) | | | | D+1 |
| | Prazo Total (dias) | | | | 1 dia útil |
| Condições de Investimento (Taxas) | Taxa de entrada (%) | | | | Não há |
| | Taxa de saída (%) | | | | Não há |
| | Taxa de administração (%) | | | | 0,50% a.a. |
| | Taxa de administração máxima (%) | | | | 1,00% a.a. |
| | Taxa de Performance (%) | | | | 20,00% |
| | Informações Taxa de Performance | | | | |
| Índice de referência | | Frequência | | Linha-d'água | |
| CDI | | Semestral | | Rentabilidade que exceder 100% da variação do CDI. | |
| 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: | | 25/01/2007 - Política de divulgação de informações; 28/02/2007 - Política de divulgação de informações; 03/04/2014 - Alteração de nomenclatura e exercício social do fundo | | | | | |
| Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos: | | | | | | | |
| Principais riscos associados ao Fundo: | | Risco Cambial; Risco de Taxa de Juros; Risco Proveniente do Uso de Derivativos; Risco de Crédito; Risco de Juros Pós-fixados (CDI, TMS); Risco de Liquidez; Risco de Mercado Externo; Risco de Contraparte; Risco de Concentração; Risco de Conjuntura; Risco Sistêmico; 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 | |
| jan/21 | 43.514 | R\$ 2.244.665.449,12 | 3,701 | 0,26% | 0,15% | 170,58% | |
| 2019 | 5.790 | R\$ 246.886.499,05 | 3,544 | 6,63% | 5,96% | 111,23% | |
| 2018 | 6.948 | R\$ 376.666.625,49 | 3,324 | 2,46% | 6,42% | 38,27% | |
| 2017 | 6.041 | R\$ 444.706.000,42 | 3,244 | 10,39% | 9,93% | 104,73% | |
| 2016 | 3.263 | R\$ 179.966.852,45 | 2,939 | 14,63% | 14,00% | 104,51% | |
| 2015 | 3.066 | R\$ 154.544.084,49 | 2,564 | 14,11% | 13,24% | 106,57% | |
| 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) BB TOP TRADE LP FI MULTIMERCADO BB TOP TRADE PLUS LP FI MULTIMERCADO | | Espécie de ativo | | | | % do PL | |
| | | Op. Compromissada Over | | | | 40,29% | |
| | | LFT | | | | 18,25% | |
| | | LTN | | | | 15,08% | |
| | | NTN-B | | | | 11,28% | |
| | | Debêntures' | | | | 3,83% | |
| | | NTN-F | | | | 3,65% | |
| Outros | | | | 7,62% | | | |
| Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento | | CNPJ desse(s) Fundo(s) | | Classificação Resolução CMN | | % do PL | |
| | | 07.832.144/0001-53 | | ---- | | 95,00% | |
| | | 12.013.309/0001-53 | | ---- | | 5,00% | |
| | | ---- | | ---- | | ---- | |
| | | ---- | | ---- | | ---- | |
| 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 | |
| ÂNGELO JOSÉ LOBATO RODRIGUES | | MEMBRO DO COMITÊ DE INVESTIMENTO | | 352.316.702-78 | |  | |
| JOSÉ GUILHERME GOMES DIAS | | MEMBRO DO COMITÊ DE INVESTIMENTO | | 701.719.392-04 | | | |
| CAMILA CAVALCANTE DA SILVA | | MEMBRO DO COMITÊ DE INVESTIMENTO | | 018.374.872.-78 | | | |