

| ANEXO 1 - ANÁLISE DE FUNDOS DE INVESTIMENTO ¹ | | | |
|--|---|---|--------------------------|
| (A ser anexado ao Atestado de Credenciamento da Instituição Administradora e Gestora do Fundo de Investimento e atualizado quando da alocação) | | | |
| Nome Fundo | BNB ESPECIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI | | CNPJ:03.772.955/0001-55 |
| Administrador | S3 CACEIS 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 | BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A. | | CNPJ:07.237.373/0001-20 |
| Classificação do Fundo Resolução CMN 4.963/2021 | | | |
| Art. 7º, III, "a" | | | |
| 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 | 29/12/2023 | www.bnb.gov.br/fundos (Credenciamento RPPS) | |
| 2. Regulamento | | www.bnb.gov.br/fundos | |
| 3. Lâmina de Informações essenciais | | www.bnb.gov.br/fundos | |
| 4. Formulário de informações complementares | | www.bnb.gov.br/fundos | |
| 5. Perfil Mensal | | http://cvmweb.cvm.gov.br | |
| 6. Demonstração de Desempenho | | www.bnb.gov.br/fundos | |
| 7. Relatórios de Rating | | Não se aplica | |
| 8. Demonstrações Contábeis | | www.bnb.gov.br/fundos | |
| II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011) | | | |
| Nome/Razão Social do distribuidor: | BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A. | | |
| CPF/CNPJ: | 07.237.373/0001-20 | | |
| Informações sobre a Política de Distribuição: | Os cotistas dos fundos de investimento do Banco do Nordeste devem ser clientes da instituição, sendo a prospecção feita pela rede de agências e pelos canais <i>Internet Banking</i> e <i>Mobile Banking</i> . Os cotistas são agregados dentre os segmentos "Fundos de Pensão de Empresa Pública", "Corporate", "Middle Market", "Varejo", "Poder Público", "RPPS", "Fundos de Investimento" e "Outros". O distribuidor exclusivo deste Fundo é o Banco do Nordeste. | | |
| Resumo das informações do Fundo de Investimento | | | |
| Data de Constituição: | 28/04/2000 | Data de Início das Atividades: | 28/04/2000 |
| Política de Investimentos do Fundo | Índice de referência/objetivo de rentabilidade: Consiste na aplicação de, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) do patrimônio líquido em cotas do BNB Master 60 Fundo de Investimento Renda Fixa Referenciado DI (Fundo Investido), e, no máximo, 5% em títulos públicos federais ou operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais. Por sua vez, o Fundo Investido possui gestão conservadora com aplicação mínima de 60% em títulos públicos federais, e aplicação máxima de até 40% em títulos privados de renda fixa considerados de baixo risco de crédito pelo gestor e de até 5% em títulos prefixados. O Fundo Investido procura acompanhar a variação da taxa dos Certificados de Depósitos Interfinanceiros (CDI), não havendo, entretanto, compromisso em atingi-la. | | |
| Público-alvo: | Pessoas físicas e jurídicas correntistas do Banco do Nordeste que desejam investir em fundo com risco 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 há | |
| | Prazo para Conversão de Cotas (dias) | D+0 | |
| | Prazo para Pagamento dos Resgates (dias) | D+0 | |

¹Este 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 Política Anual de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.

| | | | | | | |
|--|---|--------------------------|------------------------------|-------------------|------------------------------------|--|
| | Prazo Total (dias) | | | D+0 | | |
| Condições de Investimento (Custos/Taxas) | Taxa de entrada (%) | | | Não há | | |
| | Taxa de saída (%) | | | Não há | | |
| | Taxa de administração (%) | | | 0,8% a.a. | | |
| | Taxa de Performance | | | | | |
| | Índice de referência | | Frequência | | Linha-d`água | |
| | Não se aplica | | Não se aplica | | Não se aplica | |
| 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 | Consoante Art. 7º, III, “a” da Res. CMN nº 4963/21, as aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social estão subordinados aos limites, no segmento de renda fixa, de até 60% em cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa constituídos sob a forma de condomínio aberto, critério que se coaduna com a política de investimentos do fundo de investimento BNB ESPECIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI. | | | | | |
| Alterações ocorridas relativas às instituições administradoras e gestoras do fundo: | Maio/2016 - Alteração do Administrador Fiduciário Banco do Nordeste do Brasil S.A. para Santander Securities Services Brasil DTVM S.A. | | | | | |
| Análise de fatos relevantes divulgados: | Set/2015: Alteração de Regulamento - Adaptação do Regulamento à Instrução CVM 555/2014 e outras alterações vigentes a partir de 21/10/2015; Mai/2016: Transferência de Administrador. | | | | | |
| Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos: | | | | | | |
| Principais riscos associados ao Fundo: | Risco de Crédito: Possibilidade do emissor de determinado título/valor mobiliário representativo de direito de crédito ou contraparte ou coobrigado em operações do FUNDO se tornar inadimplente. | | | | | |
| | Risco de Investimento em Créditos Privados: O FUNDO está sujeito a risco de perda substancial de seu patrimônio líquido em caso de eventos que acarretem o não pagamento dos ativos financeiros integrantes de sua CARTEIRA, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial dos emissores responsáveis pelos ativos financeiros do FUNDO. | | | | | |
| | Risco de Mercado: Possibilidade do valor dos ativos financeiros do FUNDO variar de acordo com condições econômicas ou de mercado. | | | | | |
| | Risco de Liquidez: Possibilidade do FUNDO não conseguir negociar seus ativos financeiros em determinadas situações ou somente negociá-los por preços inferiores. | | | | | |
| | Risco pela Utilização de Cota de Abertura: Considerando que o FUNDO utiliza cota de abertura, poderá ocorrer perda decorrente de volatilidade nos preços dos ativos que integram sua carteira. | | | | | |
| Risco de Concentração: A concentração dos ativos que compõem a carteira do FUNDO ou a do FUNDO INVESTIDO em um número reduzido de emissor(es), setor(es) ou prazo(s) de vencimento, pode aumentar a sua exposição aos riscos anteriormente mencionados, ocasionando volatilidade no valor de suas cotas. | | | | | | |
| 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 |
|-------------|------|----------------|-----------|--------|--------|-------------------------|
| 2023 | 2153 | 375.820.770,68 | 17,032011 | 12,24% | 13,05% | 93,78% |
| 2022 | 2213 | 442.295.286,38 | 15,175162 | 11,46% | 12,37% | 92,65% |
| 2021 | 2275 | 450.111.276,34 | 13,614450 | 3,80% | 4,40% | 86,46% |
| 2020 | 2540 | 429.800.237,88 | 13,116039 | 1,69% | 2,77% | 61,20% |
| 2019 | 2622 | 424.660.016,80 | 12,897584 | 5,09% | 5,97% | 85,22% |

Análise da Carteira do Fundo de Investimento

| Composição da carteira (atual) | Espécie de ativos | | % do PL |
|---|--|-----------------------------|---------------|
| | Operações Compromissadas Lastreadas em Títulos Públicos Federais | | 11,84% |
| | Depósitos a Prazo e Outros Títulos de Instituições Financeiras | | 32,35% |
| | Títulos Públicos Federais | | 53,94% |
| | | | |
| Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento | CNPJ Fundo(s) | Classificação Resolução CMN | % do PL |
| | 18.179.536/0001-81 | Não se aplica | 98,13% |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| Maiores emissores de títulos de crédito privado em estoque do Fundo | Emissor (CPF/CNPJ) | Tipo de Emissor | % do PL |
| | 28.195.667/0001-06 | Banco ABC S/A | 6,08% |
| | 60.746.948/0001-12 | Banco Bradesco S/A | 7,08% |
| | 62.232.889/0001-90 | Banco Daycoval S/A | 2,62% |
| | 90.400.888/0001-42 | Banco Santander S/A | 3,63% |
| | 30.306.294/0001-45 | Banco BTG Pactual | 7,81% |
| 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) | | | 24,80 meses |
| Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS | | | |
| Nota de Risco de Crédito | Agência de risco | | Nota |
| | Não se aplica | | Não se aplica |
| Análise conclusiva e comparativa com outros fundos: | | | |
| 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 |
| | | | |
| | | | |
| | | | |