

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	WA MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DOLAR FI MULT IE		CNPJ: 23.872.712/0001-04
Administrador	BNP Paribas	Nº Termo Cred.	CNPJ: 01.522.368/0001-82
Gestor	Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Limitada	Nº Termo Cred.	CNPJ: 07.437.241/0001-41
Custodiante	BNP Paribas		CNPJ: 01.522.368/0001-82

Classificação do Fundo Resolução CMN 4.963

Art. 7º, I, "b"		Art. 8º, II
Art. 7º, I, "c"		Art. 9º, I
Art. 7º, III, "a"	X	Art. 9º, II
Art. 7º, III, "b"		Art. 9º, III
Art. 7º, IV		Art. 10º, I
Art. 7º, V, "a"		Art. 10º, II
Art. 7º, V, "b"		Art. 10º, III
Art. 7º, V, "c"		Art. 11º
Art. 8º, I		

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	fev/24	http://www.westernasset.com.br/pt/products/rpps.cfm
2. Regulamento	mar/24	http://www.westernasset.com.br/pt/products/rpps.cfm
3. Lâmina de Informações essenciais	fev/24	http://www.westernasset.com.br/pt/products/rpps.cfm
4. Formulário de informações complementares	-	
5. Perfil Mensal	-	
6. Demonstração de Desempenho	dez/23	http://www.westernasset.com.br/pt/products/rpps.cfm
7. Relatórios de Rating	-	
8. Demonstrações Contábeis	-	

II.5 - Forma de Distribuição do Fundo (art. 3º, § 2º, II, da Portaria MPS nº 519/2011)

Nome/Razão Social do distribuidor:	Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Limitada
CPF/CNPJ:	07.437.241/0001-41
Informações sobre a Política de Distribuição:	A Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários possui política de distribuição para o segmento de RPPS que envolve distribuição direta, realizada pela própria empresa, e indireta, por terceiros, que varia conforme critérios definidos entre a Western Asset e esses parceiros.

Resumo das informações do Fundo de Investimento

Data de Constituição:	05/08/2016	Data de Início das Atividades:	05/08/2016
Objetivo de rentabilidade:	No Benchmark		
Política de Investimentos do Fundo	O FUNDO investirá, no mínimo, 67% dos seus recursos no FTGF WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES BOND FUND, administrado pela BNY Mellon Investment Servicing (International) Limited e gerido pela Franklin Templeton International Services, constituído, de acordo com as leis da Irlanda, como um grupamento de fundos com responsabilidade segregada entre estes, sendo considerado uma sociedade de investimento de capital aberto, variável e de responsabilidade limitada ("Macro Opportunities Bond Fund").		
Público-alvo:	O Fundo é destinado a investidores qualificados, podendo ser pessoas físicas ou pessoas jurídicas, EFPCs, RPPS, e/ou fundos de investimento cujos investidores buscam diversificação de seus investimentos em mercados no exterior, que sejam clientes do administrador ou dos distribuidores contratados pelo Fundo, e (i) possuam horizonte de investimento de longo prazo; (ii) entendam os riscos de investimentos no exterior; (iii) aceitem oscilações bruscas do valor das cotas, inclusive com possibilidade de perdas significativas de capital.		
Condições de Investimento (Prazos/ Condições para resgate)	Prazo de Duração do Fundo	Não há	
	Prazo de Carência (dias)	Não há	
	Prazo para Conversão de Cotas (dias)	D+1 du	
	Prazo para Pagamento dos Resgates (dias)	D+5 du	
	Prazo Total (dias)	5	
Condições de Investimento (Custos/Taxas)	Taxa de entrada (%)	Não há	
	Taxa de saída (%)	Não há	
	Taxa de administração (% a.a)	1,0000000000%	
	Taxa de Performance (% a.a)		
	Índice de referencia	Frequência	Linha-d'água
	N/A	N/A	N/A
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	Sim		
Alterações ocorridas relativas às instituições administradoras e gestoras do fundo:			
Análise de fatos relevantes divulgados:	Não aplicável		
Análise da aderência do fundo ao perfil da carteira do RPPS e à sua Política de Investimentos:			
Principais riscos associados ao Fundo:	Investimento no Exterior, Mercado, Liquidez, Restrição de Negociação dos Ativos, Operacional, Sistêmico, Evento, Regulatório, Enquadramento Fiscal, Derivativos, Contraparte.		

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
2024*	382	24.778.261,61	1.606,67202	-1,72%	N/A	-
2023	414	9.827.419,52	1.634,76639	3,13%	N/A	-
2022	626	66.414.632,25	1.585,15702	-25,65%	N/A	-
2021	1054	207.020.967,44	2.131,88563	6,37%	N/A	-
2020	1664	124.163.987,62	2.004,16916	34,29%	N/A	-

*Até Fevereiro de 2024

Análise da Carteira do Fundo de Investimento			
Composição da carteira (atual)	Espécie de ativos		% do PL
	Cotas de Fundos		99,36%
	Títulos Públicos Federais		0,64%
Caso o Fundo aplique em cotas de outros Fundos de Investimento	CNPJ Fundo(s)	Classificação Resolução CMN	% do PL
	1. 22.773.421/0001-98	Art. 7º, IV, "a"	2,46%
	2.		
	3.		
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		Sim	
Prazo médio da carteira de títulos do Fundo (em meses (30) dias)		-	
Compatibilidade do Fundo com as obrigações presentes e futuras do RPPS		-	
Nota de Risco de Crédito	Agência de risco		Nota
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

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