

TERMO DE ANÁLISE E ATESTADO DE CREDENCIAMENTO DE INSTITUIÇÃO

Ente Federativo: Cidade - Videira/SC - 83.039.842/0001-84

Unidade Gestora: Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Videira - 05.002.371/0001-26

42.040.639/0001-40 – Caixa DTVM

Número do Processo Administrativo: 015/2024

Tipo de Instituição: Gestor.

Data do Credenciamento: 29/05/2024

Validade: 2 anos

DADOS CADASTRAIS

Razão Social: CAIXA DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.

Data de Constituição: 14/04/2021

Endereço: AV PAULISTA, 2300, ANDAR 11 CONJ 112 E 114 CEP 01.310-300, São Paulo -SP

Contato: gerdi@caixa.gov.br - (11) 3572-4600

Endereço Eletrônico: <https://www.caixa.gov.br/caixa-asset/Paginas/default.aspx>

Registro na CVM: 27/09/2021 Distribuidoras, 31/08/2021 Prest. Serviços de Administração de Carteira

Registro no Banco Central: Sociedade Distribuidora de TVM

REGULARIDADE FISCAL E PREVIDENCIÁRIA

Certidão	Situação	Validade	Disponível em
Municipal	Regular	Em anexo.	https://duc.prefeitura.sp.gov.br/certidoes/forms_anonimo/frmConsultaEmissaoCertificado.aspx
Estadual	Regular	Em anexo.	https://www10.fazenda.sp.gov.br/CertidaoNegativaDeb/Pages/EmissaoCertidaoNegativa.aspx
Federal	Regular	Em anexo.	https://solucoes.receita.fazenda.gov.br/Servicos/certidaointernet/PJ/Emitir
FGTS	Regular	Em anexo.	https://consulta-crf.caixa.gov.br/consultacrf/pages/consultaEmpregador.jsf

ANÁLISE DA INSTITUIÇÃO

Decisão de investimentos

O presente documento tem a finalidade de avaliar unicamente a instituição alvo do processo de credenciamento. Para futura tomada de decisão de investimentos, deverão ser analisadas as necessidades e estratégias do RPPS, bem como as classes e categorias de fundos gerenciados pela instituição e seus respectivos riscos intrínsecos, o que será explorado no credenciamento pertinente ao fundo.

Embasamento em formulários de diligência previstos em códigos de autorregulação

A análise foi embasada no Questionário Due Diligence da Anbima, no Formulário de Referência, e informações públicas disponíveis na CVM e na rede mundial de computadores.

Estrutura e Segregação de Atividades

A CAIXA DTVM é subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL. A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL é uma empresa 100% pública, controlada pelo Governo Federal. Para mais detalhes, consulte o item 2.2 do Questionário Due Diligence. A CAIXA DTVM presta atualmente somente os serviços de gestão de Fundos de Investimento, e toda a gestão é independente, inclusive com uma mesa de operações própria. Os serviços de administração fiduciária, distribuição de fundos de investimento e custódia e controladoria são exercidos dentro da estrutura da controladora, CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, conforme abaixo: A VIART (VP Fundos de Investimento) é responsável pelos serviços de administração fiduciária e de custódia e controladoria. Trata-se de uma Vice-presidência inserida na estrutura organizacional da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, que é segregada das demais e que não integra o Conselho Diretor, conforme artigo 13, § 4º e artigo 28 do Estatuto da CAIXA. Dentro da Vice-presidência, as duas atividades são segregadas por Gerências Nacionais, sendo a atividade de Administração Fiduciária exercida pela GN Administração Fiduciária (GEAFI), e as atividades de custódia e controladoria exercidas pela GN Serviços Qualificados (GESEQ). A distribuição de fundos de

investimento é realizada pela controladora, por meio da sua rede de agências e conta com áreas especializadas no relacionamento e atendimento para nichos específicos.

Qualificação do corpo técnico

A estrutura é muito bem organizada e segmentada, com claras responsabilidades e controles. Em março de 2021, havia 256 funcionários, sendo 47 na equipe de investimento dos fundos tradicionais. A estrutura conta com um vice-presidente (CEO), dois diretores. De acordo com a documentação disponibilizada pela instituição, confirma-se que os profissionais diretamente relacionados à gestão de ativos de terceiros possuem experiência mínima de 5 anos na atividade.

A instituição está alinhada aos objetivos do RPPS quanto à independência na prestação dos serviços e ausência de potenciais conflitos de interesse nos termos do Art. 24 da Resolução CMN nº 4.963/2021?

Nas verificações realizadas, não foram localizados potenciais conflitos de interesse que desaconselhem um relacionamento seguro com a instituição. Os formulários de diligência avaliados descrevem a existência de segregação de atividades no funcionamento da organização. Ademais, a instituição possui uma área de compliance, que é responsável pela fiscalização das atividades, cumprimento das leis, normas e procedimentos internos.

CONCLUSÕES DA ANÁLISE PARA PREENCHIMENTO NO CADPREV

A instituição é autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil obrigada a instituir comitê de auditoria e de riscos, nos termos da regulamentação do Conselho Monetário Nacional (incisos I e II do parágrafo 2º do Art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021)?
Não.

Volume de recursos

Gerido: 510.382.270.000,00

A instituição se encontra em funcionamento normal junto à Comissão de Valores Mobiliários?

Sim.

Atos de registro ou autorização para funcionamento expedido por órgão competente

Registro na CVM: 27/09/2021 Distribuidoras, 31/08/2021 Prest. Serviços de Administração de Carteira

Registro no Banco Central: Sociedade Distribuidora de TVM

Observância de elevado padrão ético de conduta nas operações realizadas no mercado financeiro e ausência de restrições verificadas por órgãos competentes

A pesquisa de processos administrativos sancionadores registrados na CVM não retornou resultados. A pesquisa de processos administrativos sancionadores registrados no BACEN não retornou resultados. A consulta de multas e descumprimentos registrados na Anbima não retornou resultados. A instituição está livre de registros de suspensão ou de inabilitação na CVM e no Banco Central, de modo que não possui restrições que desaconselhem um relacionamento seguro.

Análise do histórico de atuação da instituição e de seus controladores

Atua há 3 anos no mercado. Possui R\$ 510.382.270.000,00 sob gestão. Seu rating de gestão de qualidade foi expedido pela Fitch com nota IMQR e perspectiva Excelente.

Verificação de experiência de atuação

Atua há 3 anos no mercado, conforme registro na CVM.

Análise de volume de recursos sob sua gestão e administração, da qualificação do corpo técnico e da segregação de atividades

Possui R\$ 510.382.270.000,00 sob gestão. O corpo técnico é adequado, com certificações reconhecidas no mercado financeiro e constituição de diversos comitês para tomadas de decisão.

Avaliação da aderência da rentabilidade aos indicadores de desempenho e riscos assumidos pelos fundos sob sua gestão e administração, no período mínimo de 2 (dois) anos anteriores ao credenciamento

Foram localizados 37 fundos geridos pela instituição:

00.834.074/0001-23 | Alpha de Jensen 24m: -6,2800 | Vol 24m: 0,0900 | Ret 24m: 20,1600
01.525.057/0001-77 | Alpha de Jensen 24m: -3,4800 | Vol 24m: 19,1600 | Ret 24m: 4,1000
03.737.188/0001-43 | Alpha de Jensen 24m: 0,9500 | Vol 24m: 5,7500 | Ret 24m: 21,9100
03.737.206/0001-97 | Alpha de Jensen 24m: 0,5500 | Vol 24m: 0,1200 | Ret 24m: 26,9900
03.737.217/0001-77 | Alpha de Jensen 24m: -5,5800 | Vol 24m: 19,7200 | Ret 24m: 1,7600
05.114.716/0001-33 | Alpha de Jensen 24m: -4,5800 | Vol 24m: 0,1000 | Ret 24m: 21,8600

05.164.356/0001-84 | Alpha de Jensen 24m: 0,0000 | Vol 24m: 0,1200 | Ret 24m: 26,4300
05.164.358/0001-73 | Alpha de Jensen 24m: -0,6000 | Vol 24m: 0,1000 | Ret 24m: 25,8300
05.164.364/0001-20 | Alpha de Jensen 24m: -0,1000 | Vol 24m: 0,1100 | Ret 24m: 26,3300
05.900.798/0001-41 | Alpha de Jensen 24m: 7,7900 | Vol 24m: 16,9800 | Ret 24m: 18,6900
08.046.355/0001-23 | Alpha de Jensen 24m: -9,1800 | Vol 24m: 19,6800 | Ret 24m: -1,7300
08.070.841/0001-87 | Alpha de Jensen 24m: -1,7900 | Vol 24m: 3,8700 | Ret 24m: 21,4600
10.577.503/0001-88 | Alpha de Jensen 24m: -3,8000 | Vol 24m: 8,0600 | Ret 24m: 19,0900
10.577.519/0001-90 | Alpha de Jensen 24m: 2,3100 | Vol 24m: 4,8900 | Ret 24m: 26,4900
10.646.885/0001-54 | Alpha de Jensen 24m: 0,4600 | Vol 24m: 0,1300 | Ret 24m: 26,8900
10.646.895/0001-90 | Alpha de Jensen 24m: -3,0100 | Vol 24m: 5,2600 | Ret 24m: 21,0500
10.740.658/0001-93 | Alpha de Jensen 24m: -2,8300 | Vol 24m: 5,1500 | Ret 24m: 21,2800
10.740.670/0001-06 | Alpha de Jensen 24m: -0,3000 | Vol 24m: 0,4500 | Ret 24m: 26,0100
11.060.913/0001-10 | Alpha de Jensen 24m: -2,6000 | Vol 24m: 2,3700 | Ret 24m: 22,8900
11.061.217/0001-28 | Alpha de Jensen 24m: -0,3900 | Vol 24m: 2,4300 | Ret 24m: 24,9000
13.058.816/0001-18 | Alpha de Jensen 24m: -0,3000 | Vol 24m: 19,2600 | Ret 24m: 7,1900
14.120.520/0001-42 | Alpha de Jensen 24m: 0,5300 | Vol 24m: 0,4800 | Ret 24m: 26,9300
14.386.926/0001-71 | Alpha de Jensen 24m: -3,3900 | Vol 24m: 2,5600 | Ret 24m: 22,1000
14.507.699/0001-95 | Alpha de Jensen 24m: -2,7900 | Vol 24m: 19,6600 | Ret 24m: 4,6100
14.508.605/0001-00 | Alpha de Jensen 24m: 1,6200 | Vol 24m: 3,2800 | Ret 24m: 26,5500
14.508.643/0001-55 | Alpha de Jensen 24m: -3,7500 | Vol 24m: 0,1000 | Ret 24m: 22,6900
15.154.220/0001-47 | Alpha de Jensen 24m: -24,3500 | Vol 24m: 25,8300 | Ret 24m: -19,3300
15.154.236/0001-50 | Alpha de Jensen 24m: -0,1800 | Vol 24m: 19,7900 | Ret 24m: 7,4900
15.154.441/0001-15 | Alpha de Jensen 24m: 3,9400 | Vol 24m: 17,3000 | Ret 24m: 14,3300
17.502.937/0001-68 | Alpha de Jensen 24m: -46,1600 | Vol 24m: 22,4100 | Ret 24m: -18,1000
23.215.008/0001-70 | Alpha de Jensen 24m: 0,7200 | Vol 24m: 0,1300 | Ret 24m: 27,1500
23.215.097/0001-55 | Alpha de Jensen 24m: -1,2400 | Vol 24m: 1,5500 | Ret 24m: 24,6400
30.036.235/0001-02 | Alpha de Jensen 24m: -11,5000 | Vol 24m: 19,6800 | Ret 24m: 7,1400
30.068.169/0001-44 | Alpha de Jensen 24m: 1,5800 | Vol 24m: 18,3300 | Ret 24m: 11,8100
30.068.224/0001-04 | Alpha de Jensen 24m: -12,1300 | Vol 24m: 19,5100 | Ret 24m: -3,5200
34.660.276/0001-18 | Alpha de Jensen 24m: 0,8400 | Vol 24m: 3,9200 | Ret 24m: 23,9900
35.536.532/0001-22 | Alpha de Jensen 24m: -1,7800 | Vol 24m: 1,6100 | Ret 24m: 24,0600

Não foram localizados fundos administrados pela instituição que sejam enquadrados para RPPS.

O Alfa de Jensen é uma medida do desempenho da fundo, indicando uma boa performance caso o coeficiente seja significativamente positivo; valores próximos de zero são neutros; e um coeficiente significativamente negativo aponta que o risco do fundo não tem se convertido em maiores retornos. A volatilidade é uma forma de representar o risco do fundo, medindo o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período. O retorno representa a rentabilidade do fundo no período.

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO

O Termo de Credenciamento é o documento pelo qual se formaliza a relação entre a unidade gestora do RPPS e a credenciada, demonstrando o cumprimento das condições de sua habilitação e aptidão para intermediar ou receber as aplicações dos recursos.A sua assinatura não estabelece obrigatoriedade de aplicação ou adesão a nenhum fundo de investimento ou ativo financeiro emitido, administrado, gerido ou distribuído pela credenciada.

Ao firmar a assinatura abaixo, os responsáveis pelo credenciamento atestam que revisaram as informações contidas neste documento e que julgam a instituição como apta a receber recursos do RPPS.

NOME	CARGO	CPF	ASSINATURA
Vilso Vanz	Presidente INPREVID		
Juliane Maria Colle Wartha	Membro Comitê Investimentos		
Wolmar Erdmann	Membro Comitê Investimentos		