

CREDENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 09.636.393/0001-07 - BNP Paribas Match Referenciado Crédito Privado

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7, V, b

Data do Termo: 01/03/2024

Conclusão do Credenciamento: Fundo enquadrado em relação à Resolução 4963/2021.

INSTITUIÇÕES

Administrador: 01.522.368/0001-82 - BNP Paribas Banco

Gestor: 02.562.663/0001-25 - BNP Paribas Asset

Art. 21º da Resolução 4963/2021: O administrador atende ao inciso I do parágrafo 2º.

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Data de Início: 02/04/2008

Índice de Referência: CDI

Carência: Não há

Prazo de Resgate: D+0

Categoria de Investidor: Geral

Taxa de Administração: 0,35%

Taxa de Performance: Não há

Investe em cotas de outros fundos: Não

Possui ativos de Emissores Privados: Sim

Não - *Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira*

Não - *Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registradas na CVM*

Não - *Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)*

Não - *Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC*

Não - *Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito*

Obs.: Informações referentes à 29/02/2024.

CONCLUSÃO DA ANÁLISE

Análise do regulamento e demais documentos disponibilizados pelo gestor do fundo de investimento e os riscos inerentes às operações previstas

Mínimo de 95% do PL do fundo deve ser investido em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa que acompanham, direta ou indiretamente, a variação do indicador de desempenho (benchmark) expresso na denominação do fundo. Adicionalmente, no mínimo 80% PL deve ser aplicado em: (i) títulos da dívida pública federal (ii) ativos financeiros de renda fixa considerados de baixo risco de crédito pelo gestor e (iii) cotas de fundos de índice que invistam preponderantemente nos ativos das alíneas i e ii acima e utilizem instrumentos derivativos apenas para proteção da carteira (hedge). O fundo fica sujeito ao risco sistêmico, decorrente de todo o mercado, ao risco referente aos ativos investidos pelo gestor. Há mais riscos que podem ser consultados no regulamento do fundo, mas o destaque cabe aos citados anteriormente.

Adequação das características do fundo frente às necessidades de liquidez do RPPS

O fundo possui liquidez em D+0.

Adequação da política de seleção, alocação e diversificação de ativos e, quando for o caso, a política de concentração de ativos

A composição da carteira está condizente com o regulamento e objetivo propostos.

Avaliação dos dados comparativos no que se refere aos custos, retorno e risco de fundos de investimento similares

O fundo objeto da análise foi comparado com 6 outros fundos, de mesmo benchmark (CDI) e enquadramento (7, V, b) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,35%, ficou abaixo da média de 0,49% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 13,11%, performou abaixo da média de 15,16%. Base de comparação:

14.171.644/0001-57 - BTG FIC Corporativo I Crédito Privado - Tx Adm: 0,50 - Rent 12M: 16,54

19.782.311/0001-88 - AZ Quest FIC Valore Crédito Privado - Tx Adm: 1,00 - Rent 12M: 15,78

35.648.999/0001-64 - SPX FIC Seahawk Advisory Crédito Privado - Tx Adm: 0,60 - Rent 12M: 15,35

06.866.051/0001-87 - BV Institucional Crédito Privado Renda Fixa - Tx Adm: 0,20 - Rent 12M: 14,72

17.138.474/0001-05 - Santander FIC Crédito Privado Institucional - Tx Adm: 0,30 - Rent 12M: 14,34

10.783.480/0001-68 - Daycoval Classic Crédito Privado - Tx Adm: 0,35 - Rent 12M: 14,21

Obs.: Rentabilidades com data de fechamento 29/02/2024.

Verificação da compatibilidade entre o objetivo de retorno do fundo de investimento, a política de investimento do fundo, o limite de risco divulgado pelo gestor, quando couber, e eventual adequação do parâmetro utilizado para a cobrança da taxa de performance

O fundo tem por objetivo acompanhar a variação do CDI. Embora a Gestora empregue toda a sua diligência e técnica no sentido de atingir este objetivo, não há garantia de que o desempenho do fundo supere continuamente o CDI. O fundo é um Fundo Referenciado, tendo como indicador de desempenho o CDI. Não há cobrança de taxa de performance.

Verificação das hipóteses de eventos de avaliação, amortização e liquidação, inclusive antecipada, quando aplicável

O fundo não possui carência para resgate. Sua liquidez é em D+0.

Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

Foram observados 5 fundos da gestora 02.562.663/0001-25, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 32.222.722/0001-87, 05.862.906/0001-39, 05.104.498/0001-56, 09.636.619/0001-61, 07.657.641/0001-62. Em matéria de performance, 3 ficaram acima do benchmark.

Em caso de fundos de investimento cujas carteiras sejam representadas, exclusivamente ou não, por cotas de outros fundos de investimento, deverá ser verificado que a carteira dos fundos investidos atende aos requisitos previstos em Resolução do CMN

Não se aplica.

PATRIMÔNIO LÍQUIDO E COTISTAS



PERÍODO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO		NÚMERO DE COTISTAS
Atual	15.754.636.811,81		225867
Médio em 12 meses	11.798.854.595,50		173250
Médio em 24 meses	7.576.758.486,71		110715

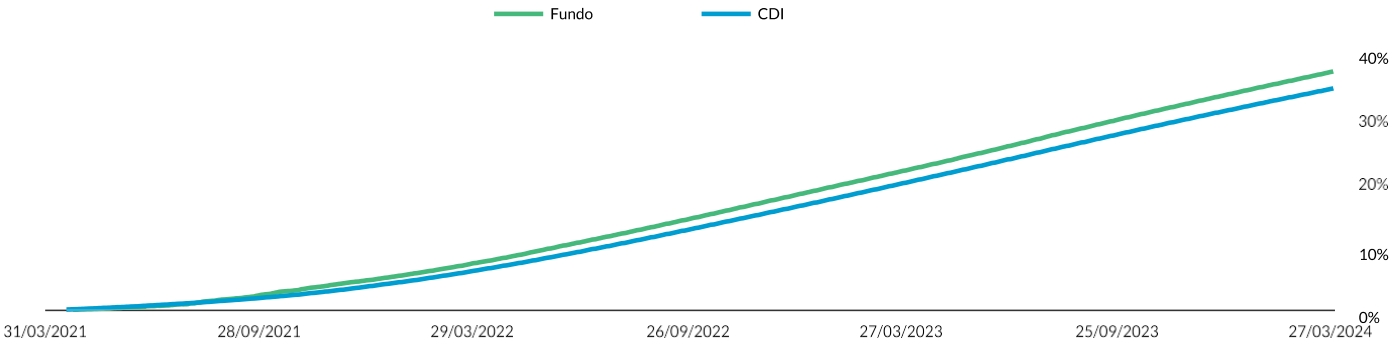
RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,80	0,80	1,01	0,88	1,16	1,08	1,07	1,21	1,11	1,06	1,07	1,16	13,13
CDI	0,73	0,75	0,92	0,83	1,03	1,01	1,03	1,17	1,07	1,02	1,02	1,12	12,37
% CDI	109,70	106,19	109,03	105,11	112,05	106,14	103,86	103,92	103,47	104,01	104,68	103,12	106,10

2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	1,15	0,90	1,18	0,91	1,15	1,11	1,13	1,18	1,01	1,02	0,94	0,92	13,37
CDI	1,12	0,92	1,17	0,92	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	13,05
% CDI	102,44	98,45	100,36	98,67	102,67	103,33	105,82	103,58	103,96	102,51	102,77	103,18	102,50

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,99	0,83											2,67
CDI	0,97	0,80											1,78
% CDI	102,83	102,94											150,07

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	12.276.325.670,52	83,20
Títulos Públicos	2.416.732.847,73	16,38
Operações Compromissadas	68.413.606,10	0,46
Disponibilidades	15.435,45	0,00
Valores a receber	14.399,63	0,00
Mercado Futuro - Posições vendidas	-133.713,00	0,00
Mercado Futuro - Posições compradas	-137.578,56	0,00
Valores a pagar	-5.459.886,66	-0,04

Obs.: Informações referentes à 31/01/2024.

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO

Ao assinar o Credenciamento, os responsáveis atestam que:

- Possuem 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;
- Este documento não representa garantia ou compromisso de alocação de recursos no fundo, 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 de Investimentos e ao perfil das obrigações presentes e futuras do RPPS.
- Estão cientes de que a rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura, e que não há qualquer tipo de garantia, implícita ou explícita, prestada pelo emissor deste relatório e/ou empresas coligadas, ou por qualquer mecanismo de seguro, ou ainda pelo Fundo Garantidor de Crédito.

NOME	CPF	ASSINATURA
Igor Fretta Nogueira de Lima	049.436.369-00	Assinado eletronicamente por: Igor Fretta Nogueira de Lima CPF: ***.436.369-** Data: 10/04/2024 18:51:50 -03:00
Alessandra Cristina Hoehn	869.080.659-87	Assinado eletronicamente por: Alessandra Hoehn CPF: ***.080.659-** Data: 10/04/2024 15:41:09 -03:00



MANIFESTO DE ASSINATURAS



Código de validação: XHZ8L-6GG62-L5FTX-EQEDT

Esse documento foi assinado pelos seguintes signatários nas datas indicadas (Fuso horário de Brasília):

- ✓ Alessandra Hoehn (CPF ***.080.659-**) em 10/04/2024 15:41 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.181	Não disponível
Autenticação	Navegantes
Aplicação externa	
XQ1rAOWfxY378p1ZTH8tfbZfhFTaJ9NwSZESWzesvZ8=	
SHA-256	

- ✓ Igor Fretta Nogueira de Lima (CPF ***.436.369-**) em 10/04/2024 18:51 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.182	Lat: -26,896775 Long: -48,646572
	Precisão: 15 (metros)
Autenticação	igor.lima@navegantesprev.sc.gov.br
Email verificado	
RAhxEf/uhyceGuHaCVE5UmpXhYo3sSOO24syXjFIQcw=	
SHA-256	

Para verificar as assinaturas, acesse o link direto de validação deste documento:

<https://assinador.silosign.com.br/validate/XHZ8L-6GG62-L5FTX-EQEDT>

Ou acesse a consulta de documentos assinados disponível no link abaixo e informe o código de validação:

<https://assinador.silosign.com.br/validate>