

CRENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 10.756.685/0001-54 - Próprio Capital FIA

Segmento: Renda Variável

Tipo de Ativo: Fundos de Investimento em Ações - Art. 8, I

Data do Termo: 01/03/2024

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

INSTITUIÇÕES

Administrador: 62.232.889/0001-90 - Daycoval Banco

Gestor: 13.993.865/0001-48 - Próprio Capital

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

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Data de Início: 22/05/2013

Índice de Referência: Ibovespa

Carência: Não há

Prazo de Resgate: D+3

Categoria de Investidor: Geral

Taxa de Administração: 2,80%

Taxa de Performance: 20% exc Ibovespa

Investe em cotas de outros fundos: Não

Possui ativos de Emissores Privados: Não

CONCLUSÃO DA ANÁLISE

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

O fundo poderá aplicar seus recursos em quaisquer ativos financeiros permitidos pela legislação aplicável devendo observar para tanto os limites previstos no regulamento. No mínimo 67% da carteira do fundo deve ser composta pelos seguintes ativos financeiros: (a) ações admitidas à negociação em mercado organizado (b) bônus ou recibos de subscrição e certificados de depósito de ações admitidas à negociação em mercado organizado (c) cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e (d) Brazilian Depositary Receipts classificados como nível II e III. 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+3.

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 (Ibovespa) e enquadramento (8, 1) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 2,80%, ficou acima da média de 1,82% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 26,78%, performou abaixo da média de 43,49%. Base de comparação:

38.280.883/0001-03 - Guepardo FIC FIA Valor Institucional - Tx Adm: 1,90 - Rent 12M: 50,26

46.450.512/0001-50 - Tarpon FIC FIA GT Institucional II - Tx Adm: 2,00 - Rent 12M: 50,22

35.726.741/0001-39 - Tarpon FIC FIA GT Institucional I - Tx Adm: 2,00 - Rent 12M: 49,41

39.346.123/0001-14 - Tarpon FIC FIA GT Institucional - Tx Adm: 2,00 - Rent 12M: 49,36

42.814.825/0001-90 - Itaú FIC FIA Inflation Equity Opportunities - Tx Adm: 1,00 - Rent 12M: 30,87

30.068.169/0001-44 - Caixa FIC FIA Ações Livre Quantitativo - Tx Adm: 2,00 - Rent 12M: 30,84

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 objetivo do fundo é, a longo prazo, buscar a valorização dos capitais investidos pelos cotistas, observadas as regras legais e regulamentares em vigor, mediante aplicação de recursos em carteira diversificada de títulos e valores mobiliários. A taxa de performance é de 20% exc Ibov.

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+3.

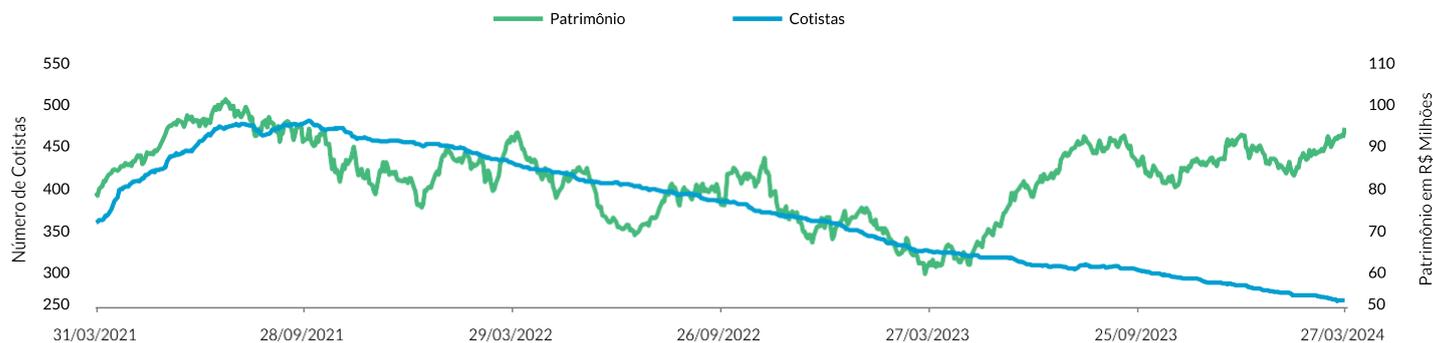
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

Não foram localizados outros fundos da gestora 13.993.865/0001-48, do mesmo segmento e enquadrados para RPPS.

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	94.911.797,95	268
Médio em 12 meses	83.440.960,22	299
Médio em 24 meses	79.841.119,93	341

RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	5,78	-2,90	7,43	-6,23	1,72	-14,93	4,44	7,08	1,97	5,05	-10,00	-2,17	-5,56
Ibovespa	6,98	0,89	6,06	-10,10	3,22	-11,50	4,69	6,16	0,47	5,45	-3,06	-2,45	4,69
/= Ibovespa	-1,20	-3,79	1,37	3,87	-1,50	-3,43	-0,25	0,91	1,50	-0,40	-6,94	0,28	-10,25

2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	4,67	-12,01	-5,04	5,43	11,71	8,90	9,60	-5,06	-3,71	-7,06	8,87	6,28	20,87
Ibovespa	3,37	-7,49	-2,91	2,50	3,74	9,00	3,27	-5,09	0,71	-2,94	12,54	5,38	22,28
/= Ibovespa	1,30	-4,52	-2,13	2,92	7,98	-0,10	6,34	0,03	-4,42	-4,12	-3,67	0,90	-1,41

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	-6,77	3,61											0,21
Ibovespa	-4,79	0,99											-3,85
/= Ibovespa	-1,97	2,61											4,06

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Ações	77.485.884,00	90,07
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	7.834.350,00	9,11
Operações Compromissadas	777.776,00	0,90
Valores a receber	266.848,00	0,31
Disponibilidades	1.000,00	0,00
Valores a pagar	-340.898,44	-0,40

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 18:55:48 -03:00
Alessandra Cristina Hoehn	869.080.659-87	Assinado eletronicamente por: Alessandra Hoehn CPF: ***.080.659-** Data: 10/04/2024 15:43:18 -03:00



MANIFESTO DE ASSINATURAS



Código de validação: 5PNS5-R8JF8-85NAG-8964C

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

- ✓ Alessandra Hoehn (CPF *****.080.659-****) em 10/04/2024 15:43 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.181	Não disponível
Autenticação	Navegantes
Aplicação externa	
ma3BG0eD5B1MZA5m9VRbMZWvWIMGS7Z5/sZA5ft/28Q=	
SHA-256	

- ✓ Igor Fretta Nogueira de Lima (CPF *****.436.369-****) em 10/04/2024 18:55 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.182	Lat: -26,896771 Long: -48,646571
	Precisão: 24 (metros)
Autenticação	igor.lima@navegantesprev.sc.gov.br
Email verificado	
nA1zdrYPdpgWfNrMHi/oKf/xPGI2Nrkle6RsawHCj48=	
SHA-256	

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

<https://assinador.silosign.com.br/validate/5PNS5-R8JF8-85NAG-8964C>

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

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