

TERMO DE ANÁLISE E ATESTADO DE CREDENCIAMENTO DE INSTITUIÇÃO

Ente Federativo: Cidade – 83.102.855/0001-50

Unidade Gestora: Nome do RPPS – 14.823.518/0001-30

93.026.847/0001-26 – Bannisul Corretora

Número do Processo Administrativo:

Tipo de Instituição: Administrador; Gestor; Custodiante;

Data do Credenciamento: 02.04.2024

Validade: 2 anos

DADOS CADASTRAIS

Razão Social: BANRISUL SA CORRETORA DE VALORES MOBILIARIOS E CAMBIO

Data de Constituição: 26/07/1971

Endereço: Rua Caldas Junior, 108, Centro, CEP 90010-260, Porto Alegre - RS

Contato: leandro_rodrigues@banrisul.com.br - (51) 3215-2878

Endereço Eletrônico: <https://www.banrisulcorretora.com.br/lxa/link/home.html>

Registro na CVM: 24/05/2017: Administrador Fiduciário e Gestor de Carteira, 15/05/2014: Custodiante

Registro no Banco Central: Sociedade Corretora de TVM

REGULARIDADE FISCAL E PREVIDENCIÁRIA

Certidão	Situação	Validade	Disponível em
Municipal	Regular	25/05/2024	https://siat.procempa.com.br/siat/ArrSolicitarCertidaoGeralDebTributarios_Internet.do
Estadual	Regular	23/06/2024	https://www.sefaz.rs.gov.br/sat/CertidaoSitFiscalSolic.aspx
Federal	Regular	22/10/2024	https://solucoes.receita.fazenda.gov.br/Servicos/certidaointernet/PJ/Emitir
FGTS	Regular	14/05/2024	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 Bannisul Corretora atua na gestão de recursos de Fundos de Investimento, Fundos de Investimento em Cotas, Fundo de Aposentadoria Programada Individual e Carteiras Administradas e, a partir de 04/01/2021, atua também na atividade de administração fiduciária destas carteiras. As atividade de administração de carteiras de valores mobiliários seguem as atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico da Bannisul Corretora. É distribuída entre Diretoria de Gestão de Recursos de Terceiros, Diretoria de Administração de Recursos de Terceiro, Diretoria de Controle e Risco, Gerência de Gestão de Recursos de Terceiros, Gerência de Administração Fiduciária, Núcleo de Controle e Compliance e Núcleo de Gestão de Riscos, Comitê de Recursos de Terceiros, Comitê de Investimentos e Comitê Fiduciário.

Qualificação do corpo técnico

O corpo técnico é adequado, com certificações reconhecidas no mercado financeiro e constituição de diversos comitês para tomadas de decisão. 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.

O administrador de fundo de investimento detém no máximo 50% dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social?

De acordo com o formulário de referência, o percentual de recursos administrados provenientes de RPPS eram de 33,07%.

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?

A instituição faz parte da lista exaustiva publicada pela SPREV, de modo que ela cumpre os requisitos do inciso I, parágrafo 2º do Art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021, o que ocasiona uma redução dos riscos envolvidos, inclusive os possíveis conflitos de interesse. Por conseguinte, entende-se que a instituição está em conformidade com o Art. 24 da referida Resolução.

Descrição dos serviços em que a instituição está sendo credenciada

A instituição está sendo credenciada como custodiante de Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras enquadrados no Art. 7º, IV da Resolução CMN 4.963/2021.

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)?

Sim.

Volume de recursos

Gerido: 16.284.019.299,13 Administrado: 16.284.019.299,13

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: 24/05/2017: Administrador Fiduciário e Gestor de Carteira, 15/05/2014: Custodiante

Registro no Banco Central: Sociedade Corretora 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 sancionados registrados na CVM 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 7 anos no mercado. Possui R\$ 16.284.019.299,13 sob gestão e R\$ 16.284.019.299,13 sob administração. Seu rating de gestão de qualidade foi expedido pela Austin com nota QG3+ e perspectiva Estável.

Verificação de experiência de atuação

Atua há 7 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\$ 16.284.019.299,13 sob gestão e R\$ 16.284.019.299,13 sob administração. 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 18 fundos geridos pela instituição:

00.743.026/0001-20 | Alpha de Jensen 24m: -3,8700 | Vol 24m: 0,0800 | Ret 24m: 23,4800

01.353.260/0001-03 | Alpha de Jensen 24m: -5,3200 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 22,0300

01.822.655/0001-08 | Alpha de Jensen 24m: -0,4400 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 26,9100

02.131.725/0001-44 | Alpha de Jensen 24m: -6,7700 | Vol 24m: 18,7800 | Ret 24m: 5,5700

02.430.487/0001-78 | Alpha de Jensen 24m: -5,3800 | Vol 24m: 0,0900 | Ret 24m: 21,9800

04.828.795/0001-81 | Alpha de Jensen 24m: -0,4700 | Vol 24m: 2,2400 | Ret 24m: 25,9000

08.960.978/0001-07 | Alpha de Jensen 24m: -0,4900 | Vol 24m: 0,1100 | Ret 24m: 26,8600
10.199.934/0001-58 | Alpha de Jensen 24m: -2,5400 | Vol 24m: 16,2500 | Ret 24m: 12,7500
11.311.874/0001-86 | Alpha de Jensen 24m: -1,0900 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 26,2500
16.844.885/0001-45 | Alpha de Jensen 24m: 0,2800 | Vol 24m: 3,1000 | Ret 24m: 26,3100
16.844.890/0001-58 | Alpha de Jensen 24m: -2,7700 | Vol 24m: 4,8900 | Ret 24m: 22,5000
18.466.245/0001-74 | Alpha de Jensen 24m: -0,7100 | Vol 24m: 0,3700 | Ret 24m: 26,5300
21.007.180/0001-03 | Alpha de Jensen 24m: -4,2100 | Vol 24m: 2,3300 | Ret 24m: 22,3000
21.743.480/0001-50 | Alpha de Jensen 24m: -0,1400 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 27,2100
23.863.573/0001-44 | Alpha de Jensen 24m: -2,8600 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 24,4900
33.863.652/0001-09 | Alpha de Jensen 24m: -2,8000 | Vol 24m: 1,7300 | Ret 24m: 23,4400
88.198.056/0001-43 | Alpha de Jensen 24m: -6,6500 | Vol 24m: 19,4900 | Ret 24m: 7,3300
97.261.093/0001-40 | Alpha de Jensen 24m: -15,0500 | Vol 24m: 19,4900 | Ret 24m: -2,6400

Foram localizados 18 fundos administrados pela instituição:

00.743.026/0001-20 | Alpha de Jensen 24m: -3,8700 | Vol 24m: 0,0800 | Ret 24m: 23,4800
01.353.260/0001-03 | Alpha de Jensen 24m: -5,3200 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 22,0300
01.822.655/0001-08 | Alpha de Jensen 24m: -0,4400 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 26,9100
02.131.725/0001-44 | Alpha de Jensen 24m: -6,7700 | Vol 24m: 18,7800 | Ret 24m: 5,5700
02.430.487/0001-78 | Alpha de Jensen 24m: -5,3800 | Vol 24m: 0,0900 | Ret 24m: 21,9800
04.828.795/0001-81 | Alpha de Jensen 24m: -0,4700 | Vol 24m: 2,2400 | Ret 24m: 25,9000
08.960.978/0001-07 | Alpha de Jensen 24m: -0,4900 | Vol 24m: 0,1100 | Ret 24m: 26,8600
10.199.934/0001-58 | Alpha de Jensen 24m: -2,5400 | Vol 24m: 16,2500 | Ret 24m: 12,7500
11.311.874/0001-86 | Alpha de Jensen 24m: -1,0900 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 26,2500
16.844.885/0001-45 | Alpha de Jensen 24m: 0,2800 | Vol 24m: 3,1000 | Ret 24m: 26,3100
16.844.890/0001-58 | Alpha de Jensen 24m: -2,7700 | Vol 24m: 4,8900 | Ret 24m: 22,5000
18.466.245/0001-74 | Alpha de Jensen 24m: -0,7100 | Vol 24m: 0,3700 | Ret 24m: 26,5300
21.007.180/0001-03 | Alpha de Jensen 24m: -4,2100 | Vol 24m: 2,3300 | Ret 24m: 22,3000
21.743.480/0001-50 | Alpha de Jensen 24m: -0,1400 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 27,2100
23.863.573/0001-44 | Alpha de Jensen 24m: -2,8600 | Vol 24m: 0,0700 | Ret 24m: 24,4900
33.863.652/0001-09 | Alpha de Jensen 24m: -2,8000 | Vol 24m: 1,7300 | Ret 24m: 23,4400
88.198.056/0001-43 | Alpha de Jensen 24m: -6,6500 | Vol 24m: 19,4900 | Ret 24m: 7,3300
97.261.093/0001-40 | Alpha de Jensen 24m: -15,0500 | Vol 24m: 19,4900 | Ret 24m: -2,6400

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
IGOR FRETTA NOGUEIRA DE LIMA	Dir. Presidente/Membro Comitê de Investimentos	049.436.369-00	Assinado eletronicamente por: Igor Fretta Nogueira de Lima CPF: ***.436.369-** Data: 18/07/2024 15:29:00 -03:00
ALESSANDRA CRISTINA HOEHN	Presidente do Comitê de Investimentos	869.080.659-87	Assinado eletronicamente por: Alessandra Hoehn CPF: ***.080.659-** Data: 08/08/2024 16:37:28 -03:00
RAFAEL CASTRO	Secretário do Comitê de Investimentos	045.401.579-81	Assinado eletronicamente por: Rafael Castro CPF: ***.401.579-** Data: 22/07/2024 16:50:25 -03:00
GEISE NAIARA PINTO FELTRIN	Membro Comitê de Investimentos	065.250.159-10	Assinado eletronicamente por: Geise Naiara Pinto CPF: ***.250.159-** Data: 12/08/2024 13:21:09 -03:00
GISELE DE OLIVEIRA FERNANDES	Membro Comitê de Investimentos	976.888.000-72	Assinado eletronicamente por: Gisele de Oliveira Fernandes CPF: ***.888.000-** Data: 18/07/2024 16:50:57 -03:00
NOME	CARGO	CPF	
IGOR FRETTA NOGUEIRA DE LIMA	Dir. Presidente/Membro Comitê de Investimentos	049.436.369-00	

Esse documento foi assinado por Igor Fretta Nogueira de Lima, Gisele de Oliveira Fernandes, Rafael Castro, Alessandra Hoehn e Geise Naiara Pinto. Para validar o documento e suas assinaturas acesse <https://assinador.silosign.com.br/validate/WQ2F6-ZPQTT-GWW2H-2QVEU>





MANIFESTO DE ASSINATURAS



Código de validação: WQ2F6-ZPQTT-GWW2H-2QVEU

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

- ✓ Igor Fretta Nogueira de Lima (CPF ***.436.369-**) em 18/07/2024 15:29 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.182	Lat: -26,875184 Long: -48,663965 Precisão: 2480 (metros)
Autenticação	igor.lima@navegantesprev.sc.gov.br
Email verificado	
QNK5o5lczZKPWCNWacUth/P/hMTxV7lhvmLOaCfCYIU=	
SHA-256	

- ✓ Gisele de Oliveira Fernandes (CPF ***.888.000-**) em 18/07/2024 16:06 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.176	Não disponível
Autenticação	gisele.fernandes@n...antesprev.sc.gov.br
Email verificado	
UcykEOfyJrTr2YB1VJTRE7WvgBSYXoTFjSJpZ0eYax8=	
SHA-256	

✓ Rafael Castro (CPF *****.401.579-****) em 22/07/2024 16:50 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.178	Lat: -26,896484 Long: -48,646519 Precisão: 500 (metros)
Autenticação	rafael.castro@navegantesprev.sc.gov.br
Email verificado	
LIBvYgx4cEtx6pY7Sp4WK/dapQZHcCNVJZ+/QcHBzOI=	
SHA-256	

✓ Alessandra Hoehn (CPF *****.080.659-****) em 08/08/2024 16:37 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.181	Não disponível
Autenticação	Navegantes
Aplicação externa	
EuRa4nQ61whfofWQCd1bLEXOT6uCx+jZ+3z20iyusnY=	
SHA-256	

✓ Geise Naiara Pinto (CPF *****.250.159-****) em 12/08/2024 13:21 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
138.94.220.66	Lat: -26,984144 Long: -48,656443 Precisão: 4534 (metros)
Autenticação	Navegantes
Aplicação externa	
tiauiCgyf6osQw5XCFJB/kjE7otsObftLjKgF6oSXD4=	
SHA-256	

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

<https://assinador.silosign.com.br/validate/WQ2F6-ZPQTT-GWW2H-2QVEU>

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

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