

## 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

**40.430.971/0001-96 – Itaú Unibanco Asset**

**Número do Processo Administrativo:** 050-A

**Tipo de Instituição:** Gestor;

**Data do Credenciamento:** 01/05/2023      **Validade:** 2 anos

### DADOS CADASTRAIS

**Razão Social:** ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

**Data de Constituição:** 17/01/2021

**Endereço:** Av. Faria Lima 3500, 4º andar, CEP 04538-132, São Paulo - SP

**Contato:** atendimentoasset@itau-unibanco.com.br - (11) 3631-2659

**Endereço Eletrônico:** <https://www.itauassetmanagement.com.br/>

**Registro na CVM:** 28/06/2021 Gestor de Carteira

### REGULARIDADE FISCAL E PREVIDENCIÁRIA

Certidão	Situação	Validade	Disponível em
Municipal	Regular	03/10/2024	<a href="https://duc.prefeitura.sp.gov.br/certidoes/forms_anonimo/frmConsultaEmissaoCertificado.aspx">https://duc.prefeitura.sp.gov.br/certidoes/forms_anonimo/frmConsultaEmissaoCertificado.aspx</a>
Estadual	Regular	15/07/2024	<a href="https://www10.fazenda.sp.gov.br/CertidaoNegativaDeb/Pages/EmissaoCertidaoNegativa.aspx">https://www10.fazenda.sp.gov.br/CertidaoNegativaDeb/Pages/EmissaoCertidaoNegativa.aspx</a>
Federal	Regular	13/07/2024	<a href="https://solucoes.receita.fazenda.gov.br/Servicos/certidaointernet/PJ/Emitir">https://solucoes.receita.fazenda.gov.br/Servicos/certidaointernet/PJ/Emitir</a>
FGTS	Regular	11/02/2024	<a href="https://consulta-crf.caixa.gov.br/consultacrf/pages/consultaEmpregador.jsf">https://consulta-crf.caixa.gov.br/consultacrf/pages/consultaEmpregador.jsf</a>

### 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 Itaú Asset Management exerce a gestão de fundos de investimento e carteiras administradas. Sua estrutura administrativa é constituída pelas seguintes diretorias e comitês: Diretoria Global Asset Management, Diretoria de Controle de Risco de Mercado e Liquidez, Diretoria de Risco Operacional, Diretoria de Compliance Corporativo e PLD, Diretoria de Produtos e Soluções à Investidores, Comitê de Crédito Asset, Comitê de Corretora WMS, Comitê de Produtos, Comitê de Compliance e Risco Operacional e Comitê de Risco Asset.

#### 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.

**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: 851.755.290.771,13 Administrado: 774.168.310.444,42

**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: 28/06/2021 Gestor de Carteira

**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, 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\$ 851.755.290.771,13 sob gestão e R\$ 774.168.310.444,42 sob administração. Seu rating de gestão de qualidade foi expedido pela S&P com nota AMP-1 e perspectiva Muito Forte.

**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\$ 851.755.290.771,13 sob gestão e R\$ 774.168.310.444,42 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 32 fundos geridos pela instituição:

00.832.435/0001-00 | Alpha de Jensen 24m: 1,3600 | Vol 24m: 0,1400 | Ret 24m: 27,7900  
00.973.117/0001-51 | Alpha de Jensen 24m: 0,6700 | Vol 24m: 0,3500 | Ret 24m: 27,0000  
01.063.897/0001-65 | Alpha de Jensen 24m: -21,3400 | Vol 24m: 23,0600 | Ret 24m: -14,2000  
02.887.290/0001-62 | Alpha de Jensen 24m: 5,3200 | Vol 24m: 17,5000 | Ret 24m: 15,2400  
04.764.174/0001-81 | Alpha de Jensen 24m: 0,3400 | Vol 24m: 0,1800 | Ret 24m: 26,7300  
05.073.656/0001-58 | Alpha de Jensen 24m: -3,9300 | Vol 24m: 5,5900 | Ret 24m: 19,9500  
05.903.152/0001-18 | Alpha de Jensen 24m: 1,3000 | Vol 24m: 0,3100 | Ret 24m: 27,7300  
06.175.696/0001-73 | Alpha de Jensen 24m: -0,1200 | Vol 24m: 0,1000 | Ret 24m: 26,3200  
08.703.063/0001-16 | Alpha de Jensen 24m: -0,3600 | Vol 24m: 0,4500 | Ret 24m: 26,0800  
09.093.819/0001-15 | Alpha de Jensen 24m: -2,7200 | Vol 24m: 2,3700 | Ret 24m: 22,7600  
09.093.883/0001-04 | Alpha de Jensen 24m: 1,9900 | Vol 24m: 0,1900 | Ret 24m: 28,4300  
10.396.381/0001-23 | Alpha de Jensen 24m: 1,1900 | Vol 24m: 3,2900 | Ret 24m: 26,1200  
10.474.513/0001-98 | Alpha de Jensen 24m: -3,0000 | Vol 24m: 5,1200 | Ret 24m: 21,1200  
14.437.684/0001-06 | Alpha de Jensen 24m: -3,6000 | Vol 24m: 8,1400 | Ret 24m: 19,2500  
16.718.302/0001-30 | Alpha de Jensen 24m: -31,4700 | Vol 24m: 21,0400 | Ret 24m: -23,3800  
21.838.150/0001-49 | Alpha de Jensen 24m: -2,1600 | Vol 24m: 3,1200 | Ret 24m: 22,8800  
23.731.629/0001-07 | Alpha de Jensen 24m: -27,6100 | Vol 24m: 21,6400 | Ret 24m: -20,7500  
24.571.992/0001-75 | Alpha de Jensen 24m: -16,5000 | Vol 24m: 18,2500 | Ret 24m: -5,8400

26.269.692/0001-61 | Alpha de Jensen 24m: -11,5600 | Vol 24m: 19,6600 | Ret 24m: 7,0900  
 31.217.153/0001-19 | Alpha de Jensen 24m: -50,9100 | Vol 24m: 20,0200 | Ret 24m: -20,3800  
 32.246.546/0001-13 | Alpha de Jensen 24m: -20,3400 | Vol 24m: 20,7400 | Ret 24m: -13,1700  
 32.254.420/0001-90 | Alpha de Jensen 24m: -8,9500 | Vol 24m: 1,1600 | Ret 24m: 17,3300  
 32.922.086/0001-04 | Alpha de Jensen 24m: -3,5900 | Vol 24m: 2,6100 | Ret 24m: 21,8700  
 32.972.942/0001-28 | Alpha de Jensen 24m: -1,5500 | Vol 24m: 0,8100 | Ret 24m: 24,6600  
 35.727.449/0001-30 | Alpha de Jensen 24m: -57,7400 | Vol 24m: 16,4900 | Ret 24m: -22,5400  
 35.727.513/0001-83 | Alpha de Jensen 24m: -62,9400 | Vol 24m: 17,6700 | Ret 24m: -27,1800  
 35.727.628/0001-78 | Alpha de Jensen 24m: -46,6500 | Vol 24m: 24,2700 | Ret 24m: -18,4200  
 35.727.655/0001-40 | Alpha de Jensen 24m: -52,3700 | Vol 24m: 18,6600 | Ret 24m: -22,0500  
 35.727.674/0001-77 | Alpha de Jensen 24m: -59,2800 | Vol 24m: 19,1000 | Ret 24m: -31,2500  
 35.727.696/0001-37 | Alpha de Jensen 24m: -50,8700 | Vol 24m: 16,3800 | Ret 24m: -17,3100  
 35.727.715/0001-25 | Alpha de Jensen 24m: -60,6800 | Vol 24m: 16,8200 | Ret 24m: -27,4400  
 37.306.507/0001-88 | Alpha de Jensen 24m: -42,4300 | Vol 24m: 19,3900 | Ret 24m: -13,3200

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
<b>IGOR FRETTA NOGUEIRA DE LIMA</b>	Dir. Presidente/Membro Comitê de Investimentos	049.436.369-00	
<b>ALESSANDRA CRISTINA HOEHN</b>	Presidente do Comitê de Investimentos	869.080.659-87	
<b>RAFAEL CASTRO</b>	Secretário do Comitê de Investimentos	045.401.579-81	
<b>GEISE NAIARA PINTO FELTRIN</b>	Membro Comitê de Investimentos	065.250.159-10	
<b>GISELE DE OLIVEIRA FERNANDES</b>	Membro Comitê de Investimentos	976.888.000-72	