

CRENCIAMENTO DE FUNDO

DADOS CADASTRAIS

Fundo: 13.396.703/0001-22 - Vinci Valorem Multimercado

Segmento: Fundos Estruturados

Tipo de Ativo: Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I

Data do Termo: 01/03/2024

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

INSTITUIÇÕES

Administrador: 00.066.670/0001-00 - BEM DTVM

Gestor: 13.421.810/0001-63 - Vinci Gestão

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

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Data de Início: 07/08/2012

Índice de Referência: IMA-B 5+

Carência: Não há

Prazo de Resgate: D+2

Categoria de Investidor: Geral

Taxa de Administração: 0,96%

Taxa de Performance: 20% exc IMA-B 5

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 tem por objetivo buscar retorno aos seus Cotistas através de investimentos em diversas classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial e derivativos, negociados nos mercados internos, sem compromisso de concentração em nenhuma classe específica

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

O fundo possui liquidez em D+2.

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 outro fundo, de mesmo benchmark (IMA-B 5+) e enquadramento (10, I) simultaneamente. Sua taxa de administração, de 0,96%, ficou com a mesma média de 0,96% na base de comparação. A rentabilidade 12M, de 9,93%, performou igual a média de 9,93%. Base de comparação:

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

De acordo com seu objetivo de investimento, o Fundo não possui compromisso de concentração em nenhum fator de risco específico, sendo assim, poderá incorrer nos seguintes fatores de risco: taxa de juros pós-fixadas, taxa de juros pré-fixadas, índices de preço, variação cambial, derivativos. O Fundo tem por objetivo proporcionar aos seus Cotistas rentabilidade no longo prazo através de investimentos em ativos de renda fixa que superem o Índice de Mercado ANBIMA, subdivisão "B 5" (IMA-B 5).

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

O fundo não possui carência para resgate. Sua liquidez é D+2.

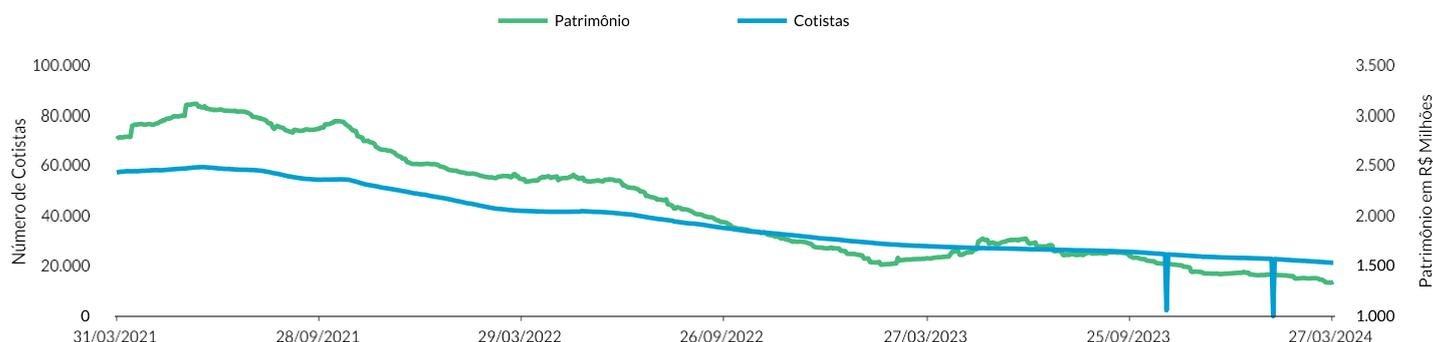
Verificação do histórico de performance do gestor em relação à gestão do fundo de investimento e de demais fundos por ele geridos

Foram observados 3 fundos da gestora 13.421.810/0001-63, enquadrados para RPPS, em uma janela de 12 meses: 15.603.945/0001-75, 19.587.174/0001-20, 51.415.957/0001-30. Em matéria de performance, 1 ficou 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	1.348.795.638,09	21523
Médio em 12 meses	1.558.720.280,57	25096
Médio em 24 meses	1.763.306.110,58	30379

RENTABILIDADE HISTÓRICA (%)

2022	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,75	0,99	2,45	1,79	0,65	0,47	0,00	0,20	0,55	1,41	0,05	0,13	9,81
IMA-B 5+	-1,61	0,01	3,56	0,08	1,16	-1,10	-1,84	2,49	2,39	0,65	-1,18	-1,19	3,30
% IMA-B 5+	-46,73	999,99	68,76	999,99	55,73	-42,30	0,05	8,09	22,83	216,82	-4,04	-10,97	297,49

2023	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	1,13	1,44	1,54	0,76	1,48	1,27	1,02	0,49	-0,48	0,28	0,81	1,47	11,80
IMA-B 5+	-1,26	1,17	3,73	3,03	4,13	3,37	0,73	-1,27	-1,92	-0,98	3,39	3,94	19,28
% IMA-B 5+	-89,58	123,71	41,34	25,22	35,89	37,81	140,01	-39,05	24,82	-28,96	23,83	37,27	61,22

2024	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
Fundo	0,52	0,35											1,48
IMA-B 5+	-1,47	0,51											-0,96
% IMA-B 5+	-35,24	68,88											-153,93

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVO	POSIÇÃO R\$	% DA CARTEIRA
Títulos Públicos	1.307.446.971,47	92,01
Operações Compromissadas	115.278.720,28	8,11
Opções - Posições titulares	303.321,00	0,02
Mercado Futuro - Posições compradas	167.479,00	0,01
Valores a receber	19.790,43	0,00
Disponibilidades	1.000,00	0,00
Mercado Futuro - Posições vendidas	-48.311,00	0,00
Opções - Posições lançadas	-66.030,00	0,00
Valores a pagar	-2.070.507,56	-0,15

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: 08/04/2024 16:28:42 -03:00
Alessandra Cristina Hoehn	869.080.659-87	Assinado eletronicamente por: Alessandra Hoehn CPF: ***.080.659-** Data: 08/04/2024 16:25:44 -03:00



MANIFESTO DE ASSINATURAS



Código de validação: 94UFW-27WVM-GUN3M-9GSZ7

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

- ✓ Alessandra Hoehn (CPF *****.080.659-****) em 08/04/2024 16:25 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.181	Não disponível
Autenticação	Navegantes
Aplicação externa	
HyoCWIoG/DwfBsdChRL407hEe5mz/CRwVW7gMWAoiCY=	
SHA-256	

- ✓ Igor Fretta Nogueira de Lima (CPF *****.436.369-****) em 08/04/2024 16:28 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.182	Lat: -26,896760 Long: -48,646563
	Precisão: 20 (metros)
Autenticação	igor.lima@navegantesprev.sc.gov.br
Email verificado	
Kvbe6ytMGgz33SjzJate1QpufTIBzLfWsHguJ4ogIOW=	
SHA-256	

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

<https://assinador.silosign.com.br/validate/94UFW-27WVM-GUN3M-9GSZ7>

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

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