

TERMO DE ANÁLISE E ATESTADO DE CREDENCIAMENTO DE INSTITUIÇÃO

Ente Federativo: Navegantes/SC – 83.102.855/0001-50

Unidade Gestora: NAVEGANTESPREV – 14.823.518/0001-30

72.027.832/0001-02 – Daycoval Asset

Número do Processo Administrativo: 041

Tipo de Instituição: Gestor;

Data do Credenciamento: 06/12/2023 Validade: 2 anos

DADOS CADASTRAIS

Razão Social: DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRACAO DE RECURSOS LTDA

Data de Constituição: 13/09/1993

Endereço: Avenida Paulista, 1793, 2º andar, Bela Vista, CEP: 01311-200, São Paulo - SP

Contato: karina.lima@bancodaycoval.com.br - (11) 3138-0530

Endereço Eletrônico: <https://www.daycoval.com.br/Asset>

Registro na CVM: 02/12/2004 Prest. Serviços de Administração de Carteiras

REGULARIDADE FISCAL E PREVIDENCIÁRIA

Certidão	Situação	Validade	Disponível em
Municipal	Regular	20/02/2024	https://duc.prefeitura.sp.gov.br/certidoes/forms_anonimo/frmConsultaEmissaoCertificado.aspx
Estadual	Regular	16/07/2024	https://www10.fazenda.sp.gov.br/CertidaoNegativaDeb/Pages/EmissaoCertidaoNegativa.aspx
Federal	Regular	14/07/2024	https://solucoes.receita.fazenda.gov.br/Servicos/certidaointernet/PJ/Emitir
FGTS	Regular	09/02/2024	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

O Conglomerado financeiro Daycoval possui como principais empresas, o Banco Daycoval, Daycoval Asset e Daycoval Leasing. A Daycoval Asset é administrada por uma diretoria executiva e sob seu comando estão as diretorias de risco, gestão de recursos e de administração fiduciária. Já os comitês estabelecidos são os de governança, riscos e compliance; de marcação a mercado e liquidez; de risco e de crédito; operacional de investimentos (fundos exclusivos e de terceiros, de renda variável e de multimercado). A Daycoval Asset exerce atividades de administração fiduciária e gestão de carteiras de valores mobiliários, conforme regulamentação vigente. Na gestão de carteiras de valores mobiliários, a Daycoval Asset exerce atividades de gestão de fundos de investimento e está habilitada para exercer a gestão de recursos de carteiras administradas.

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: 13.511.540.374,61

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: 02/12/2004 Prest. Serviços de Administração de Carteiras

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 retornou 1 resultado. A consulta de multas e descumprimentos registrados na Anbima retornou 0 e 3 resultados, respectivamente. 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 20 anos no mercado. Possui R\$ 13.511.540.374,61 sob gestão. Seu rating de gestão de qualidade foi expedido pela Moody's com nota MQ2 e perspectiva Muito boa.

Verificação de experiência de atuação

Atua há 20 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\$ 13.511.540.374,61 sob gestão. 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 5 fundos geridos pela instituição:

09.274.058/0001-06 | Alpha de Jensen 24m: -3,4300 | Vol 24m: 1,4600 | Ret 24m: 22,6700

10.783.480/0001-68 | Alpha de Jensen 24m: 0,6600 | Vol 24m: 0,4000 | Ret 24m: 27,0700

12.672.120/0001-14 | Alpha de Jensen 24m: -3,4600 | Vol 24m: 2,3800 | Ret 24m: 22,0100

13.155.995/0001-01 | Alpha de Jensen 24m: -4,3800 | Vol 24m: 19,8900 | Ret 24m: 2,7800

34.658.753/0001-00 | Alpha de Jensen 24m: -45,8500 | Vol 24m: 21,8500 | Ret 24m: -17,8100

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
Igor Fretta Nogueira de Lima	Diretor Presidente	049.436.369-00	Assinado eletronicamente por: Igor Fretta Nogueira de Lima CPF: ***.436.369-** Data: 27/03/2024 13:57:32 -03:00
Alessandra Cristina Hoehn	Assessora Financeira	869.080.659-87	Assinado eletronicamente por: Alessandra Hoehn CPF: ***.080.659-** Data: 26/03/2024 13:55:59 -03:00

Esse documento foi assinado por Alessandra Hoehn e Igor Fretta Nogueira de Lima. Para validar o documento e suas assinaturas acesse <https://assinador.sifosign.com.br/validar/RBYTD-89PHW-CBKTJ-XFXFN>





MANIFESTO DE ASSINATURAS



Código de validação: RBYTD-89PHW-CBKTJ-XFXFN

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

- ✓ Alessandra Hoehn (CPF ***.080.659-**) em 26/03/2024 13:55 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.181	Não disponível
Autenticação	Navegantes
Aplicação externa	
bA8qTpV4eOuPJMgk5gm6zS6u/23C1ElcVBs0vuWWSLA=	
SHA-256	

- ✓ Igor Fretta Nogueira de Lima (CPF ***.436.369-**) em 27/03/2024 13:57 - Assinado eletronicamente

Endereço IP	Geolocalização
201.55.107.182	Lat: -26,879590 Long: -48,657203
	Precisão: 3398 (metros)
Autenticação	igor.lima@navegantesprev.sc.gov.br
Email verificado	
LUaJlrWKguxrYgb6AknTrOE26/ldJhRXerVQaDaFpvs=	
SHA-256	

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

<https://assinador.silosign.com.br/validate/RBYTD-89PHW-CBKTJ-XFXFN>

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

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