

## TERMO DE ANÁLISE E ATESTADO DE CREDENCIAMENTO DE INSTITUIÇÃO

Ente Federativo: Barra Velha – SC – 83.102.830/0001-57

Unidade Gestora: Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Barra Velha SC - IPREVE

CNPJ:03.937.163/0001-93

**72.027.832/0001-02 – Daycoval Asset**

Número do Processo Administrativo: 0018/2025

Tipo de Instituição: Intermediário; Custodiante

Data do Credenciamento: 08/12/2025

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  | 26/04/2026 | <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  | 04/06/2026 | <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  | 03/06/2026 | <a href="https://servicos.receitafederal.gov.br/servico/certidoes/#/home">https://servicos.receitafederal.gov.br/servico/certidoes/#/home</a>   |
| FGTS      | Regular  | 28/12/2025 | <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, e informações públicas disponíveis na CVM e na rede mundial de computadores.

#### Estrutura e Segregação de Atividades

A Daycoval Asset exerce a atividade de gestão discricionária de recursos, administrando carteiras de valores mobiliários e fundos de investimento líquidos e estruturados, em conformidade com a regulamentação aplicável. 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 Operacional de Investimentos - Renda Variável, Comitê Operacional de Investimentos - Multimercado, Comitê de Crédito Privado, Comitê Operacional de Investimentos - Fundos Exclusivos, Comitê Operacional de Investimentos - Fundos Estruturados, Comitê Operacional de Investimentos - FOFs, Comitê Executivo de Governança, Riscos e Compliance e Comitê Executivo de Risco de Mercado e Liquidez.



1 / 3

### 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: 20.681.705.085,73      Administrado: 79.112.353.313,34

**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 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 21 anos no mercado. Possui R\$ 20.681.705.085,73 sob gestão e R\$ 79.112.353.313,34 sob administração. Seu rating de gestão de qualidade foi expedido pela Moodys com nota MQ1.br e perspectiva Excelente.

### Verificação de experiência de atuação

Atua há 21 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\$ 20.681.705.085,73 sob gestão e R\$ 79.112.353.313,34 sob administração. O corpo técnico é adequado, com certificações reconhecidas no mercado financeiro e constituição de diversos comitês para tomadas de decisão.

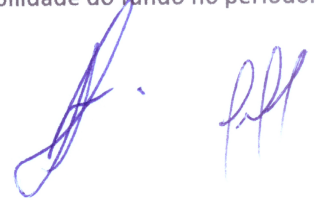
**Avaliação da aderência da rentabilidade aos indicadores de desempenho e riscos assumidos pelos fundos sob sua gestão e administração, no período mínimo de 2 (dois) anos anteriores ao credenciamento**

Foram localizados 5 fundos geridos pela instituição:

09.274.058/0001-06 | Alpha de Jensen 24m: -4,0800 | Vol 24m: 1,2100 | Ret 24m: 20,9100  
10.783.480/0001-68 | Alpha de Jensen 24m: 2,8800 | Vol 24m: 0,1800 | Ret 24m: 28,0400  
12.672.120/0001-14 | Alpha de Jensen 24m: -6,7800 | Vol 24m: 2,1000 | Ret 24m: 17,7700  
13.155.995/0001-01 | Alpha de Jensen 24m: -4,7600 | Vol 24m: 13,9100 | Ret 24m: 11,6000  
34.658.753/0001-00 | Alpha de Jensen 24m: 39,7200 | Vol 24m: 17,5200 | Ret 24m: 64,7400

Não foram localizados fundos administrados pela instituição que sejam enquadrados para RPPS.

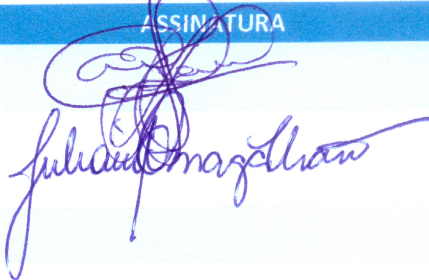
O Alfa de Jensen é uma medida do desempenho do fundo, indicando uma boa performance caso o coeficiente seja significativamente positivo; valores próximos de zero são neutros; e um coeficiente significativamente negativo aponta que o risco do fundo não tem se convertido em maiores retornos. A volatilidade 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  |
|----------------------------|--|----------------|---|
| Edivaldo Navarro Cachoeira | Diretor<br>Presidente                      | 622.657.509-30 |  |
| Juliane da Silva Magalhães | Diretora<br>Administrativa e<br>Financeira | 069.487.229-62 |   |
|                            |  |                |   |
|                            |  |                |   |
|                            |  |                |   |
|                            |  |                |   |