

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

62.232.889/0001-90 – Daycoval Banco

Número do Processo Administrativo: 01/2023

Tipo de Instituição: Administrador; Distribuidor; Emissor; Intermediária; Custodiante;

Data do Credenciamento: 25/07/2023

Validade: 2 anos

DADOS CADASTRAIS

Razão Social: BANCO DAYCOVAL S.A.

Data de Constituição: 19/11/1968

Endereço: Av. Paulista, 1793, CEP 01311-200, São Paulo - SP

Contato: ri@bancodaycoval.com.br -

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

Registro na CVM: 06/12/2019 Administrador Fiduciário, 17/03/2020 Administradores de Fundos de Investimento Imobiliários, 18/05/1989 Bancos Múltiplos com Carteira de Investimento, 18/01/2010 Administrador de fundo FIDC, 11/05/2005 Custodiante de Valores Moniliários

Registro no Banco Central: Banco Múltiplo

REGULARIDADE FISCAL E PREVIDENCIÁRIA

Certidão	Situação	Validade	Disponível em
Municipal	Indisponível	-	https://duc.prefeitura.sp.gov.br/certidoes/forms_anonimo/frmConsultaEmissaoCertificado.aspx
Estadual	Regular	07/09/2024	https://www10.fazenda.sp.gov.br/CertidaoNegativaDeb/Pages/EmissaoCertidaoNegativa.aspx
Federal	Regular	18/06/2024	https://solucoes.receita.fazenda.gov.br/Servicos/certidaointernet/PJ/Emitir
FGTS	Regular	26/01/2024	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 Formulário de Referência, e informações públicas disponíveis na CVM e na rede mundial de computadores.

Estrutura e Segregação de Atividades

O Banco Daycoval na qualidade de administrador fiduciário presta serviços de administração fiduciária, controladoria, custódia, tesouraria, escrituração e INR. Atua também na distribuição de ativos e fundos de investimentos. A administração do Banco Daycoval é feita pelo Conselho de Administração e pela Diretoria do Banco. Além deles são estabelecidos os comitês de Remuneração e Auditoria para administração do banco.



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 administração 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 informações da instituição, menos de 50% dos recursos administrados são oriundos de RPPS.

Os ativos financeiros de renda fixa ofertados estão em conformidade com as regras estabelecidas em normas do Banco Central do Brasil?

Em se tratando da atuação como emissor de ativos de renda fixa, indiferente aos ativos que porventura venham a ser ofertados pelo emissor, o RPPS poderá aportar somente em ativos que estejam em conformidade com o inciso IV do Art. 7º da Resolução CMN nº 4.963/2021.

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 de custódia 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 e Títulos Públicos de Emissão do Tesouro Nacional enquadrados no Art. 7º, I, da Resolução CMN 4.963/2021.

Informações sobre a política de distribuição

Na atividade de Distribuição, o Daycoval é autorizado perante o Banco Central do Brasil e pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM) a realizar a distribuição de valores mobiliários, e participados mercados administrados pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão, devendo observar o disposto na Instrução CVM 505 e Resolução CVM 30, além de todas as demais regulamentações vigentes que tratam sobre o tema de distribuição. A remuneração do Daycoval pela Distribuição de Produtos de Investimentos Fundos de Investimento: rebate sobre a taxa de administração e performance. Renda Fixa: (i) mercado secundário: spread sobre a taxa de repasse do papel (compra ou venda); (ii) oferta primária (ICVM 400 e 476): comissão por distribuição conforme acordo de adesão à oferta, caso a caso.

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

Administrado: 50.000.996.883,68

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: 06/12/2019 Administrador Fiduciário, 17/03/2020 Administradores de Fundos de Investimento Imobiliários, 18/05/1989 Bancos Múltiplos com Carteira de Investimento, 18/01/2010 Administrador de fundo FIDC, 11/05/2005 Custodiante de Valores Moniliários
Registro no Banco Central: Banco Múltiplo

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 36 resultados, respectivamente. 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 quase 5 anos no mercado. Possui R\$ 50.000.996.883,68 sob administração. Seu rating de gestão de qualidade foi expedido pela S&P com nota brAA+ e perspectiva Estável.

Verificação de experiência de atuação

Atua há quase 5 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\$ 50.000.996.883,68 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 9 fundos administrados pela instituição:

07.899.238/0001-40 | Alpha de Jensen 24m: -21,3500 | Vol 24m: 23,8300 | Ret 24m: -16,8000

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

10.756.685/0001-54 | Alpha de Jensen 24m: -7,7200 | Vol 24m: 25,3200 | Ret 24m: -3,0000

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

35.726.741/0001-39 | Alpha de Jensen 24m: 38,9800 | Vol 24m: 20,1900 | Ret 24m: 51,3600

38.280.883/0001-03 | Alpha de Jensen 24m: 28,4200 | Vol 24m: 21,7000 | Ret 24m: 37,0200

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
Edivaldo Navarro Cachoeira	Diretor Presidente	622.657.509-30	
Juliane da Silva Magalhães	Diretora Administrativa e Financeira	069.487.229-62	