



PREV-LAJE

**INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO
MUNICÍPIO DE LAJE DO MURIAÉ/RJ**

EDITAL PARA CREDENCIAMENTO DE GESTORES E ADMINISTRADORES DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS, INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS QUE ATUEM COMO INTERMEDIADORES EM NEGOCIAÇÕES COM TÍTULOS PÚBLICOS E OU QUE PARTICIPEM EM OPERAÇÕES COMPROMISSADAS E CONSULTORES DE VALORES MOBILIÁRIOS QUE ATUEM JUNTO AOS RPPS – REGIMES PRÓPRIOS DE PREVIDÊNCIA SOCIAL.

PREV-LAJE – INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE LAJE DO MURIAÉ, Autarquia Pública Municipal, devidamente inscrita no CNPJ sob o nº 08.876.702/0001-45, situada na Praça Padre Martins, nº 128, Altos, Centro, Laje do Muriaé-RJ, CEP: 28.350-000, neste Ato Representada por sua Diretora Presidente, **MARIA DO SOCORRO ARRAIS MENDES**, brasileira, casada, servidora pública municipal, portadora da Carteira de Identidade nº 08532444-0, expedida pelo IFP, devidamente cadastrada no CPF sob o nº 032.460.917-57, residente e domiciliada no Sítio Areia Branca, s/nº - Zona Rural, Laje do Muriaé/RJ., CEP: 28.350-000, torna público através do presente instrumento, as **condições mínimas para credenciamento**, previstas no Inciso II do Parágrafo 2º do Artigo 15 da Resolução CMN 3922/10, bem como do previsto no Inciso IX do Artigo 3º da Portaria MPS 519/11 (alterada pela Portaria 170/12) para: **Gestores e Administradores** de FI - Fundos de Investimentos em cotas ou FIC de FI – Fundo de Investimentos em Cotas de Fundos de Fundos de Investimentos e ou FIDC - Fundo de Investimentos em Direitos Creditórios e ou FIC de FIDC, **Instituições Financeiras** que operem na intermediação de negociações de Títulos Públicos Federais e ou que assumam operações compromissadas e **Consultorias de Investimentos** que atuem junto aos RPPS – Regimes Próprios de Previdência Social.

1 – Do Objetivo do Credenciamento.

O Objetivo do credenciamento é estabelecer parâmetros mínimos a serem oferecidos pelos prestadores de serviços acima elencados, (dentre estes parâmetros: a solidez patrimonial da entidade, a compatibilidade desta com o volume de recursos e a experiência positiva no exercício da atividade de administração de recursos de terceiros).



1.1– Etapas do Credenciamento:

As empresas interessadas em operar com o **PREV-LAJE – INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE LAJE DO MURIAÉ** nas modalidades objeto deste credenciamento deverão:

- a) Apresentar Ato de Constituição da empresa: Contrato Social vigente e suas alterações, se for empresa formada por quotistas (limitada) ou Ata da Assembleia se for vinculada a Lei das Sociedades Anônimas;
- b) Em se tratando de Instituição Financeira, apresentar gerenciamento de risco nos termos do Acordo da Basileia;
- c) Apresentar Certidão Negativa de Débitos de tributos nos termos da Lei 8666/93;
- d) Apresentar Prova de Inscrição no Cadastro Nacional de Pessoa Jurídica (CNPJ);
- e) Apresentar Prova de Inscrição Municipal;
- f) No caso de Gestores e Administradores de Carteira de Valores Mobiliários, apresentar Ato Declaratório da CVM – Comissão de Valores Mobiliários;
- g) No caso de Instituição Financeira apresentar autorização para funcionamento concedido pelo Banco Central do Brasil.
- h) No caso de Consultoria de Valores Mobiliários apresentar: Credenciamento na CVM como Consultor de Valores Mobiliários e Diploma conferido pela APIMEC – Associação de Profissionais de Mercado de Capitais como Analista de Investimentos como forma de atendimento ao previsto na CVM;
- i) Declaração da pessoa jurídica ou da empresa uniprofissional de que cumpre o previsto no inciso XXXIII do Artigo 7º da Constituição Federal.

Seção I – Critérios Qualitativos

2 – Das Condições de Participação:

Para participar do credenciamento deverão ser observados no mínimo os seguintes pontos em conjunto:

- a) **Gestores e Administradores de fundos de investimentos:**
 1. Credenciamento na CVM – Comissão de Valores Mobiliários nos termos da Instrução CVM 306/92;
 2. Constar nome das pessoas físicas responsáveis no sítio da CVM;
 3. Constar a razão social dos proponentes no sítio da CVM;
 4. Não estarem – pessoa física e jurídica - cumprindo penalidade e nem respondendo no ato do cadastro, a processo administrativo.
 5. A empresa possui Código de Ética;
 6. A empresa possui Manual de *Compliance* (Aderência as Normas)



7. Possuir área técnica própria ou terceirizada;
8. A empresa é aderente ao Código de Auto-regulação ao Código da ANBIMA para Regulação de Fundos de Investimentos. Caso resposta negativa, explique o porquê;
9. A empresa Possui Manual de marcação a Mercado dos fundos de investimentos dos quais faz a gestão/administração;
10. Caso a empresa opera com créditos privados nos seus produtos de investimentos, descreva o critério de *Chinese Wall*, para segregação da atividade de originação de recebíveis da atividade de gestão/administração;
11. A gestora/Administradora faz uso de Consultoria ou Analista de Investimento como assessoramento na gestão. Em caso de resposta positiva, e ainda que esta consultoria seja a mesma que presta serviços aos RPPS, como é feita a segregação de funções de modo a evitar o conflito de interesse entre a gestão dos fundos de investimentos e consultoria prestada aos RPPS.
12. A gestora administradora produz relatório de conjuntura econômica ou relatório sobre a razão da *performance* dos ativos sob gestão destinados aos cotistas;
13. Se a empresa já possui mais de um ano do início de suas atividades como gestor e ou como administrador, apresentar relatório de boa qualidade de gestão e de ambiente de controle interno de segregação de funções, cedida por empresa de gerenciamento de risco com sede no País. No caso da empresa possuir menos de um ano do início de suas atividades até a data deste cadastramento, este item deve ser informado como: Não há dados disponíveis.

b) Instituições Financeiras intermediadoras em negociação de Títulos Públicos Federais e ou assumir operações compromissadas:

1. Ter autorização para funcionamento pelo Banco Central do Brasil;
2. Tanto os Diretores responsáveis como a pessoa jurídica não estar respondendo a processo administrativo e nem encontrar-se sob o regime de intervenção extrajudicial;
3. Possuir contrato para realização de operações de Títulos Públicos Federais em Plataformas Eletrônicas de negociação, detalhando quais são as metodologias operacionais;
4. Possuir Contrato com Banco Central e ANBIMA para operar em conta Segregada no Selic – Sistema Especial de Liquidação e Custódia.

c) Consultoria de Valores Mobiliários:

1. Ter autorização da CVM para atuar como Consultor de Valores Mobiliários;
2. Ter autorização da CVM com exame de proficiência realizado pela APIMEC – Associação dos Analistas e Profissionais de Investimento do Mercado de Capitais para atuar como Analista de Investimentos;
3. Ter certificação pela ANBIMA como CPA-20;
4. Ter formação de nível superior em administração de empresas, economia ou matemática;



5. Ter Mestrado em Administração de Empresas ou em Economia;
6. Ter especialização em riscos de investimentos por órgão renomado no mercado financeiro e de capitais;
7. Ter artigos publicados em revista de circulação nacional e ou periódicos acadêmicos;
8. Estar em plenas condições de participar de certame licitatório previsto na Lei Federal 8666/93 e suas alterações.
9. Ter atuário cadastro no IBA - Instituto Brasileiro de Atuária como funcionário fixo na empresa sob regime de CLT – Consolidação das Leis do Trabalho e que atue em período integral;
10. Deter o *Know How* (domínio) sobre as técnicas de imunização do passivo atuarial – ALM – *Assets Management Liabilities*. (Gerenciamento de Ativos e Passivos);
11. Deter o *Know How* (domínio) para elaboração da Carteira utilizando a Técnica da relação Risco/Retorno desenvolvida por *Henry Markovich*, a Fronteira Eficiente.
12. Elaborar Relatórios de Gestão de Risco de Mercado (*VaR e Sharpe*);
13. Elaborar Relatórios de Gestão de Risco de Crédito (*Rating*).

Seção II – Critérios Quantitativos

4 – Quanto aos Gestores e Administradores de Fundos de Investimentos serão observados, como forma de pontuação os seguintes critérios:

- a) Qual o patrimônio sob gestão;
- b) Do patrimônio sob gestão, qual percentual é tomado por RPPS;
- c) Com relação aos produtos de investimentos geridos, qual sua *performance* em relação ao *benchmark* escolhido;
- d) Quantos e quais são os produtos de investimentos sob gestão.

5 – Quanto as Instituições Financeiras Intermediadoras nas negociações em Títulos e Valores Mobiliários e ou que assumam operações compromissadas:

1. Qual o volume transacionado em Títulos Públicos Federais no Selic – Sistema Especial de Liquidação e Custódia envolvendo RPPS;
2. Qual o volume transacionado em Títulos Públicos em plataforma eletrônica (CETIP-NET ou outra) envolvendo RPPS.



6 – Quanto a Consultoria de Investimentos:

- a) Ter comprovadamente um mínimo de 30 (trinta) RPPS como clientes em no mínimo 5 (cinco) Estados da Federação na área de consultoria de investimentos;
- b) Ter no mínimo 5 (cinco) anos de experiência comprovada de atuação na área de mercado financeiro e de capitais como empregado ou sócio de instituição financeira;
- c) Ter como clientes no mínimo 30 (trinta) RPPS na área de consultoria atuarial;
- d) Ter realizado estudo de ALM – *Asset Liabilities Management* – Estudo de Casamento de Ativos e Passivos – para no mínimo 30 (trinta) RPPS.

Seção III – Entrega dos Documentos

7 – Os documentos deverão ser entregues na sede do Instituto na sua forma original ou cópia autenticada no seguinte endereço: situada na Praça Padre Martins, nº 128, Altos, Centro, Laje do Muriaé-RJ, CEP: 28.350-000.

Seção IV – Das Disposições Gerais

8 – Os critérios de julgamento da habilitação para que o proponente preste algum serviço ao PREV-LAJE – INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE LAJE DO MURIAÉ serão únicos e internos, cabendo a suas instâncias superiores o aceite ou não da instituição proponente;

9 – PREV-LAJE – INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE LAJE DO MURIAÉ se desobriga de explicar e ou detalhar as razões para não habilitação de qualquer proponente.

10 – A habilitação não obriga de forma alguma que o PREV-LAJE – INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE LAJE DO MURIAÉ venha a realizar qualquer operação financeira ou contrato de prestação de serviços com a empresa habilitada.

11 – Os documentos entregues para o critério de seleção, não serão em hipótese alguma devolvidos, mesmo no caso do proponente não vir a ser habilitado.

12 – Poderão ser solicitados novos documentos e ou informações que por ventura a Comissão Avaliadora entender pertinente. A ausência desta informação adicional pode incorrer na não habilitação do proponente.

Laje do Muriaé, 12 de fevereiro de 2015.

MARIA DO SOCORRO ARRAIS MENDES
PRESIDENTE PREV-LAJE