

TERMO DE ANÁLISE DE CREDENCIAMENTO ADMINISTRADOR OU GESTOR DE FUNDO DE INVESTIMENTO

Número do Termo de Análise de Credenciamento	001/2022
Número do Processo (Nº protocolo ou processo)	28614/2022

I - REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL – RPPS

Ente Federativo	Município de Toledo – PR	CNPJ	76.205.806/0001-88
Unidade Gestora do RPPS	Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – FAPES/TOLEDOPREV	CNPJ	08.885.045/0001-00

Possui critérios preestabelecidos para credenciamento ou alocação de recursos do RPPS? (X) SIM () NÃO

1. Tipo de ato normativo/edital *Edital 001/2021* Data *08/06/2021*

2. Critérios:

Estarão impedidos de participar de qualquer fase do processo interessados que estão em caráter de suspensão temporária imposta por qualquer órgão da Administração Pública ou que sejam considerados como inidôneos em qualquer esfera de Governo ou ainda que estejam sob intervenção, falência, dissolução ou liquidação ou deixar de apresentar ou disponibilizar os documentos e informações, no que couber necessários ao credenciamento.

Para Instituições financeiras gestoras e cogestoras de carteiras de fundos de investimentos será exigido um Patrimônio sob Gestão de, no mínimo, R\$ 5.000.000.000,00 (cinco bilhões de reais), de acordo com o Ranking ANBIMA.

A Instituição deverá ser filiada à ANBIMA – Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiros e de Capitais ou ser aderente ao Código de Regulação e Melhores Práticas para Fundo de Investimentos.

II - Instituição a ser credenciada:

Administrador:			Gestor:	X
Razão Social	Bahia AM Renda Variável Ltda.	CNPJ	13.143.849/0001-66	
Endereço	Avenida Barão de Tefe, 34 Salas 1601 e 1602 Saúde Rio de Janeiro-RJ CEP: 20.220-460.	Data Constituição	24/11/2009	
E-mail (s)	rendavariavel@bahiaasset.com.br	Telefone (s)	(21) 3733-7277	
Data do registro na CVM	16/06/2011	Categoria (s)	Gestor de Carteira	
Data do registro no BACEN		Categoria (s)		
Principais contatos com RPPS		Cargo	E-mail	Telefone
Lauter Ferreira		Comercial	rpps@xpi.com.br	(11) 3027-2377
Eduardo Reichert		Comercial	rpps@xpi.com.br	(11) 3757-0864

Atende ao previsto nos incisos I e II do § 2º do art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021?

SIM NÃO

II.1 - Relação dos documentos referentes à análise da Instituição (art. 6º-E, III, Portaria MPS nº 519/2011):

Identificação do documento analisado	Data do doc.	Data de validade das certidões*	Página da internet em que o documento foi consultado ou disponibilizado pela instituição
1. Ato Registro CVM ou BACEN	16/06/2011		Disponibilizado pela Instituição
2. Cartão CNPJ	22/06/2022		Disponibilizado pela Instituição
3. Ato constitutivo, Estatuto ou Contrato Social	25/03/2021		Disponibilizado pela Instituição
4. Certificado de Regularidade do FGTS -CRF	13/06/2022	12/07/2022	Disponibilizado pela Instituição
5. Certidão da Fazenda Municipal	09/02/2022	08/08/2022	Disponibilizado pela Instituição
6. Certidão da Fazenda Estadual ou Distrital	21/06/2022	19/09/2022	Disponibilizado pela Instituição
7. Certidão de Débitos relativos a Créditos Tributários Federais e à Dívida Ativa da União	20/06/2022	17/12/2022	Disponibilizado pela Instituição
8. Certidão Negativa ou Positiva com Efeito de Negativa de Débitos trabalhistas	22/06/2022	19/12/2022	Disponibilizado pela Instituição
9. Certidão Negativa de Falência ou Concordada	22/06/2022	21/11/2022	Disponibilizado pela Instituição

10. Termo de Análise e Atestado de Credenciamento (Anexo II)	28/06/2022		
11. Termo de Declaração (Anexo V)	22/03/2022		Disponibilizado pela Instituição
12. Questionário Due Diligence Seção I	31/12/2021		Disponibilizado pela Instituição
13. Questionário Due Diligence Seção II			Disponibilizado pela Instituição
14. Questionário Due Diligence Seção III	N/A		Disponibilizado pela Instituição
III - Parecer final quanto ao credenciamento da Instituição:	Aprovamos a presente atualização e renovação do credenciamento da Bahia AM Renda Variável Ltda, em consonância com o disposto no Art. 1º § 1º, VI, da Resolução CMN nº 4.963/2021, c/c Art. 3º, §3º, da Portaria MPS nº 519/2011.		

IV - Classe(s) de Fundo(s) de Investimento para os quais a Instituição foi credenciada:		
Art. 7º, I, "a"	<input checked="" type="checkbox"/>	Art. 8º, I
Art. 7º, I, "b"	<input type="checkbox"/>	Art. 8º, II
Art. 7º, I, "c"	<input type="checkbox"/>	Art. 9º, I
Art. 7º, II	<input type="checkbox"/>	Art. 9º, II
Art. 7º, III, "a"	<input type="checkbox"/>	Art. 9º, III
Art. 7º, III, "b"	<input type="checkbox"/>	Art. 10º, I
Art. 7º, IV	<input type="checkbox"/>	Art. 10º, II
Art. 7º, V, "a"	<input type="checkbox"/>	Art. 10º, III
Art. 7º, V, "b"	<input type="checkbox"/>	Art. 11º
Art. 7º, V, "c"	<input type="checkbox"/>	
V - Fundo(s) de Investimento administrado(s)/gerido(s) pela instituição para futura decisão de investimento:	CNPJ	Data da Análise
Fundo Bahia Valuation II FIC FIA	09.635.172/0001-06	22/07/2022
O administrador do fundo de investimento detém, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social;	SIM	
Histórico de Atuação da Instituição	<p>A instituição possui a solidez e a tradição do Grupo Bahia.</p> <p>A Gestora foi criada em 2011 com a finalidade de otimizar as práticas operacionais do grupo e o atendimento a questões de ordem regulatória (transparência) através da segregação das atividades de gestão de recursos de terceiros.</p> <p>Atualmente, a Gestora é responsável pela gestão de recursos de terceiros e atua de maneira específica dentro de determinados mercados - principalmente nos mercados de ações, commodities e derivativos, mas não se restringindo a estes.</p> <p>A Gestora oferece serviços financeiros de</p>	

	<p>qualidade, através de quadros de profissionais experientes e qualificados, tendo no modelo de partnership uma importante ferramenta de alinhamento para o sucesso do negócio.</p> <p>Em 2 de março de 2017, foi alterada a razão social da Sociedade, de BBM I Gestão de Recursos Ltda. para Bahia AM Renda Variável Ltda.</p> <p>Em 03 de novembro de 2020 foi alterado o endereço da sede da Praça Pio X, 98, 10º andar (parte), Centro, CEP: 20091-040, na Cidade e Estado do Rio de Janeiro para a Avenida Barão de Tefé, 34, 19º andar (parte), Saúde, CEP: 20220-460, na Cidade e Estado do Rio de Janeiro.</p>
Segregação de Atividades	A Gestora não desenvolve outra atividade que não seja administração de carteiras de valores mobiliários na categoria de gestor de recursos.
Qualificação do corpo técnico	Possui quadro de funcionários altamente qualificados. Os currículos encontram-se anexo ao formulário de Referência da CVM publicado no site da gestora.
Histórico e experiência de atuação	<p>A Gestora foi criada em 2011 com a finalidade de otimizar as práticas operacionais do grupo e o atendimento a questões de ordem regulatória (transparência) através da segregação das atividades de gestão de recursos de terceiros.</p> <p>Atualmente, a Gestora é responsável pela gestão de recursos de terceiros e atua de maneira específica dentro de determinados mercados - principalmente nos mercados de ações, commodities e derivativos, mas não se restringindo a estes.</p> <p>A Gestora oferece serviços financeiros de qualidade, através de quadros de profissionais experientes e qualificados, tendo no modelo de partnership uma importante ferramenta de alinhamento para o sucesso do negócio.</p>
Principais Categorias de Ativos e Fundos	Fundos de renda variável, tanto long only quanto long biased.
Avaliação dos riscos assumidos pelos fundos sob sua administração/gestão	A gestão de risco de liquidez é realizada diariamente através do monitoramento de indicadores, como: i) monitoramento da liquidez dos ativos em carteira ii) estimativa do tempo de zeragem das carteiras dos fundos, de forma individual e conjunta, considerando prazos operacionais e volumes financeiros praticados no mercado iii) estimativa do custos de liquidação das carteiras de ativos dentro do prazo de resgate de cada fundo iv) simulações de cenários de estresse de fluxo de caixa, previamente discutidos nos comitês de risco, com o intuito de garantir a capacidade dos fundos de honrar seus passivos v) controle do fluxo de caixa das operações, aplicações e resgates dos fundos. Cabe à área de risco

	acompanhar estes indicadores e reportar ao comitê de risco as condições de liquidez. Maiores informações, ver a Política de Gerenciamento de Risco de liquidez no website da Gestora.		
Verificação de informações sobre conduta nas operações realizadas no mercado financeiro e restrições que desaconselham um relacionamento seguro	Não foram encontradas informações que afetem a imagem da empresa ou de seus sócios e representantes.		
Regularidade Fiscal e Previdenciária	Atendido todos os documentos solicitados através do Edital de Credenciamento do FAPES/TOLEDOPREV		
Volume de recursos sob administração/gestão	Conforme ranking da ANBIMA com posição de Maio de 2022, o valor sob gestão era de R\$ 9.384.524.338,97.		
Avaliação da rentabilidade dos fundos sob sua administração/gestão	Os fundos sob gestão/administração da Instituição apresentam aderência aos benchmarks. A Instituição adota política de avaliação de riscos dos fundos sob gestão/administração conforme relatórios de Due Diligence, bem como os manuais e políticas da Instituição.		
Critérios de análise pré-estabelecidos pelo ente federativo para credenciamento ou alocação de recursos do RPPS	Edital de Credenciamento 001/2021 de 18 de junho de 2021		
Qualidade de gestão e de ambiente de controle de investimento	A avaliação MQ1 reflete a opinião da Moody's de que a gestora de recursos tem características de gestão excelentes.		
Outros critérios de análise	N/A		
Data:	22/07/2022		
Responsáveis pelo Credenciamento:	Cargo	CPF	Assinatura
JALDIR ANHOLETO	Presidente do Conselho de Administração	702.494.239-87	
LEANDRO MARCELO LUDVIG	Presidente do Conselho Fiscal	061.448.469-30	
WILMAR DA SILVA	Membro do Comitê de Investimentos	525.047.949-91	
ROSELI FABRIS DALLA COSTA	Coordenadora do TOLEDOPREV	627.600.339-53	

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO			
Ente Federativo	Município de Toledo	CNPJ	76.205.806/0001-88
Unidade Gestora do RPPS	Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – FAPES/TOLEDOPREV	CNPJ	08.885.045/0001-00
Instituição Credenciada			
Razão Social	Bahia AM Renda Variável Ltda.	CNPJ	13.143.849/0001-66
Número do Termo de Análise de Credenciamento		001/2021	
Data do Termo de Análise de Credenciamento		22/07/2022	
Parecer final quanto ao credenciamento da Instituição:	Tendo em vista o atendimento de todos os itens necessários ao cumprimento das exigências do Conselho Monetário Nacional, da Secretaria de Previdência do Ministério da Economia e do Edital de Credenciamento 001/2021 - FAPES/TOLEDOPREV de 08/06/2021, CREDENCIAMOS a Instituição conforme dados constantes deste Atestado de Credenciamento		
Classificação de Fundo(s) de Investimento para os quais a Instituição foi credenciada			
Art. 7º, I, "a"		Art. 8º, I	
Art. 7º, I, "b"		Art. 8º, II	
Art. 7º, I, "c"		Art. 9º, I	
Art. 7º, II		Art. 9º, II	
Art. 7º, III, "a"		Art. 9º, III	
Art. 7º, III, "b"		Art. 10º, I	
Art. 7º, IV		Art. 10º, II	
Art. 7º, V, "a"		Art. 10º, III	
Art. 7º, V, "b"		Art. 11º	
Art. 7º, V, "c"			
Fundo(s) de Investimento Analisado(s)		CNPJ	Data da Análise
Fundo Bahia Valuation II FIC FIA		09.635.172/0001-06	22/07/2022
Data:		22/07/2022	
Responsáveis pelo Credenciamento:	Cargo	CPF	Assinatura
JALDIR ANHOLETO	Presidente do Conselho de Administração	702.494.239-87	
LEANDRO MARCELO LUDVIG	Presidente do Conselho Fiscal	061.448.469-30	
WILMAR DA SILVA	Membro do Comitê de Investimentos	525.047.949-91	
ROSELI FABRIS DALLA COSTA	Coordenadora do TOLEDOPREV	627.600.339-53	