

SELEÇÃO DE GESTOR DE FUNDO DE INVESTIMENTOS RESTRITO RENDA FIXA IMA-B 5 Nº 0001/2024

Este documento visa divulgar os requisitos necessários para participação no processo de seleção de gestor para recursos advindo de planos de benefícios administrados pela **FUNDAÇÃO SISTEL DE SEGURIDADE SOCIAL**, no qual poderá participar qualquer instituição gestora de recursos devidamente autorizada pelos órgãos governamentais competentes e desde que atenda aos critérios discriminados neste documento.

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO RESTRITO RENDA FIXA IMA-B 5

O processo irá **selecionar** um **GESTOR** de **Fundo de Investimentos Restrito Renda Fixa Referenciado IMA-B 5**, cujo mandato terá as seguintes características:

Característica Mandato	Fundo Renda Fixa
Objetivo	Acompanhar a rentabilidade do índice ANBIMA IMA-B 5
Cotização	Fechamento D+0 para aplicação e resgate
Liquidação	D+0 para aplicação e D+1 para resgate
Legislação	Enquadrado na Resolução CMN 4.994/22
Taxa de gestão máxima	0,08% ao ano
Patrimônio Inicial do Fundo de Investimentos a ser gerido	Aproximadamente R\$ 100 milhões

O mandato restrito buscará **acompanhar a rentabilidade do índice ANBIMA IMA-B 5**, com exposição exclusiva em títulos públicos federais, observando a Resolução CMN 4.994/2022, devendo os ativos estarem custodiados em *clearings* locais.

A **meta de rentabilidade** ora estabelecida não se caracteriza como uma promessa, garantia ou sugestão de rentabilidade, consistindo apenas em objetivo a ser perseguido pelo **GESTOR** do **FUNDO**.

O **FUNDO** tem como índice de referência a rentabilidade do IMA-B 5, tendo as possibilidades de **ALOCAÇÃO** em estratégias envolvendo taxas de juros pós-fixadas de inflação em títulos públicos

federais – TPF, bem como derivativos cujo ativo objeto sejam ativos, taxas ou índices de renda fixa, desde que não haja alavancagem do fundo, sendo vedada a exposição a crédito privado.

É permitida a aquisição de cotas de Fundos de Investimentos e Fundos de Índices – ETF, desde que o custo para o **FUNDO** não ultrapasse o valor referente à taxa de gestão.

ALOCAÇÃO OBJETIVO E LIMITES

O **objetivo** do **FUNDO DE INVESTIMENTOS** (PASSIVO) é aplicar, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) de seus recursos em títulos públicos federais de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, ao fator de risco que dá nome à classe, buscando acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA – IMA-B 5, divulgada pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados.

Em nenhuma hipótese será permitida alavancagem de ativos, bem como a compra de crédito privado neste Fundo de Investimentos.

O processo será composto por 3 fases:

✓ Habilitação

As qualificações e ações mínimas exigidas para que os Gestores possam participar do processo de seleção são:

- Possuir volume superior a R\$ 3 bilhões de recursos sob gestão na categoria “Patrimônio Líquido – por Classe Anbima” de Renda Fixa no *ranking* de gestores de FI/Anbima¹;
- Possuir volume superior a R\$ 1,5 bilhão de recursos sob gestão na categoria “Patrimônio Líquido - Por Segmento de Investidor” (Somados EFPC Empresas Públicas e EFPC Emp. Privadas) no *ranking* de gestores de FI/Anbima¹;
- O Gestor deverá indicar um fundo de investimentos, junto com o número do CNPJ, que **tenha mais de 3 anos de operação e que o**

¹ https://www.anbima.com.br/pt_br/informar/ranking/fundos-de-investimento/gestores.htm

índice de referência seja IMA-B 5², podendo ser fundo master ou exclusivo na categoria de Renda Fixa;

- Além da indicação deste Fundo de Investimentos (Anexo I), deve encaminhar o histórico de 36 meses, da cota bruta, do retorno, da volatilidade e do patrimônio, com referência em 31 de julho de 2024;
- O Gestor deverá ser associado bem como aderente aos códigos da Anbima e deverá enviar o QDD Gestor de Recursos de Terceiros de FI/Anbima;
- Declaração de inexistência de processo de inabilitação e suspensão da instituição e/ou de algum de seus dirigentes nos respectivos Órgãos Supervisores; e
- O Gestor deverá encaminhar o relatório de *rating institucional* da gestora de recursos emitido por agências de classificação de risco no mercado doméstico.

✓ **Análise Quantitativa**

A avaliação quantitativa de cada gestor será efetuada com base no erro quadrático médio, retorno, taxa de gestão proposta e patrimônio dos fundos de investimentos indicados pelo Gestor, atribuindo-se pesos para os respectivos indicadores, com objetivo de compor a classificação final dos gestores habilitados.

✓ **Análise Qualitativa**

Na avaliação qualitativa de cada gestor serão considerados o modelo de gestão, risco e *compliance* e negócio, além dos fatores ASG (ambiental, social e governança) sobre o gestor de recursos, ponderados pelos respectivos pesos atribuídos.

Os dados para essa avaliação terão como base o questionário de *due diligence* - Gestor de Recursos de Terceiros de FI/Anbima encaminhado pelo Gestor, bem como de entrevista, on-line ou *in loco*, a ser realizada.

² O IMA-B 5 representa a evolução, a preços de mercado, da carteira de títulos públicos indexados ao IPCA (NTN-B) com prazos inferiores a cinco anos.

CLASSIFICAÇÃO FINAL

A classificação final dos gestores habilitados será formada pela soma ponderada pelos respectivos pesos da avaliação quantitativa, qualitativa.

DEMAIS INFORMAÇÕES

Os gestores interessados em participar do processo deverão encaminhar as informações solicitadas neste documento e o **ANEXO I** preenchido à Sistel até o fim do dia **30/08/2024** para os seguintes e-mails: geinf@sistel.com.br e controladoria@sistel.com.br, identificando o assunto como: Seleção de Gestores de Fundo Renda Fixa IMA-B 5 nº 0001/2024. Dúvidas também poderão ser enviadas para os e-mails acima citados.

Brasília, 21 de agosto de 2024.

Diretoria Executiva

**ANEXO I – DADOS DO FUNDO DE INVESTIMENTOS A SER INDICADO PELO
CANDIDATO**

Nome do Fundo de Investimento Indicado	
CNPJ do Fundo de Investimento Indicado	
Taxa de Gestão Proposta pelo Candidato (% a.a.)	