



IPREM-GV

Instituto de Previdência
Municipal de Governador
Valadares / MG

QUESTIONÁRIO DE SELEÇÃO DE ADMINISTRADORES/GESTORES DE INVESTIMENTOS

1- INFORMAÇÕES INSTITUCIONAIS - SOLIDEZ PATRIMONIAL

1.1 Informar a data de constituição da instituição.

1.2 Informar o capital social da instituição. É ligada a grupo nacional ou estrangeiro, ou a algum governo estadual? Qual?

1.3 Relacionar os Acionistas da Empresa e suas participações no capital da instituição.

1.4 Relacionar as filiais e/ou escritório de representação ou distribuição da Instituição no território nacional.

1.5 Informar Razão Social, endereço, CNPJ, *home page e-mail* da empresa responsável pela administração e gestão de recursos de terceiros.

1.6 Há quanto tempo a Instituição administra recursos de terceiros no país

1.7 As funções de gestão, administração, custódia e auditoria são segregadas, atendendo aos princípios de "chinesewall"? Quais as instituições responsáveis por cada uma delas? Caso as atividades de gestão, administração e compliance sejam efetuadas pela própria instituição, descrever como funciona cada uma delas, quais suas atribuições, qual o nível de independência e como se interagem. Faça uma síntese de como funciona tal política de segregação dentro da Instituição.

2 - DESEMPENHO DE GESTÃO

2.1 Informar o montante de recursos de terceiros administrados, discriminando por tipo de cliente e por tipo de produto em data base a ser informada:

Investidor Institucional

Pessoa Física

Pessoa Jurídica

Distribuidor

Renda Fixa

Renda Variável

Fundo Aberto

Total

2.2 Relacionar os principais clientes institucionais por volume de recursos administrados. Não é necessário mencionar o volume aplicado de cada cliente.

2.3 Relacionar os principais Fundos de Investimento administrados por esta instituição, que julguem adequados para Previdência Pública, bem como seus respectivos patrimônios, o benchmark e a qualificação/premiações dadas por Empresa de qualificação de fundos e classificação de risco "rating", mencionando a agência e o nível de risco de cada fundo.

2.4 Relacionar por ordem decrescente de rentabilidade, o histórico dos fundos acima mencionados indicando a rentabilidade obtida nos últimos 12 meses, a volatilidade ou *trackingerror* em relação ao IBX (para renda variável) nos últimos 12 meses, a taxa de administração e taxa de performance, quando houver.

I – retorno: variação percentual do valor da cota do fundo de investimento nos 12 (doze) meses anteriores, líquida de taxa de administração e demais despesas;

II – volatilidade: desvio padrão da variação mensal da cota do fundo de investimento, nos 12 (doze) meses anteriores;

2.5. Remeter o regulamento destes fundos.

3- PROCESSO DECISÓRIO DE INVESTIMENTOS

3.1 Descrever o modelo de decisão adotado.

3.2 Descrever os modelos matemáticos praticados no processo de alocação de investimentos.

3.3 Descrever a filosofia de investimentos para a gestão de portfólios.

3.4 Qual é a política de risco de crédito? Esta política é compartilhada com o Investidor? De que forma?

3.5 Quais são os critérios de marcação a mercado dos ativos e derivativos e quem os define?

4 - CURRÍCULO DOS GESTORES e/ou ADMINISTRADORES DE CARTEIRA E OUTROS RESPONSÁVEIS PELA GESTÃO E ADMINISTRAÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

Descrever de forma sucinta a formação profissional de cada gestor/administrador de carteira e do back-office, dos responsáveis pelo desenvolvimento e aplicação de modelos matemáticos, contendo, por ordem cronológica as informações mais relevantes sobre os objetivos alcançados pela gestão.

5 - MECANISMO DE GESTÃO E ALOCAÇÃO EFICIENTE DE RECURSOS, DE ACOMPANHAMENTO DE PERFORMANCE, DE BACK-OFFICE E DE AVALIAÇÃO DE RISCO.

5.1 Descrever detalhadamente e individualizada os mecanismos e os modelos aplicados.

5.2 Informar se os mecanismos e modelos foram submetidos à auditoria e se os mesmos foram certificados por alguma instituição. Anexar cópias dos certificados, se for o caso.

5.3 Informar a periodicidade do processo de auditoria a que estão submetidos os mecanismos e os modelos aplicados.

5.4. O que é baixo risco de crédito na visão desta instituição?

6 - FUNÇÕES TERCEIRIZADAS

6.1 Descrever de forma sucinta o currículo dos responsáveis (pessoa física ou jurídica) pelas funções terceirizadas.

7 - SERVIÇOS

7.1 Quais os serviços de informações são prestados aos clientes institucionais? Com que periodicidade tais informações são encaminhadas? Qual o meio de comunicação utilizado?

7.2 A instituição promove algum curso ou presta algum, serviço de orientação e informação aos clientes institucionais, referente aos mecanismos e instrumentos disponíveis no mercado financeiro e que são utilizados como ferramentas pelo gestor do fundo?

7.3 Qual a periodicidade das informações referentes aos fundos enviados aos investidores? Quais são essas informações e sob qual forma são encaminhadas?

7.4 Que tipo de serviços adicionais são oferecidos aos clientes de fundo de investimentos? Que tipos de relatórios são emitidos? Se possível, a Instituição poderia encaminhar alguns modelos de tais relatórios?

7.5 No entendimento da Instituição, em que aspecto se diferencia de seus concorrentes, destacando-se na gestão de recursos de terceiros?

8 - DECLARAÇÃO

Declaração acerca da veracidade das informações fornecidas.