

COMISSÃO PERMANENTE DE LICITAÇÕES DO MUNICÍPIO DE TIMBÓ

ATA DE JULGAMENTO DA PROPOSTA TÉCNICA

TOMADA DE PREÇOS Nº. 01/2021 – TIMBOPREV

INTERESSADAS: SMI PRIME CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA

Às dezesseis horas do nono dia, do mês de abril de dois mil e vinte e um (09/04/2021), na sala de Licitações da Prefeitura de Timbó/SC, reuniram-se os membros da Comissão Permanente de Licitações, designada pela Portaria nº. 03 de 04 de janeiro de 2021, para Julgamento da Proposta Técnica do processo licitatório de Tomada de Preços nº. 01/2021 – TIMBOPREV.

Da análise dos documentos apresentados conforme exigência do item 8.1 do Edital, considerando o parecer emitido pelo Comitê de Investimentos do TIMBOPREV, atendendo ao princípio da legalidade, impessoalidade, interesse público, economicidade e vinculação ao instrumento convocatório, a Comissão de Licitações decide pela **classificação da Proposta** da empresa **SMI PRIME CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA**, conforme pontuação abaixo:

Item	Descrição	Pontuação
1	Apresentar um relatório com periodicidade mensal , que contenha no mínimo a composição/distribuição da carteira de investimentos (mês atual e mês anterior) por segmento e tipo de ativo, que contenha a composição (valores monetários e percentual) da carteira de cada um dos fundos investidos, da carteira própria (se houver) e a consolidação total de renda fixa, renda variável e investimentos estruturados, demonstrando entradas/saídas de recursos, novas aplicações, resgate total de ativos e total do patrimônio do instituto, bem como a participação de cada gestor na carteira de investimentos e o resumo/distribuição (em percentuais) por segmento e por instituição financeira.	5 pontos
2	Apresentar um relatório com periodicidade mensal , que contenha no mínimo o desempenho/retorno da carteira de investimentos do instituto em valores monetários, separados por segmento e por ativo, demonstrando o retorno de cada um dos fundos investidos, mês a mês e consolidado no ano.	5 pontos
3	Apresentar um relatório com periodicidade mensal , que contenha no mínimo o percentual da rentabilidade e risco dos ativos individual e comparativa (no mês, ano e 12 meses), indicando os benchmarks de cada ativo, rentabilidade e meta de modo a identificar o desempenho de cada ativo; rentabilidade e risco dos ativos por investimento, bem como a rentabilidade da carteira, indicadores, e da meta atuarial estabelecida na Política de Investimentos (no mês, ano e 12 meses).	5 pontos

4	Apresentar um relatório com periodicidade mensal , que contenha no mínimo análise de risco da carteira (incluindo notas metodológicas e explicativas) com Medidas de Risco e de Desempenho da Carteira, apresentado com indicativo mensal, em 3 meses e em 12 meses, com no mínimo as seguintes medidas de risco: Volatilidade anualizada, VaR (95%), <i>Tracking Error</i> , Sharpe, Beta, Alfa de Jensen, <i>Draw- Down</i> , <i>Treynor</i> . Deverá demonstrar ainda, além das medidas de Risco e de Desempenho já solicitadas, o resultado de um STRESS TEST com base nos últimos 24 meses da Carteira de Investimentos do Instituto, com a metodologia para tanto.	5 pontos
5	Apresentar um relatório com periodicidade mensal , que contenha no mínimo Liquidez e custo das aplicações que compõe a carteira, por ativo/fundo de investimento (devidamente identificado com nome/CNPJ), informando a conversão e liquidez das aplicações e resgates, incluindo carência, prazos de cotização e liquidação das aplicações e resgates, taxa de administração e taxa de performance. (Relatório com no mínimo de 10 (dez) fundos/ativos).	5 pontos
6	Apresentar um relatório com periodicidade mensal , que contenha no mínimo fluxo de caixa da carteira de modo que permita verificar as movimentações financeiras (aplicações e resgates) realizadas no mês indicando o respectivo ativo e a consolidação de valores das movimentações, bem como indicar as movimentações de recursos por índice.	3 pontos
7	Apresentar um relatório com periodicidade mensal , que contenha no mínimo enquadramento ou não de cada ativo de acordo com a legislação, Política de Investimento e demais exigências legais aplicável, por ativo, segmento e gestor, apresentando informações completas de cada ativo/fundo investido, contendo no mínimo a identificação do fundo (nome e CNPJ), do gestor e administrador de cada fundo/ativo; PL do fundo; cota; quantidade de cotistas; o percentual de participação do instituto em cada fundo; a participação dos investimentos do instituto na totalidade do PL; percentual nos termos do art. 13 e 14 da resolução 3922/2010. E ainda limites por segmento de acordo com o estabelecido na resolução 3922/2010 e na Política de Investimentos comparado com a carteira (em percentual e valor monetário); patrimônio sob gestão de cada instituição/gestor, bem como o status do enquadramento (enquadrado ou não enquadrado) entre outras informações necessárias.	6 pontos

8	Apresentar relatório com periodicidade mensal (no mínimo) que possibilite o acompanhamento da indústria de fundos de investimentos obrigatoriamente adequados ao instituto. Para praticidade e objetividade no uso e comparação entre os pares, os fundos de investimentos devem estar separados por benchmark e segmento, com nome e CNPJ de cada ativo/fundo. Deve apresentar informações de rentabilidade absoluta e relativa dos fundos <u>comparada com a meta atuarial</u> , em períodos padrões de mercado, destacar o Patrimônio líquido, indicadores de risco e de performance, taxa de administração e enquadramento nos termos da Resolução CMN 3.922/2010, entre outras informações.	4 pontos
9	Apresentar relatório com periodicidade diária , com informações sobre os Títulos Públicos Federais, a saber: Tesouro IPCA+ (NTN-B); Tesouro Prefixado (LTN) e Tesouro Prefixado com Juros (NTN-F), informando o <i>Duration</i> de cada vértice, variação % do PU no dia e no mês e a Taxa Indicativa do título no mês atual e no anterior. Para uma melhor interpretação dessas informações, deverá ser apresentada a média ponderada das taxas indicativas dos títulos que compõem os índices e sub índices IMA.	5 pontos
10	Apresentar 05 (cinco) amostras das suas análises (observada as condições necessárias na emissão de parecer), sendo composta por (1) um fundo de renda fixa	5 pontos
	com benchmark em algum sub índice do IMA - Índice de Mercado ANBIMA ou IDKA – Índice de Duração Constante ANBIMA; (1) um fundo de Renda Fixa que contenha a expressão “Crédito Privado”; (1) um fundo de Renda Variável; (1) um fundo Multimercado e (1) um fundo estruturado, podendo ser um FII (Fundo de Investimento Imobiliário) ou um FIP (Fundo de Investimentos em Participações), onde seja exposta, através de uma análise quantitativa e qualitativa, a clara opinião da consultoria a respeito do produto financeiro analisado.	
11	Apresentar amostra dos informativos elaborados pela licitante, informando sua respectiva periodicidade, que tem por objetivo levar aos participantes no processo de gestão dos recursos financeiros, informações do mercado financeiro, políticas, projeções e demais assuntos relacionados.	2 pontos
12	Apresentar uma amostra de um Estudo de Macro Alocação de Ativos – Asset Liability Management – ALM, realizado pela contratada. (Estudo de Otimização da Carteira).	5 pontos
13	Disponibilização e apresentação do ambiente web privativo, acessado por login e senha, para elaboração e publicação das APR's, com extração automática das informações relacionadas com a carteira de investimentos do instituto, e comprovar a disponibilização dos relatórios, análises, diagnósticos entre outros documentos financeiros. A apresentação do ambiente web deverá ocorrer mediante a entrega de documento escrito contendo o endereço do sítio eletrônico do ambiente web e a respectiva informação de login e senha de acesso.	6 pontos

14	Apresentar relatório da consolidação da carteira de investimentos <u>diário</u> , possibilitando aos gestores do TIMBOPREV o acompanhamento da evolução patrimonial através de uma cota única. Apresentar as informações de cada ativo de forma individual e consolidada. A apuração da rentabilidade da carteira consolidada deverá conter a variação percentual diária, mensal, no ano e em 12 meses, comparada com a variação % do CDI e da Meta Atuarial do Instituto.	3 pontos
15	Comprovação de que a licitante possui no quadro societário ou quadro de funcionários 03 (três) ou mais consultores com Registro/Credenciamento na Comissão de Valores Mobiliários – CVM.	6 pontos
16	Comprovação de que a licitante possui no quadro societário ou quadro de funcionários 02 (dois) consultores com Registro/Credenciamento na Comissão de Valores Mobiliários – CVM.	
17	Comprovação de que a licitante possui no quadro societário ou quadro de funcionários 01 (um) consultor com Registro/Credenciamento na Comissão de Valores Mobiliários – CVM.	

De acordo com o item 8.4 do edital, para os itens 15, 16 e 17 da tabela acima, a pontuação será auferida apenas uma vez conforme quantidade de consultores devidamente comprovado.

A SMI Prime Consultoria de Investimentos Ltda apresentou documentos conforme estabelece o item 8.1 e 9.2.2.1 do Edital, totalizando 70 pontos na Proposta Técnica.

Ficam os interessados cientes do inteiro teor desta Ata de Julgamento da Proposta Técnica, para, querendo, apresentar recurso, nos termos do art. 109 da Lei nº 8.666/1993, ou seja, 05 (cinco) dias úteis a contar da data de publicação desta ata no Diário Oficial dos Municípios (DOM/SC).

Nada mais havendo, o Presidente encerrou a sessão, lavrando-se a presente ata, que lida e achada conforme, vai assinada pelos Membros da Comissão.

Registre-se, publique-se, intímese.

THOMAZ H. CAMPREGHER
Presidente

TAINARA FISTAROL
Membro

ANDERSON DAVID RADDATZ
Membro