



FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER JUDICIÁRIO
Setor Comercial Norte - Quadra 4 - Bloco B - Ed. Varig - Torre Sul - 8º andar - Sala 803 - Bairro Asa Norte - CEP 70714-020 - Brasília - DF -
www.funpresjud.com.br

ATA

ATA DE ABERTURA E JULGAMENTO DAS PROPOSTAS REFERENTE AO PROCESSO DE SELEÇÃO DE GESTORES Nº 001/2020

Às 11h00min do dia 27 de novembro de 2020, em sessão aberta ao público, reuniram-se membros da Gerência de Investimentos (GEINV), para a realização do **PROCESSO DE SELEÇÃO DE GESTORES**, com a finalidade de selecionar instituições autorizadas e registradas pela CVM para a prestação do serviço de gestão da carteira de valores mobiliários, títulos e direitos que correspondam às reservas técnicas, provisões e fundos do Plano de Benefícios administrado pela Funpres-Jud, que estará capacitada para a gestão de Fundos de Investimento Exclusivos da Fundação.

Participaram da sessão pública os seguintes membros da Gerência de Investimentos: 1) Rodrigo Pereira de Almeida – Gerente de Investimentos; 2) Adriano Rosetti Machado de Resende – Analista de Investimentos.

Nenhum representante, por parte das instituições interessadas, compareceu, tendo o Processo de Seleção de Gestores considerado todos os envelopes recebidos até o momento da abertura da sessão pública.

Ao todo, 10 (dez) instituições enviaram os envelopes demandados, conforme especificado na Sessão 2 do Edital, sendo elas:

Nome da Instituição	CNPJ
Caixa Econômica Federal	00.360.305/0001-04
Claritas Administração de Recursos Ltda.	03.987.891/0001-00
Banco Safra S.A.	58.160.789/0001-28
BTG Pactual Asset Management S/A DtvM	29.650.082/0001-00
Franklin Templeton Investimentos (Brasil) Ltda	04.205.311/0001-48
Mongeral Aegon Investimentos Ltda.	16.500.294/0001-50
Santander Brasil Gestão de Recursos Ltda.	10.231.177/0001-52
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda.	13.421.810/0001-63
Votorantim Asset Management DtvM	03.384.738/0001-98
Western Asset Management Company DtvM Ltda.	07.437.241/0001-41

Iniciada a fase de Apresentação de Propostas, foram abertos os envelopes contendo as **PROPOSTAS DE PREÇOS** (Envelope nº 01) das instituições interessadas, até então lacrados, tendo-se apurado os seguintes percentuais oferecidos e as indicações de Fundos de Investimento Exclusivos conforme disposto no item 19.3.3 do Edital:

Nome da Instituição	Taxa de Gestão	Taxa de Performance	Fundo de Investimento Exclusivo indicado	
			Código Anbima	Nome
Banco Safra	0,10%	0,00%	315656	Comshell Concha FI RF

BTG Pactual	0,20%	20,00%	390161	FI RF Minas Gerais
Caixa	0,10%	0,00%	341495	Caixa FI Funpresp Mult
Claritas	-	-	-	-
Franklin	0,15%	20,00%	385001	Pelicano FI Mult
Mongeral Aegon	0,08%	0,00%	-	-
Santander	0,12%	10,00%	302635	FI Kprev Mult Cred Priv
Vinci	0,15%	20,00%	388033	FI Mult Tertius Moderado
Votorantim	0,15%	20,00%	312320	Citiprevi Citi 200 Anos FI Mult
Western	0,20%	20,00%	350354	Gran Torino FI Mult

Tendo os membros da Gerência de Investimentos analisado os envelopes que continham as propostas de preços e a indicação de Fundo de Investimento Exclusivo, resume-se:

- i. Caixa: Proposta encaminhada conforme Edital com indicação de Fundo de Investimento Exclusivo válido;
- ii. Claritas: Proposta encaminhada sem indicação de valores e sem indicação de Fundo de Investimento Exclusivo;
- iii. Banco Safra: Proposta encaminhada conforme Edital com indicação de Fundo de Investimento Exclusivo válido;
- iv. BTG Pactual: Proposta encaminhada conforme Edital com indicação de Fundo de Investimento Exclusivo válido;
- v. Franklin: Proposta encaminhada conforme Edital com indicação de Fundo de Investimento Exclusivo válido;
- vi. Mongeral Aegon: Proposta encaminhada conforme Edital sem indicação de Fundo de Investimento Exclusivo;
- vii. Santander: Proposta encaminhada conforme Edital com indicação de Fundo de Investimento Exclusivo válido;
- viii. Vinci: Proposta encaminhada conforme Edital com indicação de Fundo de Investimento Exclusivo válido;
- ix. Votorantim: Proposta encaminhada conforme Edital com indicação de Fundo de Investimento Exclusivo válido.
- x. Western: Proposta encaminhada conforme Edital com indicação de Fundo de Investimento Exclusivo válido.

Sendo assim, tem-se o seguinte quadro:

Nome da Instituição	SITUAÇÃO
Banco Safra	Classificada
BTG Pactual	Classificada
Caixa	Classificada
Claritas	Desclassificada
Franklin	Classificada
Mongeral Aegon	Classificada
Santander	Classificada
Vinci	Classificada
Votorantim	Classificada
Western	Classificada

Na fase de **Julgamento**, em ato contínuo, foi realizada a classificação das instituições participantes segundo os critérios classificatórios da Seção 19 do Edital.

Para o **Ranking de Gestores de Fundos de Investimento**, foi utilizado o arquivo disponível no site <http://www.funpresjud.com.br/quem-somos/transparencia/licitacoes/>, com posição em outubro/2020, segundo definido no item 5.3.2 do Edital.

Sendo assim, tem-se o seguinte quadro:

Instituição Interessada	EG	ISG	R_i	$R_{benchmark}$	σ_i	TG	TP
Banco Safra	3.624	0,28	30,71%	25,86%	4,83%	0,10%	0,00%
BTG Pactual	2.691	4,67	31,88%	25,86%	0,36%	0,20%	20,00%
Caixa	10.230	0,14	30,65%	25,86%	9,74%	0,10%	0,00%
Franklin	2.882	-0,48	19,66%	25,86%	3,74%	0,15%	20,00%
Mongeral Aegon	3.211	-	-	25,86%	-	0,08%	0,00%
Santander	63.410	5,73	33,30%	25,86%	0,36%	0,12%	10,00%
Vinci	5.908	0,30	32,46%	25,86%	6,10%	0,15%	20,00%
Votorantim	4.513	-0,01	25,36%	25,86%	9,84%	0,15%	20,00%
Western	30.131	0,76	30,46%	25,86%	1,71%	0,20%	20,00%

EG (Especialidade de Gestão) = Patrimônio líquido sob gestão da instituição de titularidade de EFPC

ISG = Índice de Sharpe Generalizado

R_i = Retorno Acumulado em 36 meses do Fundo i

$R_{benchmark}$ = Retorno Acumulado em 36 meses do *benchmark* (IPCA + 4,15% a.a.)

σ_i = Risco Anualizado do ativo i (calculado a partir dos retornos diários)

TG = Taxa de Gestão

TP = Taxa de *Performance*

Utilizando-se os critérios classificatórios da Seção 19 do Edital, tem-se o quadro a seguir contendo as instituições ordenadas por Nota Final:

#	Instituição Interessada	Nota Final
1	Santander	73,17
2	Mongeral Aegon	70,13
3	Caixa	64,06
4	Banco Safra	62,80
5	Vinci	22,01
6	Votorantim	20,87
7	Franklin	20,46
8	BTG Pactual	12,22
9	Western	8,76

Na fase **Habilitação**, em ato contínuo, foram abertos os envelopes contendo os **DOCUMENTOS DE HABILITAÇÃO** (Envelope nº 02) das instituições interessadas, conforme definido no item 5.5 do Edital.

Tendo os membros da Gerência de Investimentos (Geinv) analisado os envelopes que continham os documentos de habilitação das licitantes, resume-se:

- i. Santander: Documentação encaminhada conforme Edital.

- ii. Mongeral Aegon: Documentação encaminhada conforme Edital.
- iii. Caixa: Documentação encaminhada conforme Edital.
- iv. Banco Safra: Documentação encaminhada conforme Edital.
- v. Vinci: Documentação encaminhada conforme Edital.
- vi. Votorantim: Anexo V - Declaração de Elaboração Independente de Proposta (em papel timbrado da instituição financeira interessada) não encaminhado.
- vii. Franklin: Documentação encaminhada conforme Edital.
- viii. BTG Pactual: Anexo VI - Comprovante de Aptidão para Desempenho de Atividades de Gestão de Fundos de Investimento não encaminhado.
- ix. Western: Documentação encaminhada conforme Edital.

Por fim, tem-se o seguinte quadro:

Nome da Instituição	SITUAÇÃO
Santander	Habilitada
Mongeral Aegon	Habilitada
Caixa	Habilitada
Banco Safra	Habilitada
Vinci	Habilitada
Votorantim	Não Habilitada
Franklin	Habilitada
BTG Pactual	Não Habilitada
Western	Habilitada

Em prosseguimento, atendendo ao disposto no item 5.6 do Edital, foi aberto o prazo de 5 (cinco) dias úteis, a partir desta data, para Interposição de Recursos, que poderão contemplar, além dos atos praticados na fase de Habilitação, aqueles praticados em decorrência da fase de julgamento.

Como resultado **provisório**, tem-se o seguinte quadro:

#	Instituição Interessada	SITUAÇÃO
1	Santander	Vencedora
2	Mongeral Aegon	Vencedora
3	Caixa	Vencedora
4	Banco Safra	Cadastro Reserva
5	Vinci	Cadastro Reserva
6	Franklin	Cadastro Reserva
7	Western	Cadastro Reserva

A Sessão Pública fica encerrada e, posteriormente, fica a Funpres-Jud responsável por divulgar o resultado **final** após a apreciação de eventuais recursos.

Adriano Rosetti Machado de Resende
Analista de Investimentos

Rodrigo Pereira de Almeida
Gerente de Investimentos



Documento assinado eletronicamente por **Adriano Rosetti Machado de Resende, Analista de Investimentos**, em 27/11/2020, às 16:31, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



Documento assinado eletronicamente por **Rodrigo Pereira de Almeida, Gerente**, em 27/11/2020, às 16:34, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



A autenticidade do documento pode ser conferida no site https://sei.funpresjud.com.br/sei/controlador_externo.php?acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=0, informando o código verificador **0021688** e o código CRC **48994638**.