

TERMO DE REFERÊNCIA – CONTRATAÇÃO DE CONSULTORIA FINANCEIRA.

1. OBJETO

Contratação de empresa especializada para consultoria financeira para o BERTPREV.

2. JUSTIFICATIVA

Necessidade de contratação de empresa especializada para prestação do serviço de consultoria financeira para o Instituto.

3. DESCRIPTIVO DO SERVIÇO A SER CONTRATADO.

O objeto do presente contrato é de consultoria de valores mobiliários, a seguir descrita:

3.1) Análise das aplicações dos recursos financeiros do BERTPREV, com emissão de relatórios mensais que apresentem no mínimo a posição dos ativos e seu enquadramento nos termos da Resolução 4.963/21 e Portaria nº 1.467/2022, ou outras que vierem a substituí-las, considerando:

- 3.1.1) Os segmentos de renda fixa, renda variável, investimentos no exterior, investimentos estruturados e fundos imobiliários.
- 3.1.2) Enquadramento da carteira;
- 3.1.3) Rentabilidade por artigo e análise por liquidez, considerando valor das cotas;
- 3.1.4) Gráfico ilustrativo da alocação dos ativos por artigos, por estratégia e por gestor;
- 3.1.5) Histórico de rentabilidade da carteira em comparação com a meta atuarial e gráficos demonstrando evolução histórica e rentabilidade dos últimos 12 meses;
- 3.1.6) Performance dos fundos comparativamente em diferentes períodos considerando no mínimo 3, 6, 12, 24 e 36 meses, além do desempenho dos principais índices comparativos (benchmarks);
- 3.1.7) Quadro Demonstrativo dos prazos para cotização, liquidação e resgate, além das taxas incidentes sobre os investimentos;
- 3.1.8) Comparativo de vários índices (benchmarks) considerando períodos diferentes de no mínimo 3, 6, 12, 24 e 36 meses;
- 3.1.9) Comparativo marcação Curva x Mercado para os vencimentos de títulos públicos integrantes da carteira;
- 3.1.10) Demonstrativo das movimentações financeiras realizadas em cada mês;

3.1.11) Quadro resumido de comparação de volatilidade, risco e rentabilidade dos ativos integrantes da carteira.

3.2) Elaboração anual de minuta de Política de Investimentos e suas atualizações quando necessário, exigida pela citada Resolução 4.963/21 ou outra que vier a substituí-la;

3.3) Elaboração de Relatórios Mensais, Trimestrais, Semestrais e Anuais referente análise de mercado e cenário macro econômico exigidos pela citada Resolução 4.963/21 e Portaria nº 1.467/2022, ou outras que vierem a substituí-las de forma que também atenda ao Programa Pró-Gestão.

3.4) Elaboração do ALM – Asset Liability Management que deve incluir a alocação ideal dos ativos através da construção da fronteira eficiente de Markowitz e a modelagem de fluxo de caixa com indicação dos vértices de títulos públicos federais para serem adquiridos frente ao passivo do RPPS em consonância com a Resolução CMN 4.963/21 e alterações posteriores, e as normas do Departamento dos Regimes de Previdência no Serviço Público, integrante da Secretaria de Regime Próprio e Complementar do Ministério da Previdência Social, ou órgão que vier substituí-lo, provendo subsídios ao controle de liquidez e alocação eficiente dos ativos, a fim de evidenciar a capacidade da Contratante em cumprir com os compromissos assumidos perante os beneficiários do plano de benefícios, com base nas premissas utilizadas; este deverá ser apresentado aos colegiados do Instituto e servidores de em Audiência Pública em data previamente marcada pela contratante

3.5) Produzir os relatórios necessários para atendimento ao nível do Pró Gestão a que o BERTPREV estiver enquadrado.

3.6) Elaboração de relatório sobre o panorama econômico.

3.7) Como ferramenta da consultoria, disponibilização de plataforma eletrônica, acesso pela INTERNET, que contenha, no mínimo:

a) Enquadramento das aplicações nos segmentos e artigos da Resolução CMN nº 4.963/21, ou outra que vier a substituí-la, e frente aos limites definidos na Política de Investimentos, com emissão de alerta em casos de desenquadramento.

b) Rentabilidade individual e comparativa – benchmarks – das aplicações financeiras de forma a identificar aquelas com desempenho insatisfatório;

c) Análise de risco da carteira dos fundos de investimentos;

d) Marcação a Mercado da carteira de Títulos Públicos Federais, identificando oportunidades de compra e venda;

e) Marcação na Curva da carteira de Títulos Públicos Federais;

f) Concentração dos investimentos por instituição financeira;

g) Taxa de administração por fundo de investimento, possibilitando análise comparativa;

h) Quantidade de cotistas por fundo de investimento que compõe a carteira, com emissão de alerta em caso de excesso em relação ao limite máximo de participação;

i) Rentabilidade da carteira após as movimentações mensais, disponibilizada mensalmente e cumulativamente no decorrer do ano em exercício, comparativamente à meta atuarial;

j) Gráfico comparativo de rentabilidade e riscos dos fundos de investimentos desde janeiro de 2016;

k) Informações dos investimentos para preenchimento do cadastro mensal e geração de arquivos necessários para envio automático no portal do MPS – “CADPREV” ou outro que vier a substituí-lo.

3.8) Disponibilizar os arquivos compatíveis para atendimento às obrigações perante o Tribunal de Contas do Estado de São Paulo, (MOVIMENTAÇÃO DOS FUNDOS- atualmente em xml, DREI, Rentabilidade dos Fundos e outros que vierem a ser exigidos pelo TRIBUNAL de Contas).

3.9) Auxílio na análise de credenciamento e suas renovações das instituições financeiras.

3.10) Contato direto com os consultores, à distância ou com a realização de, no mínimo, 4 visitas anuais à sede do CONTRATANTE, para fins de reunião com o Comitê de Investimentos, Conselho Administrativo ou outro órgão de deliberação acerca dos investimentos, para análise de mercado e posição da carteira a cada fechamento de trimestre.

3.11) Análise mensal, trimestrais e semestrais sobre a abertura da carteira de cada um dos fundos de investimentos onde o Instituto possui valores alocados através do arquivo “xml” que deverá ser disponibilizado pela contratante, tanto para atendimento ao informativo DAIR(Secretária da Previdência) como em atendimento ao Manual PRÓ Gestão versão 3.5 ou a versão atualizada que vier a substituí-lo, detalhados sobre a rentabilidade e risco das diversas modalidades e operações realizadas pelo Instituto na área de investimentos nos moldes abaixo:

a) Verificação dos ativos que compõem o patrimônio dos fundos de investimentos incluindo os títulos e valores mobiliários aplicados pelo RPPS;

b) Análise da situação patrimonial, fiscal e comercial, das empresas investidas, por meio de fundos de investimentos em participações – FIP;

c) Análise do relatório de rating dos ativos de renda fixa, aplicações direta em ativos financeiros de renda fixa, fundos de investimentos de investimentos em direitos creditórios (FIDC), fundos de renda fixas – CRÉDITO PRIVADO, fundos de debentures de infra estrutura;

d) Análise do relatório de avaliação de imóveis quando houver fundo de investimentos na carteira de investimentos.

3.12) Análise e confecção de relatório mensal do período de setembro a dezembro/2024, por meio de documentos a serem fornecidos pela contratante.

3.13) Análise e confecção de relatório anual do exercício de 2024 e confecção e apresentação do Relatório ALM referente ao exercício de 2024.

4. DAS OBRIGAÇÕES

- 4.1. Envidar seus melhores esforços na prestação dos serviços;
- 4.2. Efetuar as análises solicitadas pelo CONTRATANTE,
- 4.3. Manter os padrões de qualidade e metodologias específicas, informando previamente qualquer alteração que venha a ser introduzida por razões de ordem técnica (“up grade”), de mercado ou derivada de nova regulamentação do setor;
- 4.4. Na hipótese de alteração das metodologias utilizadas, oferecer, caso seja necessário, material para treinamento adicional ao pessoal técnico do CONTRATANTE;
- 4.5. Utilizar sistemas seguros de comunicação e processamento de informações, que preservem a confidencialidade das informações individuais recebidas e processadas, com base em padrões normalmente aceitos no mercado ou pelas partes;
- 4.6. Iniciar imediatamente estudos e procedimentos destinados a contornar qualquer problema detectado na prestação dos serviços;
- 4.7. Utilizar metodologias e critérios baseados em séries de desempenho histórico dos ativos e/ou instituições analisadas.

5. DAS CONDIÇÕES ESSENCIAIS DE PARTICIPAÇÃO DAS EMPRESAS DE CONSULTORIA DE VALORES MOBILIÁRIOS

5.1) A empresa de Consultoria de Valores Mobiliários deverá declarar que o Consultor que está cadastrado na Comissão de Valores Mobiliários (CVM) como Consultor de Valores Mobiliários é quem irá prestar os serviços de Consultoria em Valores Mobiliários descritos no objeto deste documento;

5.2) A empresa de Consultoria de Valores Mobiliários deverá comprovar que seu cadastro junto à CVM se encontra em situação normal e, está única e exclusivamente como CONSULTOR DE VALORES MOBILIÁRIOS.

A comprovação referente ao cadastro da empresa deverá ser apresentada conforme critérios estabelecidos pela CVM:

5.3) A empresa de Consultoria de Valores Mobiliários deverá comprovar que o Consultor Pessoa Física que está habilitado na CVM como sendo o Consultor de Valores Mobiliários da referida empresa está com seu cadastro em situação normal, sendo que este referido Consultor tem que estar cadastrado única e exclusivamente como CONSULTOR DE

VALORES MOBILIÁRIOS, não podendo jamais ser também prestador de serviços de agente autônomo de investimentos, ou distribuidor, ou de administração de carteiras (O Consultor deverá apresentar declaração de que não presta esses referidos serviços).

A comprovação referente ao cadastro do Consultor deverá ser apresentada conforme critérios estabelecidos pela CVM:

6.CONDIÇÕES E FORMAS DE PAGAMENTO:

6.1 - A EMPRESA deverá emitir mensalmente fatura em moeda corrente nacional, que deverá vir complementada por Declaração expedida pela empresa sobre sua regularidade fiscal (previdenciária, FGTS e cumprimento de deveres trabalhistas), no dia seguinte ao fechamento do mês da prestação do serviço realizada.

6.2 - A AUTARQUIA terá o prazo de 05 (cinco) dias úteis, a contar da apresentação da Fatura para aceitá-la ou rejeitá-la.

6.3 - A Fatura não aprovada será devolvida para as correções necessárias, com as informações que motivaram sua rejeição, contando-se o prazo estabelecido no item anterior, a partir da data de sua reapresentação.

6.4 - A devolução da Fatura não aprovada não justificará a interrupção da locação.

6.5 – A AUTARQUIA deverá efetuar o pagamento do valor devido, através de boleto bancário, que será enviado junto com a fatura, até o 5º dia útil seguinte ao fechamento do mês de locação realizada.

6.5.1 - Na falta do boleto bancário, o pagamento poderá ser feito através de depósito bancário identificado na conta corrente indicada pela EMPRESA.

6.5.2 - Em caso de atraso injustificado do pagamento da parcela mensal, a empresa EMPRESA, independentemente de notificação prévia, poderá cobrar multa de 2% (dois por cento) sobre o valor do atraso e juros de 1%(um por cento) ao mês sobre o valor devido acrescido da multa até a data do efetivo pagamento.

7. OBRIGAÇÕES DA EMPRESA CONTRATADA:

A EMPRESA obrigar-se-á a:

7.1) Conduzir e executar os serviços ora ajustados de acordo com as disposições contratuais e dos documentos que o integram, e com estrita obediência à legislação em vigor;

7.2) Prover os serviços ora contratados com pessoal adequado, capacitado e devidamente habilitado, de modo a fornecer os serviços com a qualidade técnica que estes exigem, e em estrito atendimento na normatização a eles pertinentes.

7.3) Manter durante toda a execução contratual as condições iniciais de habilitação, exigidas na licitação.

8. OBRIGAÇÕES DA AUTARQUIA:

8.1) Efetuar o pagamento das faturas em seus devidos vencimentos;

8.2) Prestar todas as informações solicitadas pela EMPRESA.

9. REQUISITOS LEGAIS PARA CONTRATAÇÃO (exceto se houver processo licitatório, cujos itens serão tratados em correspondente edital).

9.1) Habilitação fiscal, social e trabalhista:

A EMPRESA deverá apresentar quando SOLICITADA, desde que não tenham sido obtidas previamente pelo Instituto, sua:

9.1.1) a inscrição no Cadastro de Pessoas Físicas (CPF) ou no Cadastro Nacional da Pessoa Jurídica (CNPJ);

9.1.2) a inscrição no cadastro de contribuintes estadual e/ou municipal, se houver, relativo ao domicílio ou sede do licitante, pertinente ao seu ramo de atividade e compatível com o objeto contratual;

9.1.3) a regularidade perante a Fazenda federal, estadual e/ou municipal do domicílio ou sede do licitante, ou outra equivalente, na forma da lei;

9.1.4) a regularidade relativa à Seguridade Social e ao FGTS, que demonstre cumprimento dos encargos sociais instituídos por lei;

9.1.5) a regularidade perante a Justiça do Trabalho;

9.1.6) Habilitação econômico-financeira – A EMPRESA declarada vencedora deverá apresentar a certidão negativa de feitos sobre falência expedida pelo distribuidor da sede do licitante, sob pena de inabilitação.

9.2) Habilitação jurídica:

A EMPRESA declarada vencedora deverá apresentar as seguintes documentações:

9.2.1) Cópia xerográfica autenticada de seu contrato social em vigor, devidamente registrado, em se tratando de sociedades comerciais ou se sociedades por ações, deverá ser apresentado também documento de eleição de seus administradores. No caso de sociedade civil, inscrição do ato constitutivo, acompanhada de prova de diretoria em exercício. Em qualquer das situações, dentro da validade 01 ano, a contar da data da resposta enviada à Autarquia.

9.2.2) Declaração de que na Empresa não há realização de trabalho noturno, perigoso ou insalubre por menores de 18 (dezoito) anos, nem a realização de qualquer trabalho por menores de 16 (dezesesseis) anos, salvo na condição de aprendiz, a partir de 14 (quatorze) anos, segundo determina o inciso XXXIII do art. 7º da Constituição Federal, **modelo anexo I.**

9.2.3) Declaração de inexistência de imposição de penalidade de sanção que importe em vedação a participar de contratação ou licitação pública, **modelo anexo II.**

9.3) Habilitação técnica – Caso seja vendedora, a empresa deverá apresenta:

9.3.1) comprovação de experiência profissional anterior, mediante a apresentação de, no mínimo, 3 atestados de qualificação técnica, com indicação da pessoa jurídica – CNPJ (unidade gestora de RPPS), que possua a Certificação do Pró-Gestão no mínimo no Nível 2 de Certificação, com patrimônio igual ou superior a R\$ 500.000.000,00, que atestem a boa qualidade na execução dos trabalhos objeto da licitação (consultoria financeira), constando expressamente a realização do serviço de consultoria financeira e de Estudo de ALM (Asset Liability Management), com a indicação do consultor de valores mobiliários que realizara ou realiza a consultoria, emitidos até 01 anos antes, a contar da data de abertura da sessão pública.

9.3.2) Apresentação de Certificado (s) válido (s) emitido (s) pela ANBIMA – Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais ou entidade equivalente sendo no mínimo o CPA-20 ou superior, limitados a 5 certificados.

10) Na ausência da entrega de algum documento conforme “**item 9 – requisitos da contratação**”, a empresa será desclassificada.

11. PRAZO DO CONTRATO: __16 (dezesesseis) meses, podendo ser prorrogado até o limite legal, conforme Lei nº14.133, de 1º de abril de 2021.

ANEXO I

MODELO

MODELO DE DECLARAÇÃO DE QUE NÃO UTILIZA MÃO-DE-OBRA DIRETA OU INDIRETA DE MENORES (papel timbrado)

A empresa _____, inscrita no CNPJ sob o nº _____, com sede em _____, na rua _____, nº _____, DECLARA, sob as penas da Lei e para fins do disposto no inciso XXXIII do art. 7º da Constituição Federal, que não utiliza mão-de-obra direta ou indireta de menores de 18 anos para realização de trabalhos noturnos, perigosos ou insalubres, bem como não utiliza, para qualquer trabalho, mão-de-obra direta de menores de 16 anos, exceto na condição de aprendiz, a partir de 14 anos.

Local, data.

Representante legal – Nome – Assinatura
Cargo

ANEXO II

MODELO

DECLARAÇÃO DE INEXISTÊNCIA DE IMPEDIMENTO LEGAL PARA LICITAR (papel timbrado)

A empresa _____, inscrita no CNPJ sob o nº _____, com sede em _____, na rua _____, nº _____, DECLARA, sob as penas da Lei, inexistir impedimento legal para licitar ou contratar com a Administração Pública, bem como inexistir punição de suspensão do direito de licitar, abrangendo o termo “Administração”.

Local, data.

Representante legal – Nome – Assinatura
Cargo