



ATESTADO DE CAPACIDADE

ATESTAMOS para os devidos fins que a empresa DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA, CNPJ 03.866.812/0001-02 apresenta capacidade técnica para desempenhar serviços de Consultoria de Valores Mobiliários na Área de Investimentos, com ferramenta proprietária web - software denominado LIASYS GESTÃO DE INVESTIMENTOS – com funcionalidades compatíveis com Nível 4 da Certificação Institucional Pró-Gestão - Regimes Próprios de Previdência Social – RPPS e demais clientes Institucionais, com os seguintes serviços:

- **Elaboração de estudos de gestão de ativos e passivos por estudo do ALM (*Asset Liability Management*), com base nos pareceres atuariais, via modelagem determinística, Fronteira Eficiente de Markowitz e modelo de *Cash Flow Matching*.**
- **Estudo de Solvência.**
- Disponibilização de acompanhamento gerencial das carteiras de investimentos (plataforma), com acesso por meio da internet (web) com requisitos que incluem, mas não se limitam a:
 - a) Controle de acesso seguro e individualizado para o cliente; múltiplas carteiras;
 - b) Informação dos dados referentes aos investimentos do cliente;
 - c) Realização de lançamentos diários de aplicações, resgates, com emissão das respectivas Autorizações de Aplicação e Resgate – APR;
 - d) Acesso ao sistema em modo consulta por qualquer membro da administração do cliente;
 - e) Disponibilização das informações de rentabilidade e patrimônio líquido de todos os fundos de investimento registrados na CVM; Carteira de Títulos Públicos Federais e outros ativos;
 - f) Exibição de relatórios com rendimento, rentabilidade, risco, saldo, patrimônio líquido e percentual de alocação dos ativos de cada carteira de investimento cadastrada;
 - g) Módulo Credenciamento de Instituições Financeiras, Administradores, Gestores e do próprio Fundo de Investimento;
 - h) Módulo Investimentos - Audeps – Tribunal de Contas do Estado de São Paulo. Geração de informações para envio do "Demonstrativo da Rentabilidade e Evolução da Carteira de Investimentos";
 - i) Módulo Atribuição de Desempenho com cálculo da atribuição de desempenho por fundo de investimento/ativo e cálculo da atribuição de desempenho da carteira consolidada;
 - j) Apresentação de cálculo de Var, Índice de Sharpe e Volatilidade de cada investimento individualmente, e da carteira consolidada, por artigo, por benchmark;
 - k) Simulador de Ciclo de Vida, com parametrização do Patrimônio do RPPS, Fluxos de Caixa ao longo do tempo e Taxa de Juro Real;
 - l) Simulador que permita identificar o nível de risco, rentabilidade, dispersão, adequação aos limites de aderência da política de investimento e normalização legal;
- Abertura de carteiras dos fundos investidos até o último nível, mediante fornecimento de arquivo XML da ANBIMA.
- Disponibilização de informações mensais o DAIR e DPIN para o sistema “CADPREV-Ente Local”, sistema da SPREV.
- Sistema proprietário em plataforma web, modelagem dinâmica, com a ferramenta Otimizador de Carteira, para escolha, acompanhamento e ranqueamento de fundos de investimento.
- Análise, diagnóstico e assessoria para recuperação de ativos, dentre os quais fundos de investimentos ilíquidos.

Paragominas, 26 de fevereiro de 2021.

RAULISON DIAS
PEREIRA:0335689221
5

Assinado de forma digital por
RAULISON DIAS
PEREIRA:03356892215
Dados: 2021.02.26 09:31:32 -03'00'

Ráulison Dias Pereira
Presidente do IPMP