

PORTARIA RIOPREVIDÊNCIA/PRE Nº **164** DE **17** DEZEMBRO DE 2009.

PUBLICADO

22 DEZ 2009

DIÁRIO OFICIAL

Estabelece os procedimentos para o credenciamento e a seleção das instituições financeiras autorizadas a operar com o RIOPREVIDÊNCIA e dá outras providências.

O Diretor-Presidente do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro-RIOPREVIDÊNCIA, no uso das atribuições que lhe confere a Lei Estadual nº 3.189, de 22 de fevereiro de 1999, tendo em vista o disposto na Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 3.790, de 24 de setembro de 2009 e alterações posteriores, e com o objetivo de estabelecer os procedimentos para o credenciamento e a seleção das instituições financeiras autorizadas a operar com o RIOPREVIDÊNCIA,

RESOLVE:

Art. 1.º As instituições financeiras credenciadas a operar com o RIOPREVIDÊNCIA poderão receber recursos para depósitos à vista ou a prazo e para aplicações financeiras, inclusive em fundos de investimento, operações compromissadas e carteiras administradas, respeitadas as diretrizes estabelecidas na Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 3.790/09 e alterações posteriores, como também em outras normas jurídicas em vigor e no Plano Anual de Investimentos (PAI).

Art. 2.º Serão admitidas até seis instituições financeiras credenciadas, sendo que, relativamente às instituições integrantes de um mesmo conglomerado financeiro, a participação de uma delas impossibilita o credenciamento de qualquer outra.

Parágrafo único. Entende-se por conglomerados financeiros aqueles assim considerados pelo Sistema de Informações sobre Entidades de Interesse do Banco Central - Unicad e, para os fins deste artigo, que contem com a presença de pelo menos uma instituição financeira.

Art. 3.º Constituem pré-requisitos cumulativos para o credenciamento da instituição financeira:

I - estar a instituição financeira, ou alguma outra instituição do mesmo conglomerado financeiro, listada entre as 30 maiores administradoras de fundos de investimento por patrimônio líquido ou entre as 30 maiores gestoras de fundos de investimento, de acordo com o ranking mais recente divulgado pela



Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e Capitais (ANBIMA);

II - possuir a instituição financeira gestora classificação (*rating*) de gestão de fundos de investimento, elaborada por agência de classificação de risco;

III - declaração da instituição financeira administradora do fundo de investimento de inexistência de penalidade imputada pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM), em razão de infração grave considerada pela autarquia ao gestor, à instituição financeira gestora e ao administrador do fundo, nos 5 (cinco) anos anteriores ao pedido de credenciamento.

Art. 4.º O RIOPREVIDÊNCIA não poderá ter cotas representativas de mais de 20% (vinte por cento) do patrimônio de um único fundo de investimento, bem como manter mais de 20% (vinte por cento) de suas disponibilidades em aplicações lastreadas em títulos ou valores mobiliários de emissão de uma mesma pessoa jurídica, ou instituição que pertença ao mesmo conglomerado financeiro.

Art. 5.º As instituições serão selecionadas, semestralmente, mediante avaliação de desempenho nos seguintes fatores:

I - instituição candidata:

a) Taxa de administração do fundo de investimento referenciado ou renda fixa, adequado à Resolução CMN nº 3.790/09 e alterações posteriores, de maior patrimônio líquido dentre os apresentados para o credenciamento;

b) Proposta firme de rentabilidade mínima em percentual do CDI para todas as operações compromissadas com liquidez diária, lastreadas em títulos públicos federais com valor mínimo de R\$ 50.000.000,00, a serem realizadas com o RIOPREVIDÊNCIA durante o período de credenciamento;

c) Custo total para administração, custódia e gestão de carteira administrada de títulos públicos federais;

d) Será utilizado como critério de desempate o prazo de resgate do fundo de investimento.

II - instituição credenciada: retorno e volatilidade dos investimentos em cotas de fundos de investimento, carteira administrada e operações compromissadas,



realizados com a instituição financeira, selecionados pelo RIOPREVIDÊNCIA, e relacionamento com o RIOPREVIDÊNCIA.

Parágrafo único. Para os fins do disposto nesta Portaria, considera-se:

I – retorno: variação percentual do valor da cota do fundo de investimento, da rentabilidade da carteira administrada ou da operação compromissada durante o período de credenciamento, líquidas da taxa de administração e demais despesas;

II – volatilidade: desvio padrão da variação diária da cota do fundo de investimento e da rentabilidade da carteira administrada em relação à SELIC-OVER, durante o período de credenciamento, líquidas da taxa de administração e demais despesas;

III – relacionamento: adoção, sem ônus para o RIOPREVIDÊNCIA e durante os 6 (seis) meses anteriores à avaliação, de medidas como:

- a) envio periódico de relatórios de informações de mercado ou de análises técnicas;
- b) realização de apresentações sobre cenários macroeconômicos ou outros assuntos de interesse do RIOPREVIDÊNCIA;
- c) disponibilização de canal de voz entre a mesa de operações do RIOPREVIDÊNCIA e a da instituição financeira ou de acesso telefônico ao gestor do fundo de investimento;
- d) promoção de cursos ou seminários aos servidores do RIOPREVIDÊNCIA, relacionados com a área de investimentos.

Art. 6.º A avaliação das instituições financeiras se dará semestralmente, pela média das avaliações dos itens relacionados no art. 5º, observados os seguintes pesos:

Fator de Avaliação	Instituição Credenciada	Instituição Candidata
Retorno	45%	
Volatilidade	15%	
Relacionamento	40%	
Taxa de Administração de Fundo de Investimento		50%
Rentabilidade da Operação Compromissada		25%
Custo da Carteira Administrada		25%



§ 1.º A avaliação das instituições financeiras ocorrerá semestralmente, observados os critérios mencionados na tabela.

§ 2.º A avaliação considerará exclusivamente fundos de investimento classificados pela Comissão de Valores Mobiliários como referenciados DI e fundos de renda fixa que possam receber recursos de Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS), conforme regulamentação do Conselho Monetário Nacional (CMN) e do Ministério da Previdência Social (MPS).

§ 3.º Para a avaliação das instituições credenciadas, o cálculo dos índices de retorno e volatilidade terá como base a média ponderada pelos valores investidos.

§ 4.º Caberá à Gerência de Operações e Planejamento (GOP) realizar mensalmente a avaliação das instituições financeiras, ressalvado o disposto no § 5.º deste artigo.

§ 5.º Dar-se-á a nota final de relacionamento pela média aritmética das notas mensais atribuídas a cada instituição financeira credenciada no período de avaliação, em grau de 0 (zero) a 10 (dez), mediante proposta, acompanhada de relatório fundamentado, da Gerência de Operações e Planejamento e aprovação da Diretoria Executiva do RIOPREVIDÊNCIA.

§ 6.º As instituições financeiras serão ordenadas em ordem de classificação para cada fator de avaliação, calculando-se a pontuação final por cada fator da seguinte forma:

I – para instituições candidatas: 30 (trinta) pontos para a primeira colocada, decrescendo um ponto por colocação para as demais;

II – para instituições credenciadas: 6 (seis) pontos para a primeira colocada, decrescendo um ponto por colocação para as demais.

§ 7.º A pontuação final da instituição financeira credenciada será apurada pela seguinte fórmula:

$$P = 0,45 \cdot Ret + 0,15 \cdot Vol + 0,40 \cdot Rel \text{ onde:}$$

P = pontuação final da instituição financeira;

Ret = pontuação obtida no fator de avaliação “retorno”;

Vol = pontuação obtida no fator de avaliação “volatilidade”;

Rel = pontuação obtida no fator de avaliação “relacionamento”.



§ 8.º A pontuação final da instituição financeira candidata será apurada pela seguinte fórmula:

$$P = 0,50 \cdot FI + 0,25 \cdot OC + 0,25 \cdot CA$$

onde:

P = pontuação final da instituição financeira;

FI = pontuação obtida no fator de avaliação "taxa de administração do Fundo de Investimento";

OC = pontuação obtida no fator de avaliação "rentabilidade mínima de operação compromissada";

CA = pontuação obtida no fator de avaliação "custo total da carteira administrada".

Art. 7.º A lista das instituições financeiras credenciadas será publicada semestralmente na página da Internet do RIOPREVIDÊNCIA.

Art. 8.º O RIOPREVIDÊNCIA poderá alocar recursos em qualquer aplicação financeira administrada, gerida ou distribuída pelas instituições financeiras credenciadas, devendo ser observada a legislação em vigor e as diretrizes do Plano Anual de Investimentos e do Comitê de Investimentos.

Parágrafo único. O credenciamento de instituição financeira, para os fins desta Portaria, não gerará para o RIOPREVIDÊNCIA, em nenhuma hipótese, a obrigação de alocar ou manter alocados recursos nas aplicações financeiras por ela administradas, geridas ou distribuídas.

Art. 9.º As instituições financeiras interessadas em se candidatar ao credenciamento deverão cadastrar-se junto à Gerência de Operações e Planejamento, mediante manifestação por escrito, durante o período de avaliação.

§ 1.º Os requerimentos para o cadastramento de que cuida o *caput* deste artigo deverão ser instruídos, sob pena de indeferimento, com a documentação comprobatória dos fatores indicados no artigo 5º inciso I da presente Portaria.

§ 2.º Os períodos de cadastramento serão de 22 a 30 de junho e de 21 de dezembro a 8 de janeiro.

§ 3.º Não havendo expediente no RIOPREVIDÊNCIA no dia do início ou término do período de cadastramento, considera-se prorrogado o prazo para o primeiro dia útil seguinte.



Art. 10. A instituição financeira credenciada que, na avaliação semestral, estiver classificada na última colocação, será descredenciada, podendo-se convidar ao credenciamento a instituição financeira candidata que, na avaliação concernente ao mesmo semestre, for classificada na primeira colocação.

Parágrafo único. Caso a instituição financeira candidata e convidada ao credenciamento não aceite o convite, a instituição financeira candidata e classificada na posição imediatamente posterior será convidada a ocupar a vaga.

Art. 11. Os casos omissos serão decididos pela Diretoria Executiva do RIOPREVIDÊNCIA.

Art. 12. Revoga-se a Portaria RIOPREVIDÊNCIA/PRE nº 155, de 22 de junho de 2009.

Art. 13. Esta Portaria entra em vigor na data de sua publicação.

Rio de Janeiro, 17 de dezembro de 2009

WILSON RISOLIA RODRIGUES

Diretor-Presidente

RIOPREVIDÊNCIA

original assinada.

