

# Novos Fundos da Banestes DTVM

Administradora e Gestora dos Fundos de  
Investimento Banestes

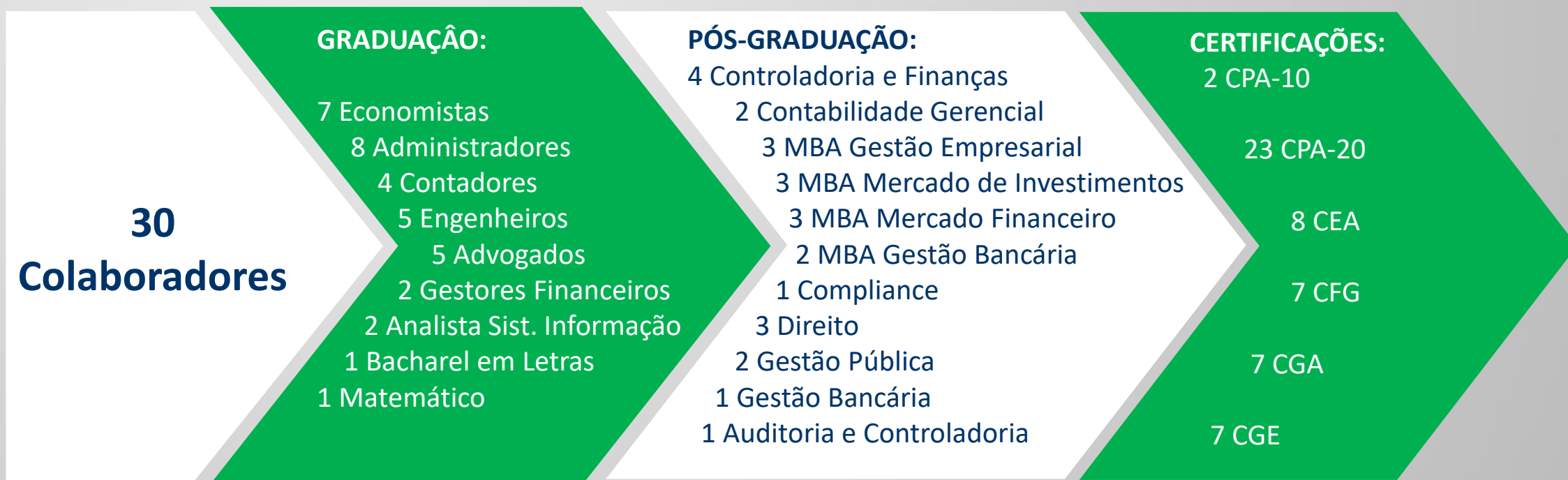


# Highlights da Banestes DTVM

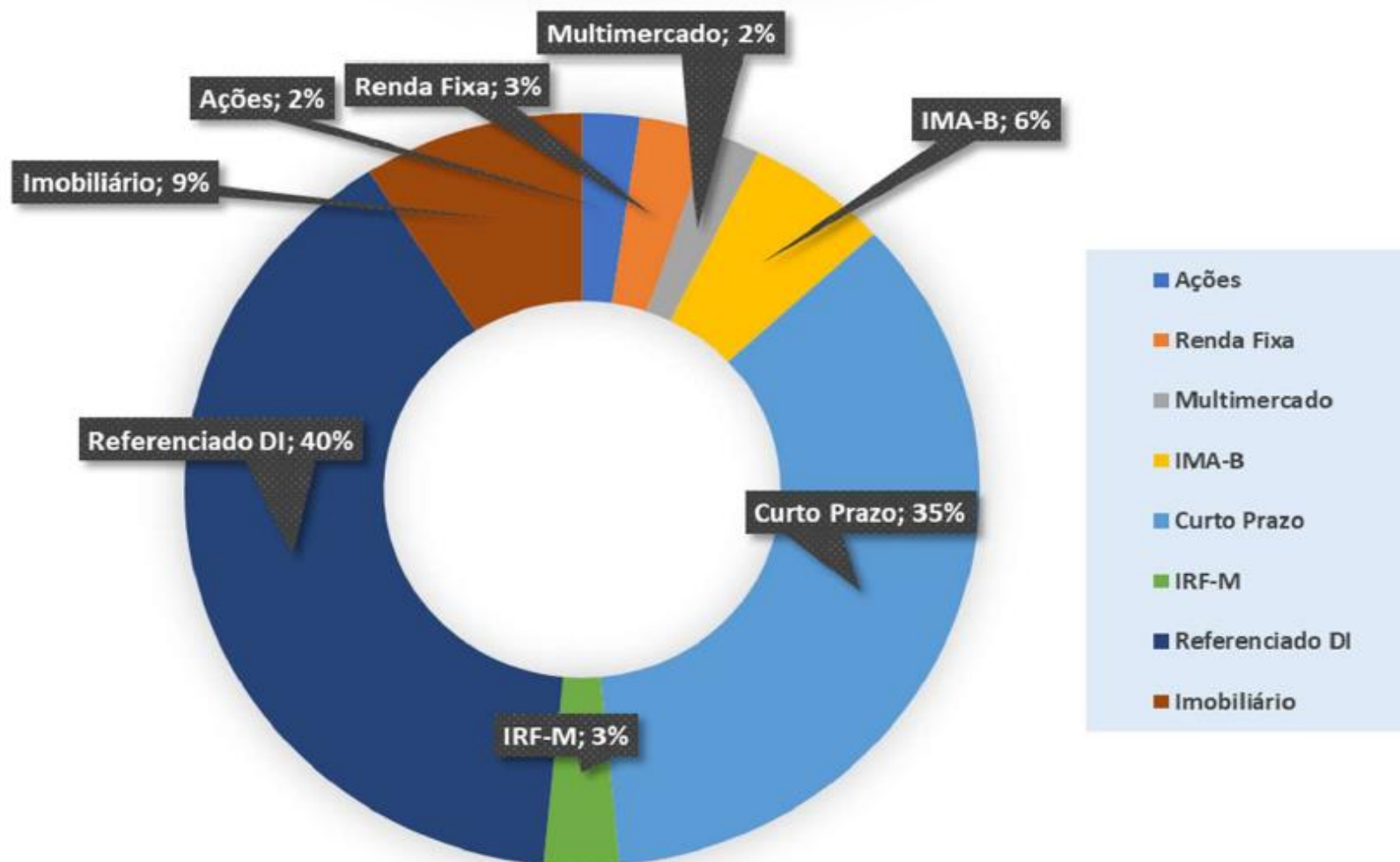
## Empresa do Sistema Financeiro Banestes especializada na Administração e Gestão de fundos de Investimento

- ✓ Fundada no ano de 1968, em 2023 completou 55 anos de história;
- ✓ Em 2015 tornou-se Gestora exclusiva dos Fundos de Investimento Banestes;
- ✓ Em 2021 incorporou o serviço de Administração dos Fundos de Investimento Banestes;
- ✓ Atualmente gere um patrimônio mais de R\$ 7 bilhões divididos em 23 Fundos de Investimento;
- ✓ Conta com a confiança de mais de 60 mil clientes espalhados em todas as unidades da federação;
- ✓ Possui um portfólio de produtos premiados e adequados para atender todos os tipos de investidores.

# Capacitação técnica da equipe



# Recursos sob gestão: R\$ 7,2 bilhões



**BANESTES DTVM**

Orçado x Realizado - Descrição 1

Descrição  
Pesquisar

Selecionar tudo

Amortizações e Depreciações

Despesas Administrativas

Despesas de Pessoal

Despesas Tributárias

Outras Despesas Operacionais

Outras Receitas

Outras Receitas Operacionais

Participações no Lucro (Diretoria)

Receita com Fundos

Receita com Plataforma de Investimento

Resultado Não Operacional

Resultado Operações c/Títulos

Tributação

Orçado x Realizado - Jan a Ago/ 2023

Orçado x Realizado - Descrição 2

Orçado x Realizado - Descrição 3

**BANESTES DTVM**

Número de operações

Ativos Negociados

Contrapartes associadas

Ano

Todos

Operações por ATIVO

Operações por Fundo

Tipos de Operações mais realizadas

**BANESTES DTVM**

Estados 3

Cidades 108

Estado ESCOLHA O ESTADO:  
Seleções múltiplas

Cidade ESCOLHA A CIDADE:  
Todos

Concentração por cidade

Tipo de Clientes

Saldo PF e PJ por Fundo

**BANESTES DTVM**

Orçado

Realizado

Alcance

Disponível

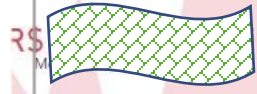
Receita por Fundos

Orçado e Realizado por Mês - Receita

Receita Segmentada

KPI por Mês - Receita

# Inovação, Controle e Gestão



# Prêmios / Reconhecimento



OS  
**melhores**  
GESTORES  
**de fundos**  
DO MERCADO

**PRÊMIO** Melhor gestor especialista de fundos DI e curto prazo

**RANKING** As melhores gestoras especialistas de fundos DI e curto prazo

1º XP / 2º Banestes / 3º BTG Pactual

Os gestores responsáveis pelos maiores retornos dos últimos 12 meses revelam suas projeções para a economia, os juros, a bolsa e o mercado externo — e contam como estão investindo para ganhar dinheiro no novo cenário de juros baixos

JULIANA ELIAS, KARLA MAMONA,  
MARÍLIA ALMEIDA E NATÁLIA FLACH

## Os melhores na renda fixa

Gestor	Verdes	Amarelos	Vermelhos	Total
Western	13	4	0	17
BRAM - Bradesco	11	15	23	49
BB DTVM	11	11	20	42
Itaú Unibanco	11	10	3	24
Santander	7	8	6	21
Caixa	6	13	17	36
Icatu Vanguarda	6	1	2	9
Banrisul	5	5	2	12
BNP Paribas	5	2	0	7
Banestes	5	1	2	8
BTG Pactual	4	3	3	10
Votorantim	3	4	4	11
Sul América	3	3	0	6
Safra	2	2	0	4
CA Indosuez	2	0	0	2
Sicredi	1	3	1	5
BRB	1	2	0	3
AZ Quest	1	1	1	3
Daycoval	1	0	1	2
AF Invest	1	0	0	1

Gestor	Verdes	Amarelos	Vermelhos	Total
GF Gestão	1	0	0	1
J. Malucelli	1	0	0	1
JGP	1	0	0	1
Multinvest	1	0	0	1
Opportunity	1	0	0	1
Roma	1	0	0	1
Sparta	1	0	0	1
BNB	0	3	4	7
Capitania	0	2	0	2
Mongeral Aegon	0	2	0	2
Infinity	0	1	1	2
XP	0	1	1	2
Brasil Plural	0	1	0	1
Invexa	0	1	0	1
Phenon	0	1	0	1
Porto Seguro	0	1	0	1
Rio Bravo	0	1	0	1
Única	0	0	3	3
Elleven	0	0	2	2
Novero	0	0	1	1

22 - INVESTIDOR INSTITUCIONAL - Março de 2019

# Prêmios / Reconhecimento



Ranking InfoMoney / Ibmecc 2021







Clube FII 2023



# Prêmios / Reconhecimento



Ranking  
Liderança e Inovação em Gestão

1	 Tasso	34900 ITPX
2	 Lucia Almeida	31600 ITPX Veste S/A
1	 Tasso Lugon	34900 ITPX BANESTES DTVM
3	 Fernando	28100 ITPX Grupo Yamaha Brasil

**1º LUGAR - BANESTES DTVM**





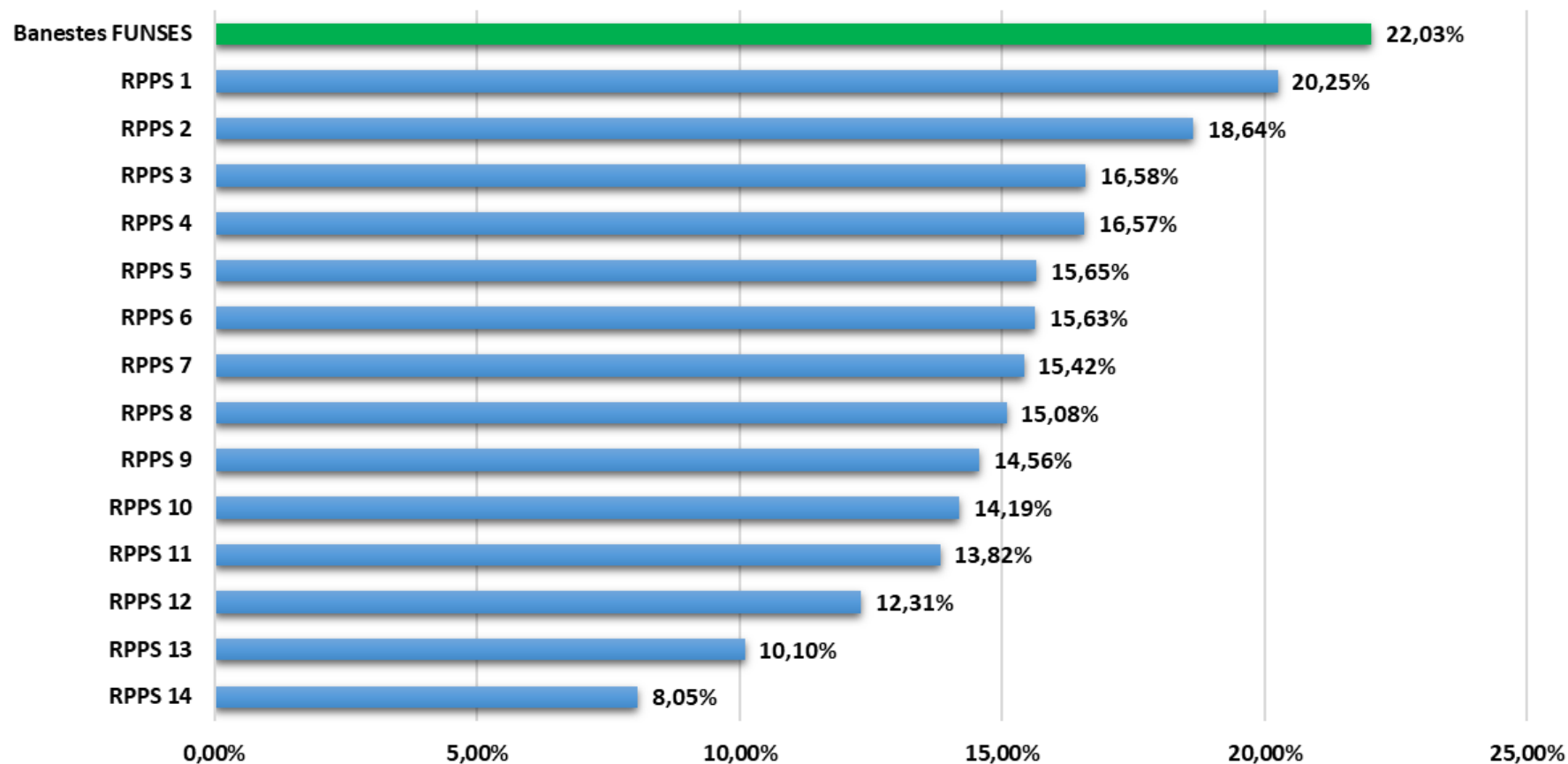
# Banestes Funses

Fundo de investimento multimercado



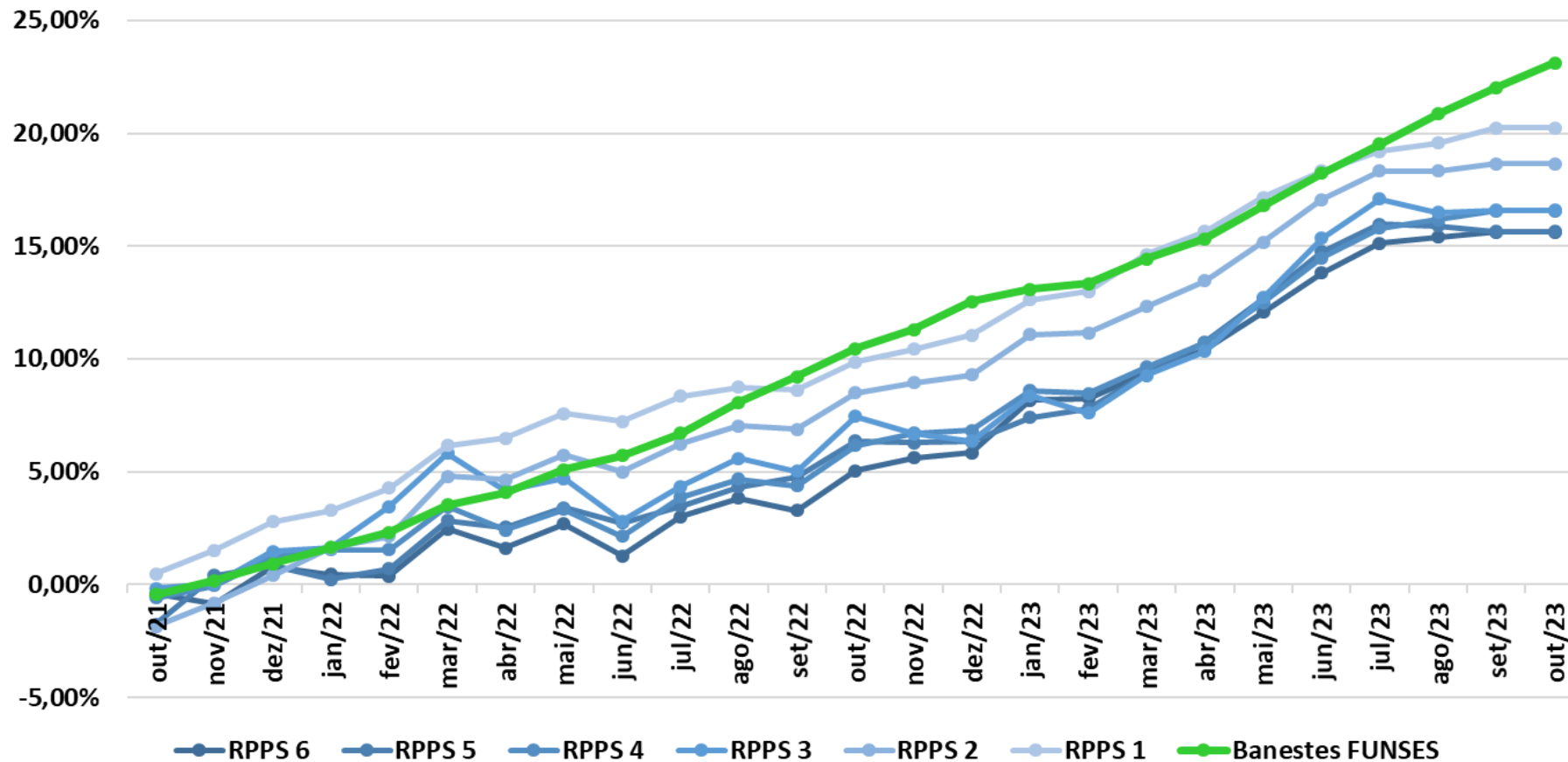
# Performance do Banestes Funeses vs. RPPS

## Rentabilidade Acumulada (out/21 até set/23)



# Performance do Banestes Funeses vs. RPPS

Rentabilidade Acumulada  
(out/21 até set/23)



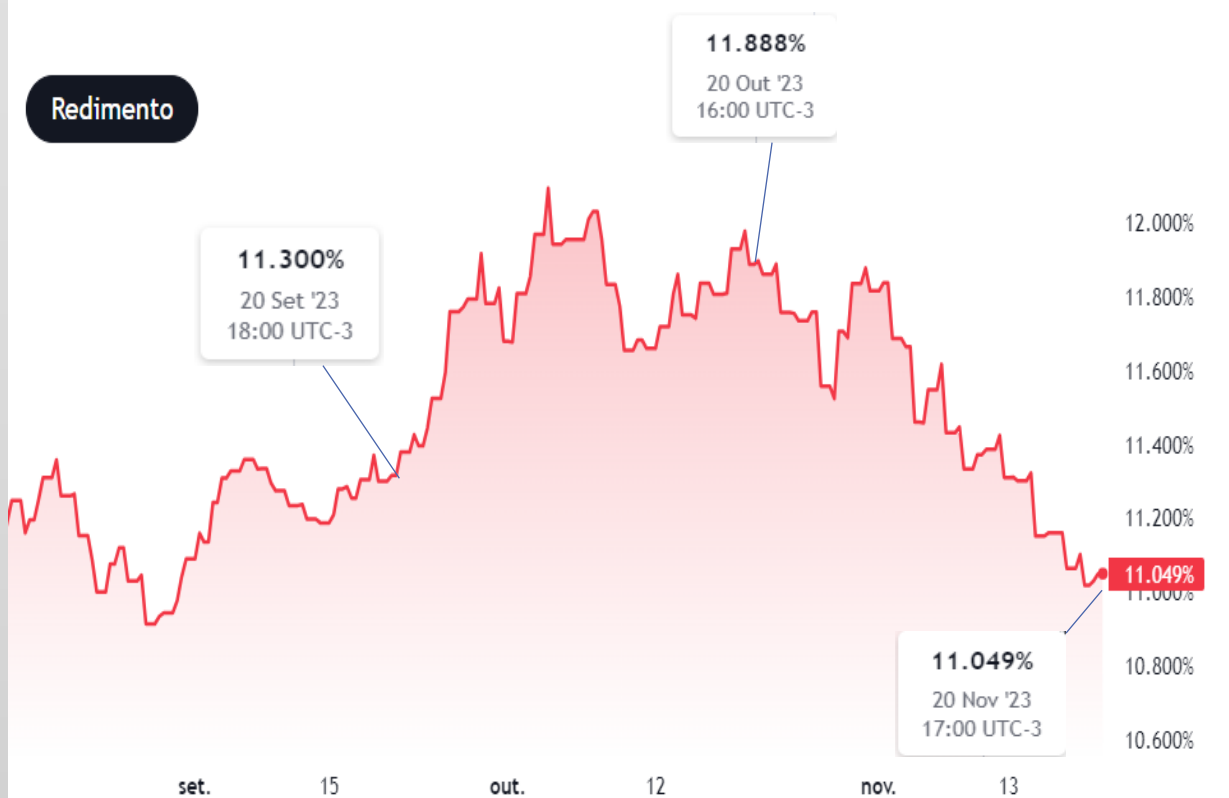
# Conjuntura e desempenho dos ativos num cenário de corte de juros



# Performance dos Ativos no ciclo de corte de juros

## Gráfico de BR10Y >

Redimento



## Gráfico de US10Y >

Redimento



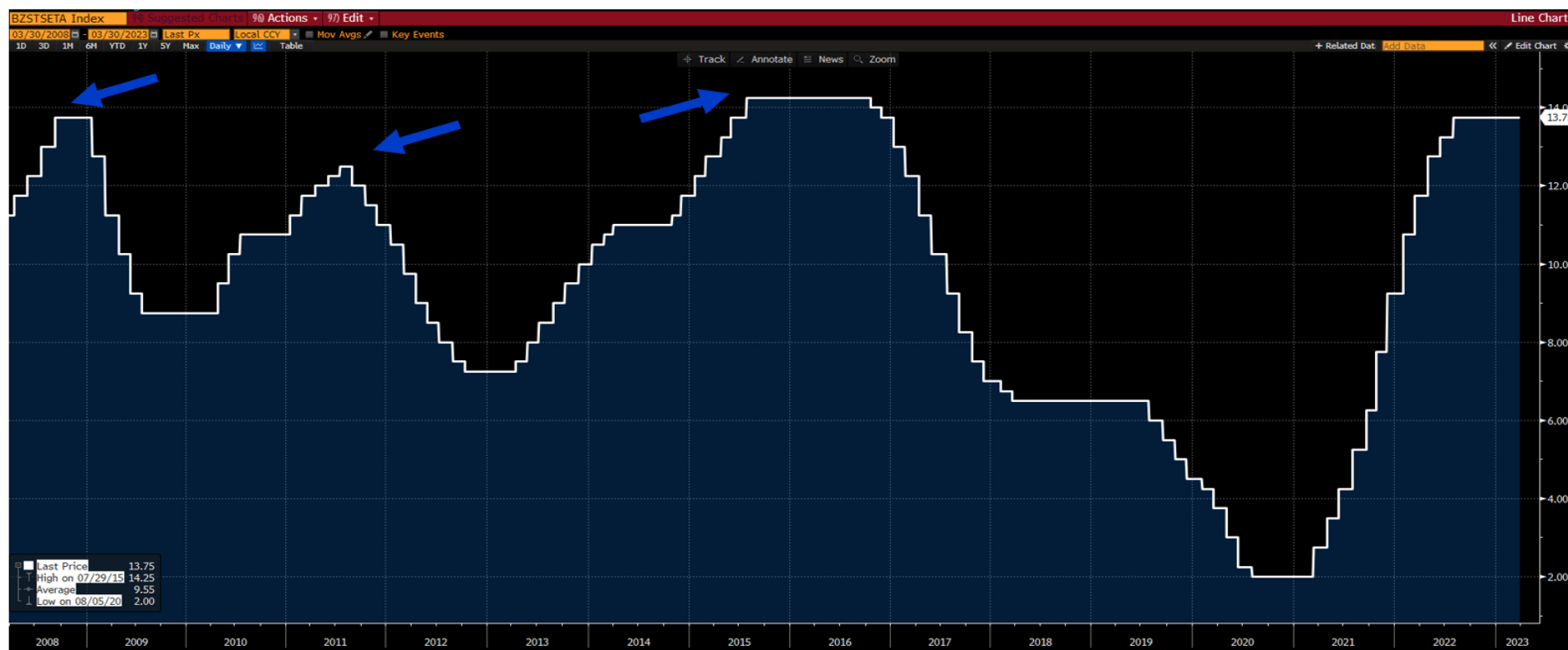
# Desempenho dos Ativos no ciclo de juros

## Selic | Últimos 15 anos



Como foram os índices nos períodos de juros elevados?

Taxa Selic  
Últimos 15 anos



Fonte: Bloomberg e BTG Pactual.

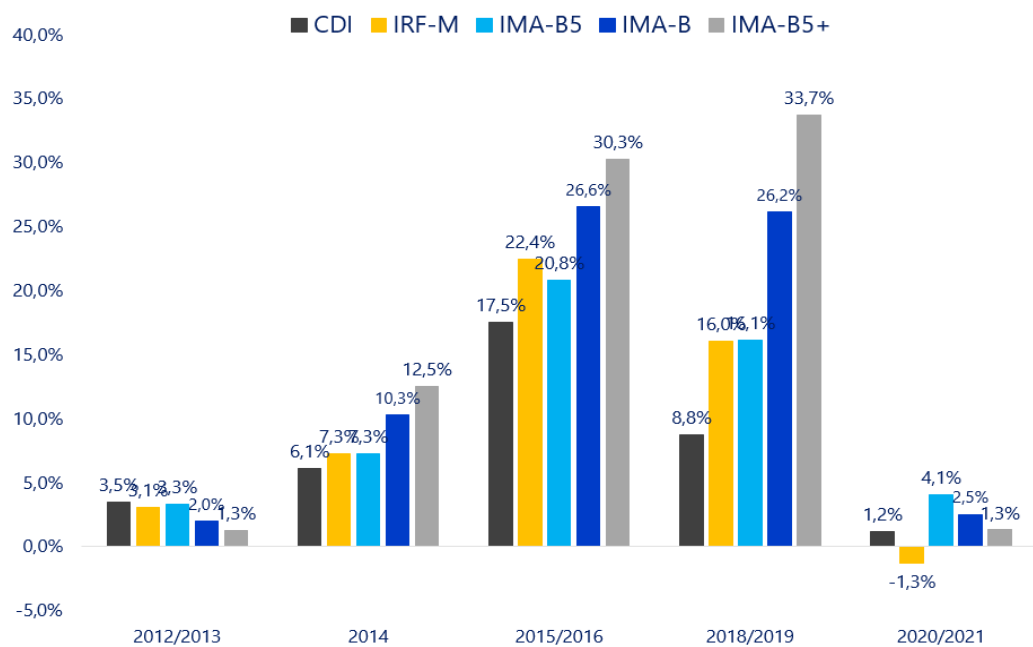
# Desempenho dos Ativos em diferentes ciclos de juros

## Classes de Ativos Renda Fixa – Diferentes Ciclos de Selic

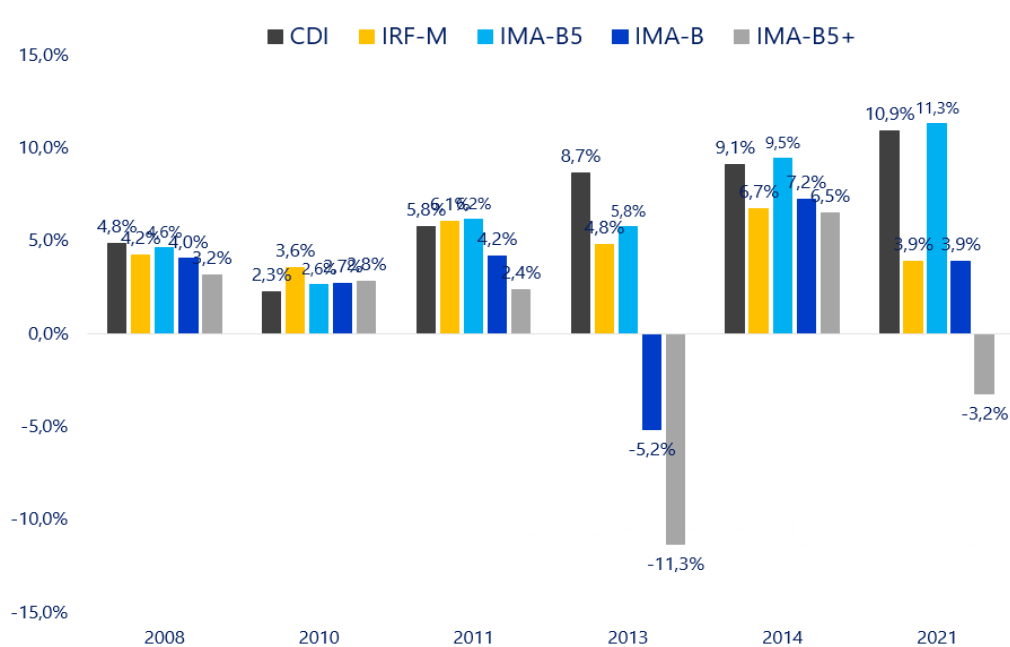


### Ciclos de Manutenção e Alta de Juros

Classes de Ativos Renda Fixa  
Ciclos de Manutenção da Selic



Classes de Ativos Renda Fixa  
Ciclos de Alta da Selic



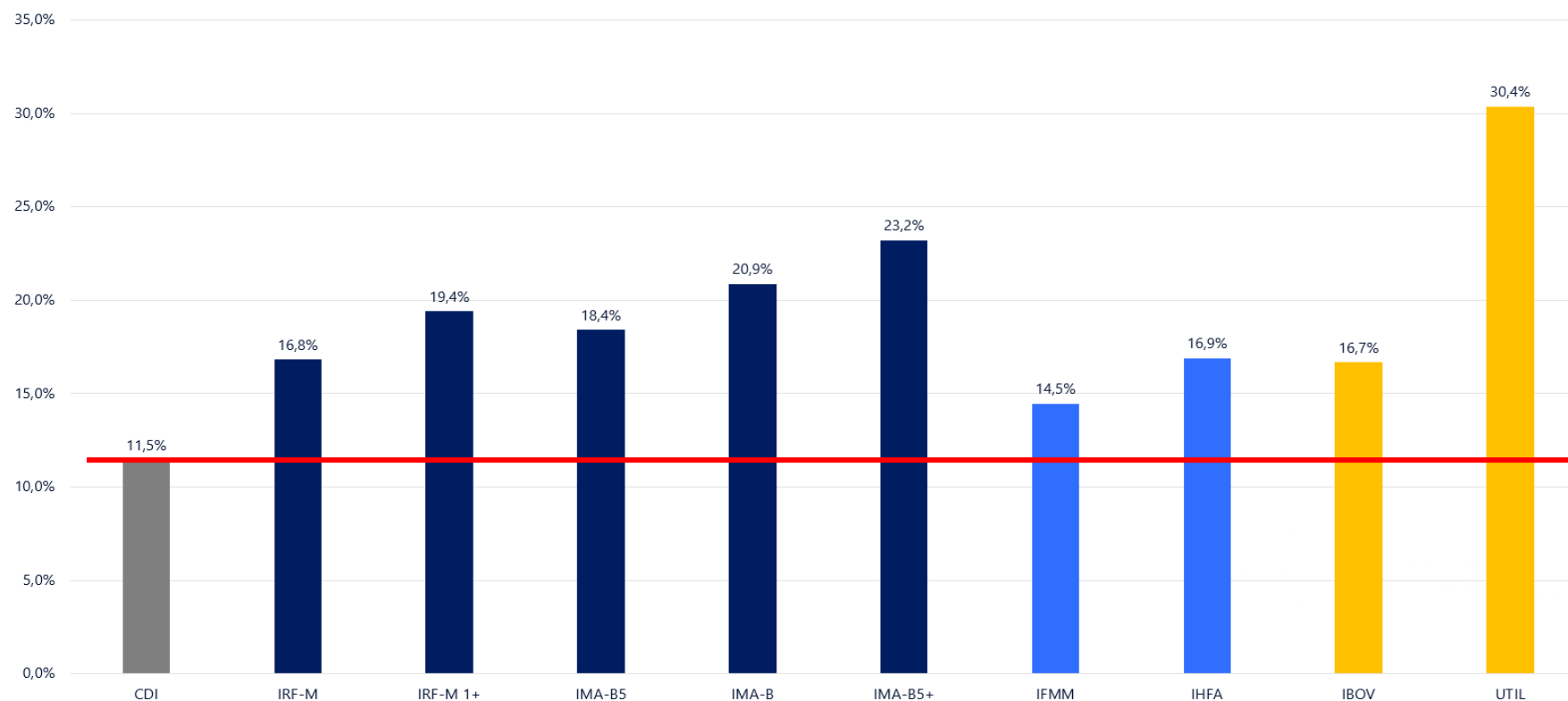
# Performance dos Ativos no ciclo de corte de juros

## Índices | Comportamento em juros elevados



Ciclo 2008/2009

Índices – Retorno 12 Meses após Selic atingir pico  
2008/2009



Fonte: Bloomberg e BTG Pactual.



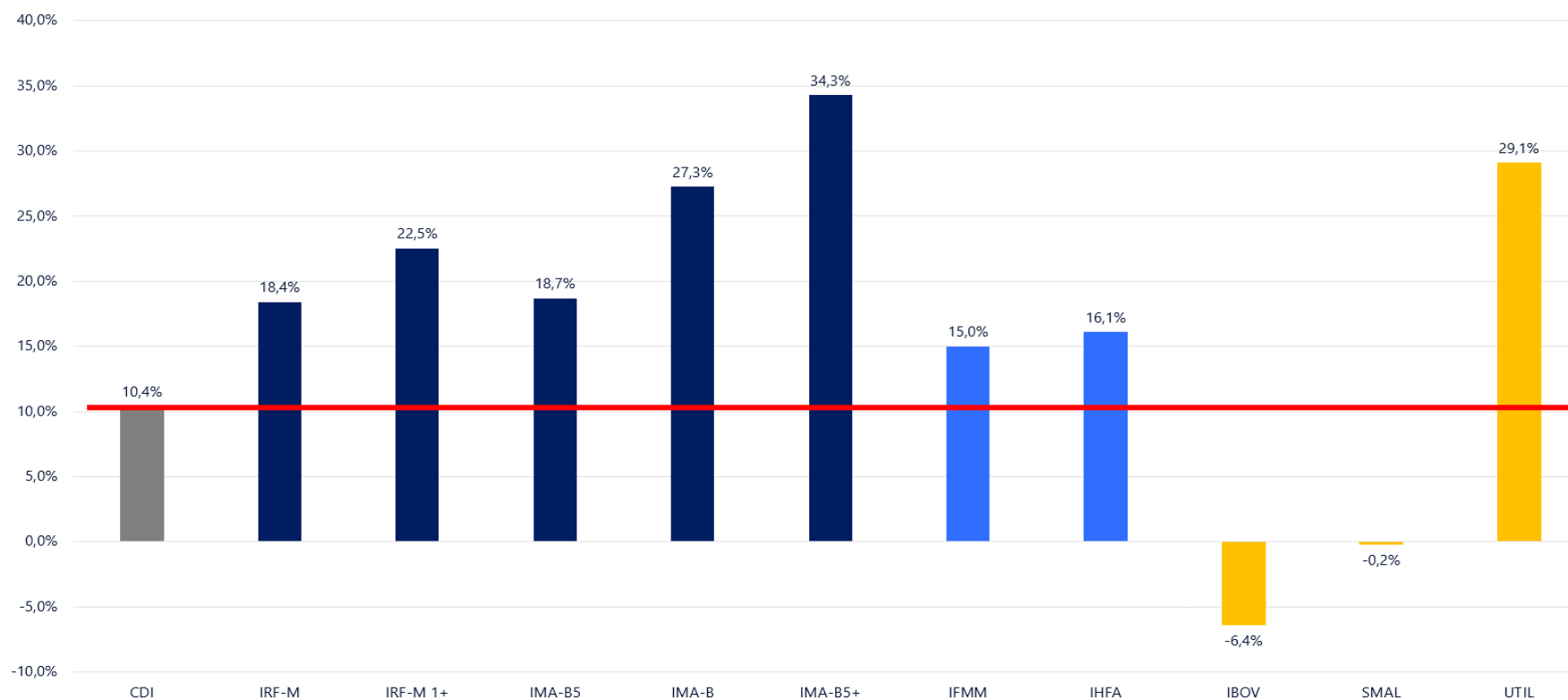
# Performance dos Ativos no ciclo de corte de juros

## Índices | Comportamento em juros elevados



Ciclo 2011/2012

Índices – Retorno 12 Meses após Selic atingir pico  
2011/2012



Fonte: Bloomberg e BTG Pactual.

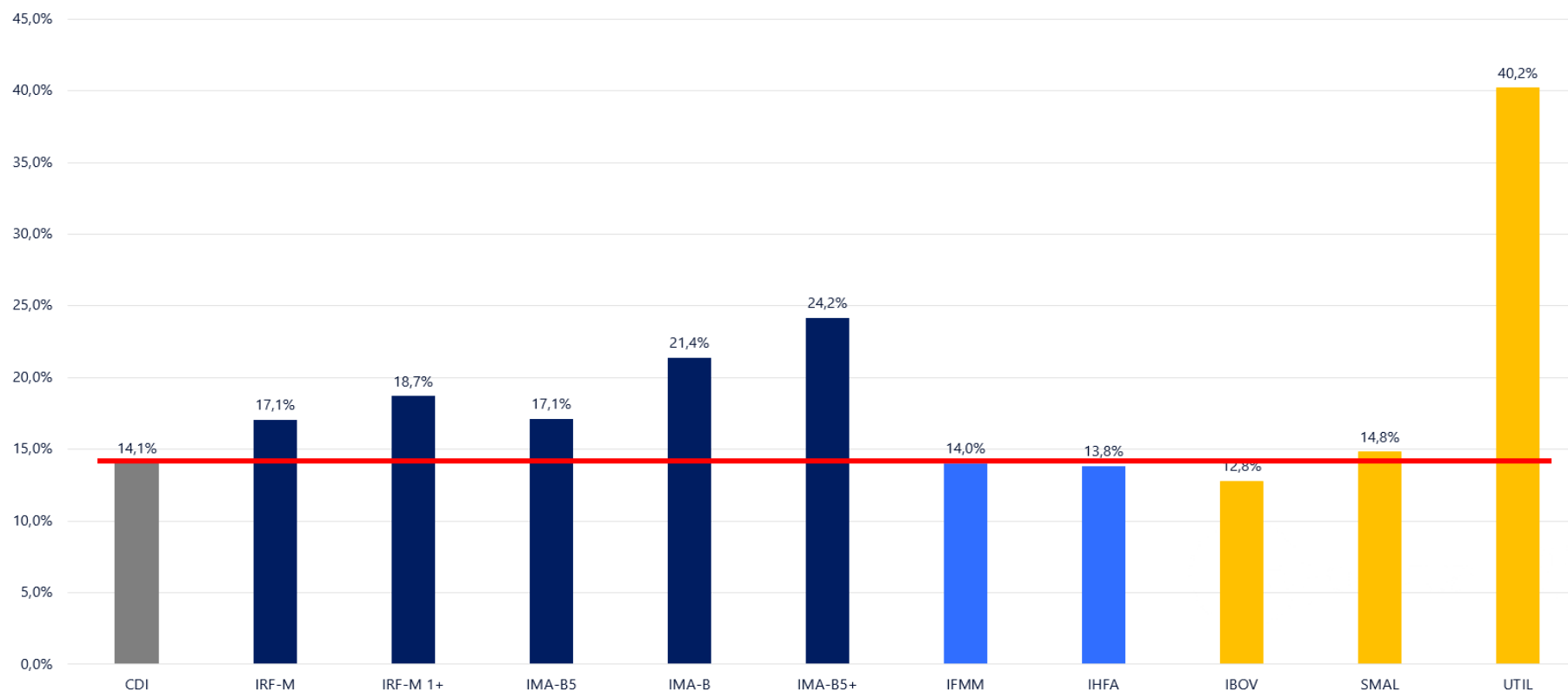
# Performance dos Ativos no ciclo de corte de juros

## Índices | Comportamento em juros elevados



Ciclo 2015/2016

Índices – Retorno 12 Meses após Selic atingir pico  
2015/2016



Fonte: Bloomberg e BTG Pactual.

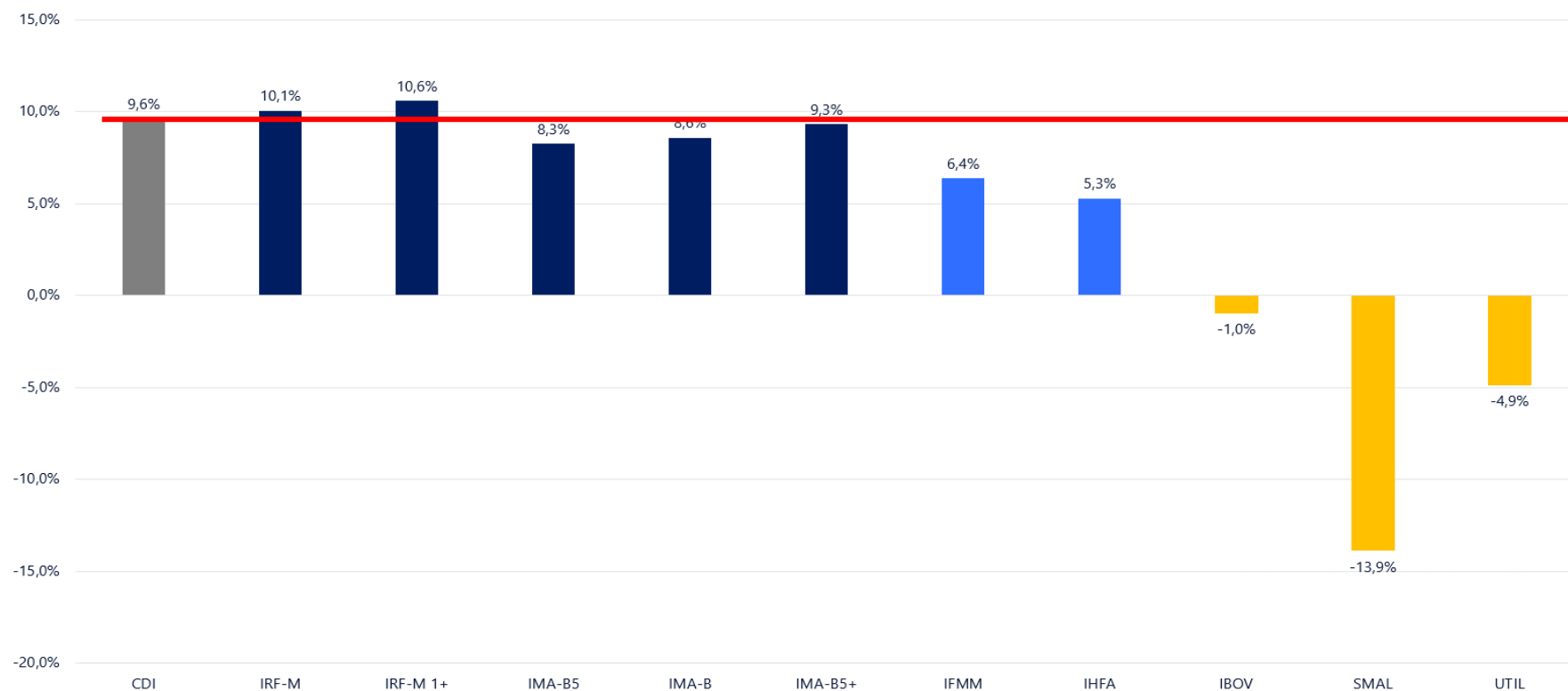
# Performance dos Ativos no ciclo de corte de juros

## Índices | Comportamento em juros elevados



Ciclo 2022/2023

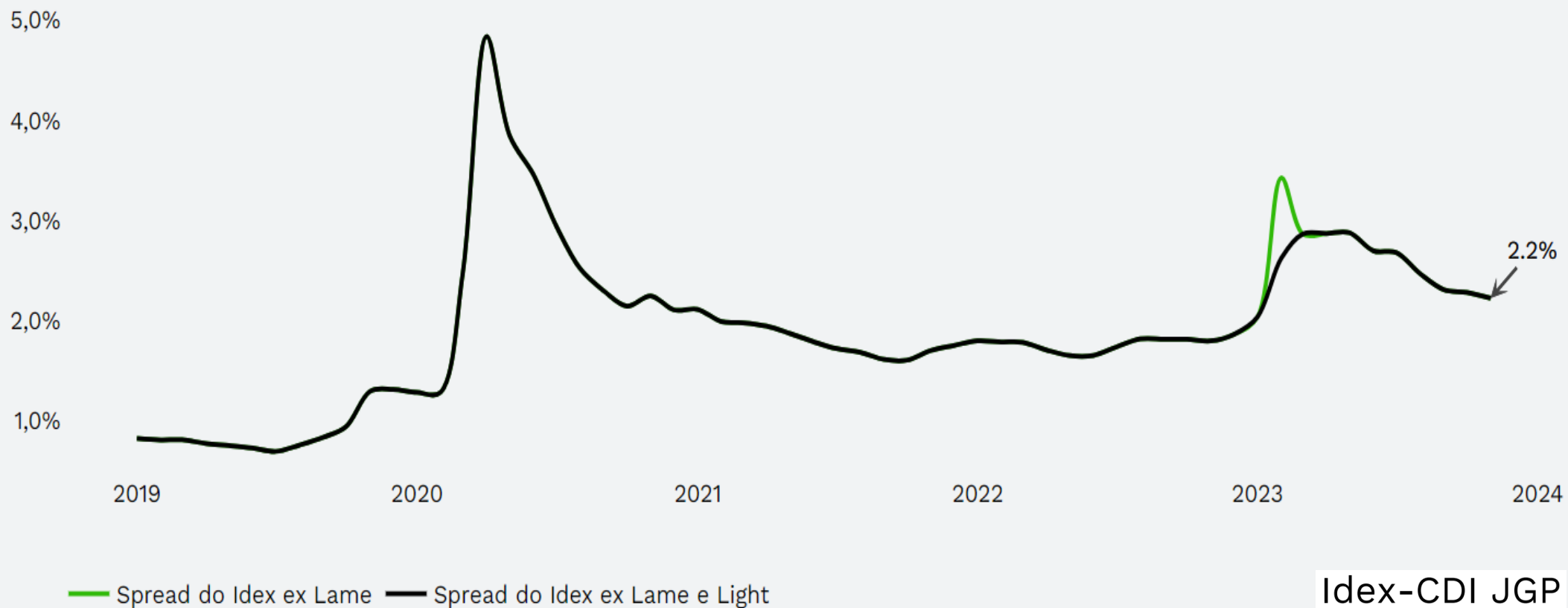
Índices – Retorno 12 Meses após Selic atingir pico  
2022/2023



Fonte: Bloomberg e BTG Pactual.

# Mercado de crédito privado

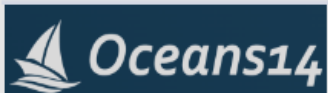
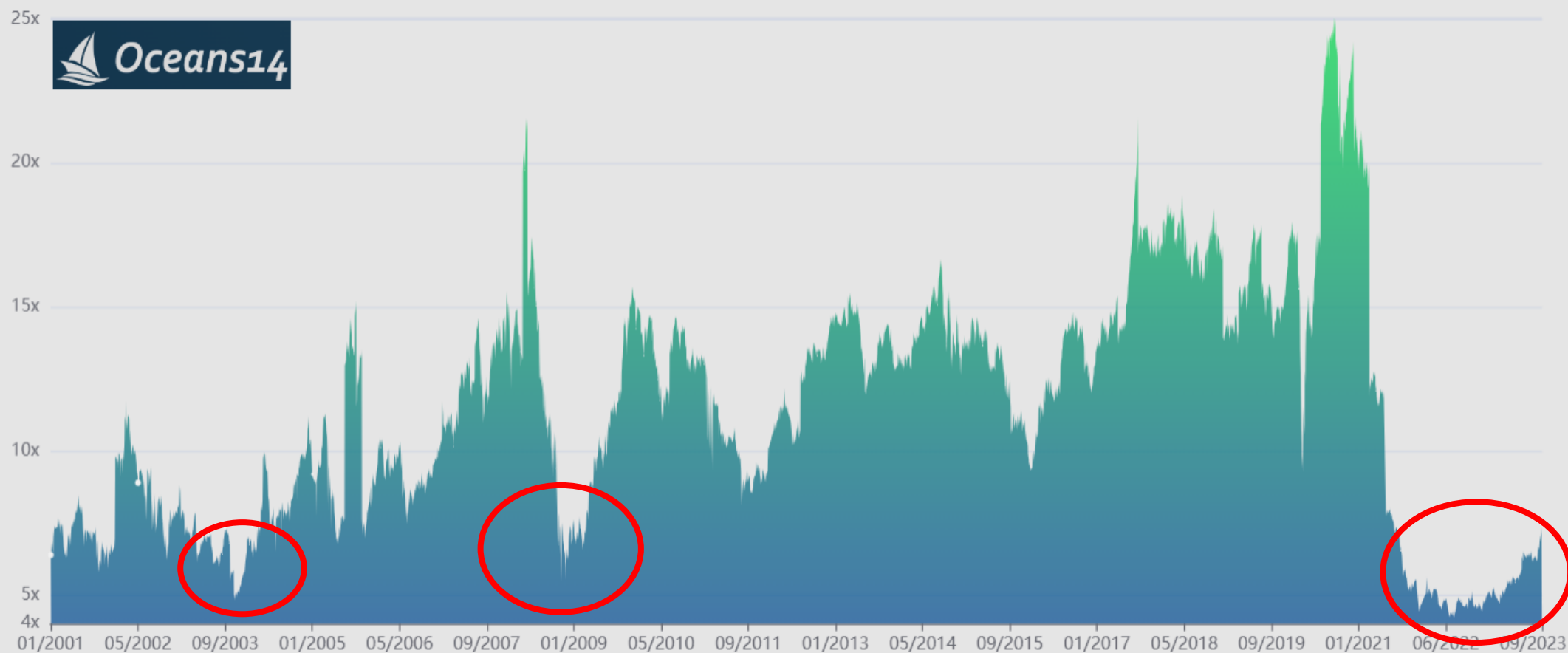
## Evolução dos spreads de carregos ponderados (DI+) ex-Light e Lame



# Preço vs. Lucro do Ibovespa

Última atualização: 17/11/2023

P/L atual: 7,39x



# **Novos Fundos de Investimento Banestes**



# Novos Fundos de Investimento Banestes

**Banestes IMA-B 5** Títulos Públicos Fundo de Investimento Renda Fixa Longo Prazo

**Banestes Selection** Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado

**Banestes Multiestratégia** Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado

**Banestes Crédito Corporativo I** Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Renda Fixa Crédito Privado Longo Prazo

**Banestes Explorer** Institucional Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Renda Fixa Longo Prazo

# **Banestes IMA-B 5 Títulos Públicos FI RF LP**

## **Público-alvo:**

Pessoas Físicas e Jurídicas em Geral.

## **Política de Investimento:**

Fundo renda fixa, composto exclusivamente por Títulos Públicos Federais, que deve possuir no mínimo, 80% (oitenta por cento) da carteira em ativos relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à variação das taxas de juros (pós ou pré-fixados), de índices de preços, ou ambos.

## **Características:**

Data de Início:	02/09/2023
Aplicação Inicial:	R\$ 1.000,00
Cota:	Fechamento
Cota de Aplicação:	D+0
Cota de Resgate:	D+0
Crédito em Conta:	D+2
Taxa de Administração:	0,50% a.a.
Patrimônio Líquido:	R\$ 10,6 milhões

## **Enquadramento Res. 4.963:**

Artigo 7º, inciso I, alínea “b”.

## **Dados do Fundo:**

CNPJ:	52.098.757/0001-63
Administrador:	Banestes DTVM S.A.
Gestor:	Banestes DTVM S.A.
Classificação CVM:	Renda Fixa
Subclasse CVM:	Longo Prazo
Tipo ANBIMA:	Renda Fixa Duração Alta Soberano
Classificação de Risco:	Médio
Horario - Aplicação e Resgate:	Até às 16h



# **Banestes Selection FI RF Crédito Privado**

## **Público-alvo:**

Pessoas Físicas e Jurídicas em Geral.

## **Enquadramento Res. 4.963:**

Artigo 7º, inciso V, alínea “b”.

## **Política de Investimento:**

Fundo renda fixa Crédito Privado que deve possuir no mínimo, 80% (oitenta por cento) da carteira em ativos relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à variação das taxas de juros (pós ou pré-fixados), de índices de preços, ou ambos.

## **Características:**

Data de Início:	02/09/2023
Aplicação Inicial:	R\$ 1.000,00
Cota:	Fechamento
Cota de Aplicação:	D+0
Cota de Resgate:	D+0
Crédito em Conta:	D+2
Taxa de Administração:	0,50% a.a.
Patrimônio Líquido:	R\$ 10,2 milhões

## **Dados do Fundo:**

CNPJ:	52.098.741/0001-50
Administrador:	Banestes DTVM S.A.
Gestor:	Banestes DTVM S.A.
Classificação CVM:	Renda Fixa
Subclasse CVM:	Crédito Privado
Tipo ANBIMA:	Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento
Classificação de Risco:	Médio
Horario - Aplicação e Resgate:	Até às 16h

# **Banestes Multiestratégia FI FIC Multimercado**

## **Público-alvo:**

Pessoas Físicas e Jurídicas em Geral.

## **Política de Investimento:**

Fundo multimercado que investe, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) de seus recursos em cotas de fundos de investimento, podendo envolver vários fatores de riscos, sem o compromisso de concentração em nenhum fator em especial.

## **Características:**

Data de Início:	02/09/2023
Aplicação Inicial:	R\$ 1.000,00
Cota:	Fechamento
Cota de Aplicação:	D+0
Cota de Resgate:	D+1
Crédito em Conta:	D+3
Taxa de Administração:	0,50% a.a.
Patrimônio Líquido:	R\$ 10,2 milhões

## **Enquadramento Res. 4.963:**

Artigo 10º, inciso I.

## **Dados do Fundo:**

CNPJ:	52.098.791/0001-38
Administrador:	Banestes DTVM S.A.
Gestor:	Banestes DTVM S.A.
Classificação CVM:	Multimercado
Subclasse CVM:	N/A
Tipo ANBIMA:	Multimercado Estratégia Livre
Classificação de Risco:	Alto
Horario - Aplicação e Resgate:	Até às 16h

# **Banestes Crédito Corporativo I FI FIC RF Crédito Privado LP**

## **Público-alvo:**

Pessoas Físicas e Jurídicas em Geral.

## **Política de Investimento:**

Fundo Renda Fixa Crédito Privado que investe, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) de seus recursos em cotas do BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO.

## **Características:**

Data de Início:	02/09/2023
Aplicação Inicial:	R\$ 1.000,00
Cota:	Fechamento
Cota de Aplicação:	D+0
Cota de Resgate:	D+30 corridos
Crédito em Conta:	D+33
Taxa de Administração:	0,70% a.a.
Patrimônio Líquido:	R\$ 10,2 milhões

## **Enquadramento Res. 4.963:**

Artigo 7º, inciso V, alínea “b”.

## **Dados do Fundo:**

CNPJ:	52.098.763/0001-10
Administrador:	Banestes DTVM S.A.
Gestor:	Banestes DTVM S.A.
Classificação CVM:	Renda Fixa
Subclasse CVM:	Crédito Privado Longo Prazo
Tipo ANBIMA:	Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre
Classificação de Risco:	Médio
Horario - Aplicação e Resgate:	Até às 14h

# **Banestes Explorer Institucional FI FIC RF LP**

## **Público-alvo:**

Pessoas Físicas e Jurídicas em Geral.

## **Enquadramento Res. 4.963:**

Artigo 7º, inciso III, alínea “a”.

## **Política de Investimento:**

Fundo Renda Fixa que investe, no mínimo, 95% (noventa e cinco por cento) de seus recursos em cotas do BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO.

## **Características:**

Data de Início:	02/09/2023
Aplicação Inicial:	R\$ 500,00
Cota:	Fechamento
Cota de Aplicação:	D+0
Cota de Resgate:	D+0
Crédito em Conta:	D+3
Taxa de Administração:	0,50% a.a.
Patrimônio Líquido:	R\$ 10 milhões

## **Dados do Fundo:**

CNPJ:	52.098.763/0001-10
Administrador:	Banestes DTVM S.A.
Gestor:	Banestes DTVM S.A.
Classificação CVM:	Renda Fixa
Subclasse CVM:	Longo Prazo
Tipo ANBIMA:	Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento
Classificação de Risco:	Médio
Horario - Aplicação e Resgate:	Até às 14h

## Dúvidas e Sugestões



# 55 ANOS BANESTES DTVM



Autorregulação  
**ANBIMA**

Gestão de Recursos



Autorregulação  
**ANBIMA**

Administração Fiduciária



Autorregulação  
**ANBIMA**

Controladoria de  
Ativo e Passivo



Autorregulação  
**ANBIMA**

Escrituração