

Processo de investimento, análise e seleção de ativos

A equipe de gestão utiliza research de terceiros como Eleven Research, XP Research, Genial Analisa, agências de rating e dados públicos disponíveis nos portais online das seguintes instituições: ANBIMA, B3, BACEN, IBGE e CVM, para auxiliar na tomada de decisão de alocação dos ativos nas carteiras administradas.

Os serviços ou sistemas utilizados para apoio na análise econômica são sistemas voltados para o fornecimento de dados comerciais e financeiros apresentados em tempo real, como Comdinheiro que fornece base de dados estatísticos, curva de juros, câmbio, bolsa de valores.

Sistema para a análise, comparação de informações financeiras, consolidação de carteiras, gestão de risco, operado em nuvem: Comdinheiro.

Após diligências de análise cadastral do cliente a fim de observar e atender às políticas de risco e PLDFT. Em entrevista ao cliente, identifica-se o perfil de risco e define-se a política de investimentos.

A Diretora de Gestão de Recursos é a responsável pelas tomadas de decisões de investimentos nas atividades de gestão, com base nas análises fornecidas pelas casas de análise contratadas pela Taus MFO e dados públicos.

A Diretora de Gestão de Recursos também é responsável pela revisão periódica dos investimentos das carteiras sob gestão, para enquadramento dentro da política de investimento definida, utilizando-se diferentes métricas como concentração, diversificação e posição das carteiras administradas pela Taus.

Para desempenhar essas funções, a Diretora de Gestão de Recursos utiliza sistemas de informação de mercado (Dados oficiais) e consolidação de carteiras (Comdinheiro) e análise de mercado efetuadas pelo time de especialistas das casas de análise acima citadas.

Através destas ferramentas, a diretora de gestão irá monitorar as carteiras dos clientes através dos seguintes procedimentos:

1. Geração de relatórios periódicos de Posição e Desempenho da Carteira (Extrato On-Line):
 - Posição dos Ativos que compõe a Carteira;
 - Rentabilidade da Carteira e dos ativos que a compõe;
 - Comparação da Carteira e dos ativos com indicadores de mercado;
 - Rentabilidade e Ganho Financeiro;
 - Relatório de Posição e Desempenho;
 - Disponibilidade Financeira das ativos que compõem a carteira;
 - Volatilidade da Carteira;
 - Índice de Sharpe;
 - Consistência do portfólio;

2. Análise qualitativa de gestores;
3. Análise quantitativa de ativos;
4. Controle diário dos caixas das carteiras administradas;
5. Boletagem de ativos nas carteiras administradas, sejam para rebalanceamento ou novas captações.

