



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 29.325.262/0001-08

Nome do Administrador de Carteira: IRB ASSET MANAGEMENT S.A.

Ano de competência: 2022

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A IRB Asset Management S.A., subsidiária integral do IRB-Brasil Resseguros S.A. (holding controladora do Grupo IRB), foi constituída em 13 de dezembro de 2017 ("Sociedade") e habilitada pela CVM em 16 de julho de 2018 para prestar os serviços de gestão de recursos.

O corpo técnico da Sociedade é composto por funcionários que atuavam na Gerência de Investimentos do IRB-Brasil Resseguros S.A. e foram transferidos formalmente e registrados na Sociedade, além de outros profissionais contratados do mercado.

2.2. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo

a. Principais eventos societários tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário

Não houve mudanças relevantes no últimos 5 (cinco) anos.

b. Escopo das atividades

Não houve mudanças relevantes no últimos 5 (cinco) anos.

c. Recursos humanos e computacionais

Com relação às mudanças relevantes ocorridas nos recursos humanos, cite-se:

- em julho/2018: Renúncia do Sr. Henrique de La Roque ao cargo de Diretor de Gestão e nomeação do Sr. Marcel Leal da Silva.

- em agosto/2019: Renúncia do Sr. Iury Steiner de Oliveira Bezerra ao cargo de Diretor de Gestão de Riscos e nomeação do Sr. Bruno Almeida de Souza.

- em março/2020: Renúncia do Sr. Fernando Passos ao cargo de Diretor Geral.

- em março/2020: Renúncia do Sr. José Carlos Cardoso ao cargo de Presidente do Conselho de Administração.

- em dezembro/2020: Eleição do Sr. Henrique de La Roque ao cargo de Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros e do Sr. Marcel Leal da Silva ao cargo de Diretor de Gestão de Recursos Próprios. No mesmo ato, houve a ratificação da nomeação do Sr. Bruno Almeida de Souza como Diretor de Risco e Conformidade.

- Em dezembro/2020: Aprovada a extinção do Conselho de Administração.

- Em novembro/2021: Renúncia do Sr. Bruno Almeida de Souza ao cargo de Diretor de Risco e Conformidade e início do processo de seleção e contratação do seu substituto.

- Em dezembro/2022: Reeleição Sr. Henrique de La Roque ao cargo de Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros e do Sr. Marcel Leal da Silva ao cargo de Diretor de Gestão de Recursos Próprios com novo mandato de 1º de dezembro de 2022 a 1º de dezembro de 2024.

- Em março/2023: Eleição da Sra. Thais Ricarte Peters para o cargo de Diretora de Risco e Conformidade, com mandato até 1º de dezembro de 2024.

Não houve mudanças relevantes nos recursos computacionais nos últimos 5 (cinco) anos.

d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Todas as regras, políticas e procedimentos são revisadas periodicamente, de modo a garantir a atualização das rotinas e adequar os controles internos ao modelo de negócios da Sociedade, seus fundos de investimento sob gestão, bem como mudanças regulatórias ocorridas no período.

Ao longo do ano de 2019 os manuais e políticas foram revisados com o foco de adequação ao novo código da autorregulação que regula a atividade de gestão profissional de recursos de terceiros.

Ao longo do ano de 2020 os manuais e políticas foram todos revisados e simplificados, dando especial destaque à Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento do Terrorismo que sofreu relevantes alterações em virtude da entrada em vigor da Instrução CVM 617.

Ao longo do ano de 2021 os manuais e políticas foram todos revisados, dando especial destaque ao Manual de Controles Internos e Compliance, a Política de Compra e Venda de Valores Mobiliários por Administradores, Empregados e pela Própria Empresa, Política de Prevenção e Combate à Fraude e à Corrupção, Política de Certificação e ao Código de Ética e Conduta.

Ao longo do ano de 2022 os manuais e políticas foram revalidados, tendo sido identificada a necessidade de alteração da Política de Gestão do Risco de Liquidez em virtude de adaptação às novas diretrizes da autorregulação sobre o assunto. Em seguida, em janeiro de 2023 deu-se início ao cronograma de revisão de todos os controles internos.

3. Recursos Humanos

3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:

a. Número de sócios:

1

b. Número de empregados:

5

c. Número de terceirizados:

0

CPF	Nome
081.162.557-54	MARCEL LEAL DA SILVA
043.031.517-18	HENRIQUE DE LA ROCQUE

4. Auditores

Observação: A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.

4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:

Nome empresarial	Data da contratação	Descrição
KPMG Auditores Independentes Ltda.	25/03/2022	Auditoria do balanço patrimonial do exercício findo em 31/12/2022 e das correspondentes demonstrações de resultado, do resultado abrangente, das mutações do patrimônio líquido e dos fluxos de caixa do exercício a findar nesta data.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

5. Resiliência Financeira

5.1. Com base nas demonstrações financeiras, ateste:

a. Se a receita em decorrência de taxas com bases fixas a que se refere o item 9.2.a é suficiente para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários

Sim

b. Se o patrimônio líquido da empresa representa mais do que 0,02% dos recursos financeiros sob administração de que trata o item 6.3.c e mais do que R\$300.000,00 (trezentos mil reais)

Sim

5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução (A apresentação destas demonstrações financeiras e deste relatório é obrigatória apenas para o administrador registrado na categoria Administrador Fiduciário, subcategoria Capital Mínimo, de acordo com o inciso II do § 2º do art. 1º.):)

Demonstração Financeira: Não se aplica

Relatório: Não se aplica

6. Escopo das Atividades

6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo

a. Tipos e características dos serviços prestados (gestão discricionária, planejamento patrimonial, controladoria, tesouraria, etc.)

Gestão discricionária de recursos próprios e de recursos de terceiros.

b. Tipos e características dos produtos administrados ou geridos (fundos de investimento, fundos de investimento em participação, fundos de investimento imobiliário, fundos de investimento em direitos creditórios, fundos de índice, clubes de investimento, carteiras administradas, etc.)

Fundos de investimento classificados como renda fixa, multimercados e ações.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

A Sociedade realiza a gestão dos portfólios atuando na aquisição e venda dos principais ativos e derivativos financeiros, tais como títulos públicos federais e privados, ações, futuros, opções de taxas de juros, de câmbio, de ações e de índices acionários, swaps e cotas de fundos de investimentos (incluindo fundos de índice, fundos de investimento em direitos creditórios - "FIDC", FIP e FII). As operações com derivativos serão realizadas majoritariamente com objetivos de proteção de posições (hedge) e sem objetivos de alavancagem.

d. Se atua na distribuição de cotas de fundos de investimentos de que seja administrador ou gestor

Não

6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários, destacando:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

a. Os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades

Não aplicável, pois a Sociedade não exerce outras atividades que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários.

b. Informações sobre as atividades exercidas por sociedades controladoras, controladas, coligadas e sob controle comum ao administrador e os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades

As sociedades controladas pelo IRB-Brasil Resseguros S.A. (controlador da Sociedade) possuem braços de gestão de recursos próprios, completamente segregados, tanto fisicamente, mas também em termos de recursos humanos e sistêmicos, da Sociedade. O controlador direto da Sociedade é uma instituição de resseguros, não havendo conflito de interesse com a atividade desempenhada pela Sociedade. Não existem sociedades controladas pela Sociedade.

A mitigação de potenciais conflitos de interesses entre a gestão de carteira de recursos de terceiros e de recursos próprios é realizada por meio da reformulação ocorrida na Sociedade, contando atualmente com diretores segregados e processo de tomada de decisão independente.

6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundo e carteiras administradas geridas pela empresa, fornecendo as seguintes informações

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
a. Número de investidores	6	0	6

b. Número de investidores, dividido por:	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	0	0	0
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	3	0	3
iii. Instituições Financeiras	1		1
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0		0
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	1		1
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	0	0	0
vii. Seguradoras	1		1
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	0		0
ix. Clubes de Investimento	0	0	0
x. Fundos de Investimento	0		0
xi. Investidores não Residentes	0		0

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
	0	0	0



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	6	0	6

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 7.631.056.940,60	R\$ 0,00	R\$ 7.631.056.940,60

d. Recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior

R\$ 810.802.306,31

e. Recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes) Caso deseje identificar o cliente, informe o nome após o valor dos recursos, utilizando o caracter ";" como separador

Valor	Nome
R\$ 5.945.359.648,84	
R\$ 1.676.273.151,01	
R\$ 6.434.378,48	
R\$ 2.780.472,59	
R\$ 93.065,05	
R\$ 26.224,63	

f. Recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 2.989.762,27	R\$ 0,00	R\$ 2.989.762,27
iii. Instituições Financeiras	R\$ 6.434.378,48		R\$ 6.434.378,48
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	R\$ 1.676.273.151,01		R\$ 1.676.273.151,01
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
vii. Seguradoras	R\$ 5.945.359.648,84		R\$ 5.945.359.648,84
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	R\$ 0,00		R\$ 0,00
ix. Clubes de Investimento	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
x. Fundos de Investimento	R\$ 0,00		R\$ 0,00
xi. Investidores não Residentes	R\$ 0,00		R\$ 0,00

**COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 7.631.056.940,60	R\$ 0,00	R\$ 7.631.056.940,60

6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:

a. Ações	R\$ 14.067.225,65
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R\$ 113.447.597,47
c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R\$ 219.949.986,61
d. Cotas de fundos de investimento em ações	R\$ 65.264.232,65
e. Cotas de fundos de investimento em participações	R\$ 0,00
f. Cotas de fundos de investimento imobiliário	R\$ 0,00
g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R\$ 113.502.199,48
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 0,00
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 0,00
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ -30.936.751,17
k. Outros valores mobiliários	R\$ 0,00
l. Títulos públicos	R\$ 6.509.897.266,28
m. Outros ativos	R\$ 625.895.186,63
Total	R\$ 7.631.086.943,60

6.5. Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária:

Não se aplica, pois a Sociedade não exerce atividades de administração fiduciária.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não há outras informações que a Sociedade julgue relevantes a serem divulgadas neste item.

7. Grupo Econômico**7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:****a. Controladores diretos e indiretos**

CPF/CNPJ	Nome
33.376.989/0001-91	IRB BRASIL RESSEGUROS SA

b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
-	Não Informado



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

c. Participações da empresa em sociedade do grupo

CNPJ	Nome
-	Não Informado

d. Participações de sociedades do grupo na empresa

CNPJ	Nome
-	Não Informado

e. Sociedades sob controle comum

CNPJ	Nome
24.207.273/0001-70	IRB Santos Dumont Empreendimentos Imobiliários SPE S.A.
24.207.249/0001-30	IRB Chile Empreendimentos Imobiliários SPE S.A.
25.173.792/0001-27	IRB Uso Empreendimentos Imobiliários SPE S.A.
24.207.296/0001-84	IRB Renda Empreendimentos Imobiliários SPE S.A.

7.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma do grupo econômico em que se insere a empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no 7.1.

Nenhum arquivo selecionado.

8. Estrutura Operacional e Administrativa

8.1. Descrever a estrutura administrativa da empresa, conforme estabelecido no seu contrato ou estatuto social e regimento interno, identificando:

a. Atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Os órgãos estatutários da Sociedade, de caráter deliberativo, executivo e de fiscalização são os seguintes: I - Assembleia Geral; II - Diretoria; e III - Conselho Fiscal.

Compete à Assembleia Geral, além das atribuições previstas em lei, deliberar a respeito das seguintes matérias:

- I. Definição das políticas de contratação e de remuneração dos administradores da Sociedade;
- II. Eleição e destituição dos membros da Diretoria da Sociedade, bem como fixação de suas atribuições;
- III. Prestação de garantias em favor de terceiros pela Sociedade, exceto se em favor de controlada da Sociedade quando exigido por lei ou pelos princípios contábeis aplicáveis;
- IV. Escolha e destituição do(s) titular(es) da Auditoria Interno e designação e destituição do Auditor Independente da Sociedade;
- V. Aprovação de qualquer operação de endividamento em nome da Sociedade ou de emissão de valores mobiliários representativas de dívida que representem obrigação para a Sociedade superior a 10% (dez por cento) do seu patrimônio líquido;
- VI. Criação de subsidiária e filiais da Sociedade;
- VII. Sem que este limite seja aplicável às atividades ordinárias de gestão de recursos de terceiros, deliberar sobre a celebração de qualquer ato ou negócio jurídico pela Diretoria da Sociedade, cujo valor individual, ou agregado considerando o período de 1 (um) ano, supere a quantia de R\$ 250.000.000,00 (duzentos e cinquenta milhões de reais), corrigido pela variação do IPCA, ou outro índice que velha a substituí-lo; e
- VIII. Aprovação de qualquer transferência, venda, licenciamento ou renúncia de tecnologia, patentes, marcas registradas, informações técnicas, segredos de indústria e know-how detidos pela Sociedade para quaisquer terceiros.

Compete à Diretoria a representação geral da Sociedade, bem como o cumprimento das deliberações da Assembleia Geral, observando as boas práticas de governança corporativa, os preceitos legais e regulatórios, assim como:

- I. Cumprir e fazer cumprir o Estatuto Social, as deliberações da Assembleia Geral, bem como estabelecer normas sobre a organização e o funcionamento das atividades da Sociedade, inclusive as de natureza administrativa;
- II. Propor e executar, de acordo com a orientação traçada pela Assembleia Geral, as diretrizes, estratégias, planos de atividades e os respectivos orçamentos da Sociedade;
- III. Remeter ao Conselho Fiscal, quando em funcionamento, as demonstrações financeiras, documentos e informações necessários ao desempenho das atribuições do referido órgão fiscalizador dos atos de gestão da Sociedade, com a periodicidade adequada, observadas as normas legais e regulamentares a respeito da matéria;
- IV. Assegurar que a Sociedade implemente mecanismos práticos para receber, reter e tratar denúncias, assim como tomar conhecimento das principais denúncias recebidas;
- V. Tomar conhecimento e avaliar os principais processos judiciais em nome da Sociedade.

Comitês:

Comitê de Investimentos: O Comitê de Investimentos consiste em um órgão não estatutário de caráter permanente. As reuniões do Comitê de Investimentos ocorrem mensalmente e tem como objetivo ser o fórum de discussão sobre o cenário micro e macroeconômico com base nas análises produzidas internamente e relatórios externos recebidos. Nesse fórum não são discutidas as teses de investimento de nenhuma das carteiras sob gestão, pois o seu objetivo é criar um ambiente de debates sobre o cenário econômico, sem, contudo, afastar a independência da área de Gestão de Recursos Próprios e da área de Gestão de Recursos de Terceiros. As reuniões não possuem caráter deliberativo. Participam do Comitê de Investimentos o Diretor de Gestão de Recursos Próprios, o Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros e os profissionais envolvidos com gestão de investimentos, analistas e economistas da gestora.

Comitê de Gestão de Riscos e de Compliance: O Comitê de Gestão de Riscos e de Compliance consiste em um órgão colegiado e permanente da Sociedade, sendo composto

b. Em relação aos comitês, sua composição, frequência com que são realizadas suas reuniões e a forma como são registradas suas decisões



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Comitê de Investimentos

Composição: Participam do Comitê de Investimentos o Diretor de Gestão de Recursos Próprios, o Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros e os profissionais envolvidos com gestão de investimentos, analistas e economistas.

Frequência: reuniões mensais ou em caráter extraordinário.

Registro de reuniões: Os debates realizados nas reuniões são descritos em atas, de forma sumária, que circulam pelos membros do Comitê de Investimentos.

Comitê de Gestão de Riscos e de Compliance

Composição: Participam do Comitê de Riscos e de Compliance, a Diretora de Riscos e Conformidade, o Diretor de Gestão de Recursos Próprios, Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros e Portfolio Managers Sêniores.

Frequência: reuniões trimestrais ou em caráter extraordinário.

Registro de reuniões: As deliberações são descritas em atas que circulam pelos membros do Comitê de Riscos e de Compliance.

c. Em relação aos membros da diretoria, suas atribuições e poderes individuais

A Diretoria da Sociedade é composta por até 4 (quatro) membros, residentes no País, eleitos e destituíveis, a qualquer tempo, pela Assembleia Geral, sendo designados: (i) Diretor Geral, ao qual caberá o planejamento estratégico da Sociedade e sua eventual representação em atos conjuntos com outros Diretores, sem prejuízo da autonomia dos diretores de gestão nas decisões de investimento das carteiras sob gestão; (ii) Diretor de Gestão de Recursos Próprios, ao qual caberá exclusivamente a gestão de recursos próprios da Sociedade, do seu controlador direto e suas empresas controladas e coligadas (Grupo IRB); (iii) Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros, ao qual caberá a administração de carteiras de valores mobiliários dedicado exclusivamente à gestão dos recursos de terceiros não relacionados ao Grupo IRB; e (iv) Diretora de Riscos e Conformidade, a qual caberá a supervisão direta e responsabilidade pelo cumprimento e manutenção de regras, políticas, procedimentos e controles internos; pelas atividades atinentes à gestão de risco; pelas atividades atinentes ao cumprimento de normas relativas à prevenção à lavagem de dinheiro, ao financiamento do terrorismo e ao financiamento da proliferação de armas de destruição em massa.

8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item anterior.

Nenhum arquivo selecionado

8.3. Em relação a cada um dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos
00.008.116/25 57-54	Marcel Leal da Silva	42	Administrador	Diretor de Gestão de Recursos Próprios	01/12/2022	2 anos	Membro do Comitê de Investimento e Membro do Comitê de Gestão de Riscos e Compliance
00.004.303/15 17-18	Henrique de La Roque	47	Economista	Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros	01/12/2022	2 anos	Membro do Comitê de Investimentos e do Comitê de Gestão de Riscos e Compliance.
715.348.651- 87	Thais Ricarte Peters	42	Economista	Diretora de Riscos e Conformidade	30/03/2023	2 anos	Membro do Comitê de Gestão de Riscos e Compliance.

8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, indicar:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	00.004.303/1517-18	Henrique de La Roque	47	Economista	Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros	01/12/2020	2 anos	Membro do Comitê de Investimento e Membro do Comitê de Gestão de Riscos e Compliance	a) Economia - PUC-Rio - 1997.	a) ANBIMA - CFG, CGA e CGE; b) Autorizado a prestar serviço de administração de carteiras pelo Ato Declaratório CVM nº 11.228, de 11/08/2020.
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	00.008.116/2557-54	Marcel Leal da Silva	42	Administrador	Diretor de Gestão de Recursos Próprios	01/12/2020	2 anos	Membro do Comitê de Investimento e Membro do Comitê de Gestão de Riscos e Compliance	a) Administração de Empresas - UCAM; b) Especialização em Mercado de Capitais - BVRJ.	a) ANBIMA - CFG, CGA e CGE; b) Autorizado a prestar serviço de administração de carteiras pelo Ato Declaratório CVM nº 16.328, de 14/07/2018.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

8.5 (COMPLI ANCE)	715.348.6 51-87	Thais Ricarte Peters	42	Economis ta	Diretora de Riscos e Conformi dade	30/03/202 3	2 anos	Membro do Comitê de Gestão de Riscos e Complian ce.	a)Bachare lado em Economia - Universid ade de Brasília; b)MBA em Finanças - Universid ade de Brasília; c)Mestrad o em Economia de Empresas, Economia e Gestão Empresari al - Universid ade Católica de Brasília; d)Doutora nda em Administ ração e Negócios pela FGV EAESP.	Não há.
-------------------------	--------------------	----------------------------	----	----------------	--	----------------	--------	---	--	---------



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

8.6 (GESTÃO DE RISCO)	715.348.651-87	Thais Ricarte Peters	42	Economista	Diretora de Riscos e Conformidade	30/03/2023	2 anos	Membro do Comitê de Gestão de Riscos e Compliance.	a) Bacharelado em Economia - Universidade de Brasília; b) MBA em Finanças - Universidade de Brasília; c) Mestrado em Economia de Empresas, Economia e Gestão Empresarial - Universidade Católica de Brasília; d) Doutorado em Administração e Negócios pela FGV EAESP.	Não há.
--------------------------	----------------	----------------------	----	------------	-----------------------------------	------------	--------	--	---	---------

8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, fornecer principais experiências profissionais durante os últimos cinco anos, indicando:

**COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída
00.004.303/1517-18	Henrique de La Roque	BRASIF GESTÃO INTERNACIONAL	Diretor de Gestão: Responsável pela gestão de investimentos: câmbio, renda fixa, ações, índices e portfólio de derivativos no mercado local e internacional, bem como pela comunicação com os clientes.	Gestão de Recursos	11/06/2010	01/08/2018
00.004.303/1517-18	Henrique de La Roque	IRB Asset Management S.A.	Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros: Responsável pela gestão de recursos de terceiros. Portfólio Manager desde 08/2018, tendo o mandato como Diretor de Gestão de Recursos de Terceiros iniciado em 01/12/2020.	Gestão Profissional de Recursos Próprios e de Terceiros.	01/08/2018	
00.008.116/2557-54	Marcel Leal da Silva	IRB-Brasil Resseguros S.A.	Gerente: Responsável pela gestão de investimentos: câmbio, renda fixa, ações, índices e portfólio de derivativos no mercado local e internacional. Tomando as decisões sobre as alocações dos investimentos, bem como suporte a outras áreas.	Resseguros	01/07/2015	18/07/2018



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

00.008.116/2557-54	Marcel Leal da Silva	IRB Asset Management S.A.	Diretor de Gestão de Recursos Próprios: Responsável pela gestão de recursos próprios e todos os outros assuntos corporativos da companhia. Diretor desde 07/2018, tendo o mandato como Diretor de Gestão de Recursos Próprios iniciado em 01/12/2020.	Gestão Profissional de Recursos Próprios e de Terceiros.	01/07/2018	
--------------------	----------------------	---------------------------	--	--	------------	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

715.348.651-87	Thais Ricarte Peters	Caixa Econômica Federal	Ocupou diversos cargos na instituição, de acordo com o seguinte cronograma: a. Analista atuando na área de Planejamento Financeiro (12/2003 a 01/2010); b. Consultora Interna na área de ALM (01/2010 a 01/2012); c. Gerente Executiva de Planejamento Financeiro (01/2012 a 11/2012); d. Gerente Nacional de ALM (de 11/2012 a 03/2016); e. Gerente Nacional de Precificação de Ativos (04/2016 a 01/2017); f. Superintendente de Planejamento Financeiro (01/2017 a 01/2019); g. Diretora Executiva de Reestruturação de Ativos (02/2019 a 05/2019); e h. Vice-presidente de Fundos de Investimento (05/2019 a 04/2020).	Instituição financeira	01/12/2003	01/04/2020
715.348.651-87	Thais Ricarte Peters	Caixa Cartões Holding S.A.	Chief Commercial Officer (CCO): Responsável pela área comercial.	Holding	01/06/2020	01/02/2021



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

715.348.651-87	Thais Ricarte Peters	Youse Seguros	Diretora Estatutária de Riscos e Compliance: Responsável pela implementação e fiscalização dos controles internos e pelo cumprimento da política de riscos.	Seguros	01/02/2021	22/10/2022
715.348.651-87	Thais Ricarte Peters	IRB-Brasil Resseguros S.A.	Diretora Executiva de Controles Internos, Riscos e Conformidade: Responsável pela implementação e fiscalização dos controles internos e pelo cumprimento da política de riscos.	Resseguros	16/12/2022	
715.348.651-87	Thais Ricarte Peters	IRB Asset Management S.A.	Diretora de Riscos e Conformidade: Responsável pela verificação do cumprimento das rotinas e procedimentos internos, bem como conformidade com a regulação e autorregulação, coordenação das atividades de gestão de riscos e verificação dos controles para fins de prevenção à lavagem de dinheiro, ao financiamento do terrorismo e ao financiamento da proliferação de armas de destruição em massa.	Gestão Profissional de Recursos Próprios e de Terceiros.	30/03/2023	

8.8 Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

a. Quantidade de profissionais

6

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A atividade de gestão é segregada em duas áreas: Área de Gestão de Recursos Próprios e Área de Gestão de Recursos de Terceiros.

A Área de Gestão de Recursos Próprios é composto por 1 (um) Diretor e 2 (dois) funcionários com funções relacionadas com a gestão de recursos próprios.

A Área de Gestão de Recursos de Terceiros é composto por 1 (um) Diretor e 2 (dois) funcionários com funções relacionadas com a gestão de recursos de terceiros.

As principais atividades desenvolvidas pelas áreas de gestão, dentro dos seus respectivos mandatos, são:

- Análise diária do cenário macroeconômico para busca de oportunidades de investimentos;
- Execução/implementação das estratégias;
- Rebalanceamento do portfólio;
- Enquadramento e reenquadramento dos Fundos;
- Gestão de caixa dos fundos (aplicação e resgate);
- Explicação da evolução do fundo para os clientes; e
- Acompanhamento diário dos mercados locais e externos.

A gestão de recursos próprios observa o mandato e a política de investimentos definida nos regulamentos dos fundos sob gestão da Área de Gestão de Recursos Próprios.

c. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

A Sociedade faz uso de sistemas proprietários, majoritariamente planilhas MS Excel e sistemas terceirizados como serviços de informação em tempo real Bloomberg e Broadcast, e solução de gestão de carteiras da empresa Lote 45, compreendo os módulos Asset Portfolio Manager (APM) e Compliance Portfolio Manager (CPM), que contempla o módulo Pre Order System.

Bloomberg Professional - permite o acesso a informações sobre todas as classes de ativos em tempo real, incluindo renda fixa, renda variável, câmbio, commodities e derivativos, notícias, análises, gestão de carteira, risco e comunicação, além de gráficos e plataformas de execução.

Broadcast (Agência Estado) - permite o acesso aos conteúdos jornalísticos, financeiros, políticos, jurídicos, cotações, indicadores de referência, análises para acompanhamento do mercado financeiro, principais culturas (soja, milho, sucroalcooleiro, café, pecuária), setores, empresas, eventos e notícias.

Lote 45 - Módulo APM - permite a obtenção de cota e patrimônio dos fundos de forma on-line, já incluídas as operações do dia e os resultados de trading por meio da importação automática de trades de várias corretoras e plataformas de trading, a realização de Teste de Stress utilizando a metodologia da B3 e os cenários do comitê de riscos da LOTE45, VaR histórico e paramétrico (para 1 e 5 dias) e customizações, Gregas (Delta, Gamma, Vega e Rho), Simulação Delta-Gamma, atribuição de performance e verificação das posições vs XML ANBIMA.

Lote 45 - Módulo CPM - permite monitorar de forma automática e on-line normas da CVM (para FIF e Fundos Imobiliários), Receita 1.585 e de entidades supervisionadas por SUSEP e PREVIC (BACEN 4.444 e 3.792), selecionadas para cada Fundo, conforme sua classificação, normas de regulamento de cada fundo, normas gerenciais criadas pelo cliente, incluindo métricas de risco, índices de liquidez, túnel de preço, black-list, controle de day-trades, drawdown, stop-loss, dentre outras.

Adicionalmente, o módulo de pre-trading do CPM permite verificar a aderência às normas de novos trades antes de serem executados, reconciliar os trades efetivamente executados com os trades previamente autorizados, criar biblioteca de normas e regulamentos internos com log de aceite e gerenciar a agenda de eventos externos e internos com alertas.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

8.9. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentadores aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:

a. Quantidade de profissionais

2

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

O acompanhamento do cumprimento das regras e procedimentos de Compliance da Sociedade é realizado de forma extensiva pela Diretora de Riscos e Conformidade com o auxílio de ferramentas e sistemas aprovados pela Diretoria da Sociedade. A Diretora de Riscos e Conformidade é também a encarregada da Sociedade pela verificação da observância das regras e procedimentos descritos no Manual de Compliance e nas demais políticas da Sociedade.

Adicionalmente, essas regras e procedimentos visam garantir o permanente atendimento às normas, políticas e regulamentações vigentes, referentes às diversas modalidades de investimento, à própria atividade de administração de carteiras de valores mobiliários e aos padrões ético e profissional.

Dessa forma, estes procedimentos visam mitigar os riscos de acordo com a natureza, complexidade e risco das operações realizadas pela Sociedade, bem como, disseminar a cultura de controles para garantir o cumprimento da Resolução CVM nº 21/2021, bem como das demais normas estabelecidas pelos órgãos reguladores e autorreguladores.

c. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

A Área de Gestão de Riscos e Compliance utiliza as soluções Asset Portifólio Manager (APM) e Compliance Portifólio Manager (CPM), ambas da Lote 45, essas soluções contemplam o módulo de enquadramento e aderência aos regulamentos dos fundos, risco de mercado, risco de liquidez, teste de estresse e também testes de pré-trading.

As rotinas de compliance estão descritas de forma pormenorizada no Manual de Compliance, sendo que o diretor responsável se serve de planilhas internas para seu monitoramento.

d. A forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor

A Sociedade instituiu o Comitê de Gestão de Riscos e de Compliance como o órgão responsável para garantir a independência dos trabalhos executados pela área, nos quais são registrados em ata os temas e discussões abordadas. A Diretora da área possui canal direto com os acionistas da Sociedade, permitindo a comunicação de eventual transgressão às políticas e às normas legais, bem como aos órgãos reguladores.

8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de riscos, incluindo:

a. Quantidade de profissionais *

2

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Identificação, mensuração e gestão dos riscos inerentes às carteiras e riscos operacionais.

c. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

A Área de Gestão de Riscos e Compliance utiliza a solução da Lote 45 para a gestão de risco. A solução contempla análises de sensibilidade, cálculo de VaR, Stress, por diferentes modelagens paramétricas e não paramétricas. Os procedimentos envolvidos encontram-se descritos na Política de Gestão de Riscos da Sociedade e na Política de Gestão do Risco de Liquidez, disponibilizadas em seu site na internet.

d. A forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

A Diretora de Riscos e Conformidade atua com completa independência para tomar qualquer decisão quanto às questões de controle de risco, eventuais desenquadramentos e cumprimento da metodologia, sendo de sua exclusiva responsabilidade a gestão sobre essa área, inclusive sendo tal prerrogativa garantida nas reuniões do Comitê de Riscos e Compliance.

A gestão e o controle de riscos da Sociedade permitem o monitoramento das estratégias realizadas, identificando, mensurando e controlando todas as operações, suportando assim o desenvolvimento sustentado das atividades dos fundos de investimento, visando o melhor interesse dos clientes.

8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, de controle e de processamento de ativos e da escrituração da emissão e resgate de cotas, incluindo:

a. Quantidade de profissionais

0

b. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

N/A

c. A indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividades

N/A

8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:

a. Quantidade de profissionais

0

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

N/A

c. Programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas

N/A

d. Infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos, programas e serviços utilizados na distribuição

N/A

e. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

N/A

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

Não há outras informações que a Sociedade julgue relevantes a serem divulgadas neste item.

9. Remuneração da Empresa

9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 2.1. do anexo 15-I, indicar as principais formas de remuneração que pratica:

A remuneração da Sociedade é proveniente exclusivamente de taxa de administração e de taxa de performance dos fundos de investimento sob gestão.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total aferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente dos clientes, durante o mesmo período, em decorrência de:

a. Taxa com bases fixas (%):

77,20

b. Taxa de performance (%):

22,80

c. Taxa de ingresso (%):

0,00

d. Taxa de saída (%):

0,00

e. Outras taxas (%):

0,00

Total (%):

100,00

9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:

Não há outras informações que a Sociedade julgue relevantes a serem divulgadas neste item.

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços

De forma resumida, o processo de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços consiste na avaliação da qualidade e do potencial do contratado em agregar valor às atividades da Sociedade, assim como na verificação da sua regularidade e idoneidade, seguindo o processo de due diligence previsto em política própria.

Ainda, o processo de contratação de corretoras de títulos e valores mobiliários é realizado mediante análise das respostas indicadas pela Corretora no Questionário de Due Diligence ANBIMA para Contratação de Corretoras. Já o processo de supervisão e monitoramento é realizado mediante metodologia baseada em risco, sendo a instituição contratada avaliada de acordo com os seguintes critérios: (i) criticidade da atividade desempenhada para a gestão das carteiras dos fundos de investimento; (ii) existência de redundância com relação ao prestador; (iii) existência de pessoa politicamente exposta não quadro societário ou principais executivos da instituição; (iv) identificação de ressalvas no processo de due diligence; (v) ocorrência de não conformidades reportadas pela equipe.

Por fim, além da supervisão baseada em risco acima descrita, a Sociedade também classifica e monitora todos os prestadores de serviços de acordo com o risco de exposição a situações de lavagem de dinheiro, financiamento ao terrorismo e financiamento da proliferação de armas de destruição em massa, conforme definido na Política de PLD/FTP.

10.2. Descrever como os custos de transação de valores mobiliários são monitorados e minimizados



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Para minimizar os custos de transação com valores mobiliários a Sociedade procura:

- (i) priorizar a negociação de ativos financeiros com alta liquidez;
- (ii) acessar mercados com bid/ask spread menores, isto é, menor diferença nos preços das ofertas de compra e venda;
- (iii) cotar com diversas contrapartes antes de fechar uma operação para ativos financeiros não listados e/ou majoritariamente negociados em balcão; e
- (iv) na seleção das corretoras, priorizar, além da idoneidade, aquelas especialistas no mercado operado e que oferecem qualidade de execução.

10.3. Descrever as regras para o tratamento de soft dollar, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens, etc

Soft Dollar:

É expressamente proibido prometer, oferecer, conceder ou receber qualquer forma de presente, gratificação ou cortesia que motive uma ação ilegal, imprópria ou inadequada com relação aos negócios e serviços prestados pela Sociedade.

A Sociedade orienta seu corpo profissional a evitar aceitar presentes, vantagens pecuniárias ou materiais que possam representar relacionamento impróprio, conflito de interesses, prejuízo financeiro ou de reputação para a Sociedade. Em caso de dúvida sobre a possibilidade de aceitar os presentes nas hipóteses supracitadas, o colaborador deverá entrar em contato com a Diretora de Riscos e Conformidade.

Brindes sem valor comercial, ou seja, aqueles distribuídos por entidades de qualquer natureza a título de cortesia, propaganda, divulgação habitual ou por ocasião de eventos especiais ou datas comemorativas, não são considerados presentes e poderão ser aceitos.

O relacionamento da Sociedade com agentes públicos no que diz respeito à oferta e recebimento de brindes, presentes e cortesias é estritamente profissional, com valores e situações que obedecem a legislação em vigor e o código de ética e conduta da administração pública federal.

Convites para eventos com despesas custeadas por clientes, fornecedores, órgãos governamentais ou outras partes relacionadas somente podem ser aceitos mediante autorização expressa do superior hierárquico e da área de risco e Compliance, e somente quando existir a real oportunidade de desenvolvimento de contato comercial.

Toda participação em eventos com despesas custeadas por clientes ou fornecedores, bem como os presentes recebidos, a exceção dos brindes sem valor comercial, devem ser informados ao superior hierárquico, minimamente de nível gerencial, e à Diretora de Riscos e Conformidade.

10.4. Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados

A Gestão de Continuidade de Negócios (GCN), tem por objetivo atuar de forma planejada e organizada diante da ocorrência de incidentes, preservando a continuidade dos negócios considerados como críticos, direcionando os funcionários para o trabalho remoto, de forma que, em caso da ocorrência de um incidente, haverá a continuidade dos processos para atividade de gestão e de seus controles.

O GCN contempla:

- (i) Armazenagem e recuperação de informações necessárias para a realização das atividades diárias, foi levada em consideração a realização sistemática de backups; e
- (ii) Utilização de equipamento de Uninterruptible Power Supply ("UPS"), no caso no-break, instalado para manter estável e suprir o fornecimento de energia elétrica em caso de flutuação e/ou interrupção não programada. No-break, estará(ão) disponível(is) para os servidores da empresa e central telefônica, bem como para os colaboradores à critério da Sociedade. Devem ter capacidade suficiente para minimizar a perda de dados em processamento e/ou armazenados nos discos rígidos em caso de algum evento pontual e temporário, e garantir a integridade dos backups e a atualização dos mesmos.

Na hipótese de descontinuidade do suprimento de energia, ou na impossibilidade de acesso ao local de sede da Sociedade, esta contará com os procedimentos para acesso remoto a todos os sistemas que permitirão o retorno às atividades indispensáveis com brevidade.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

10.5. Descrever as políticas, as práticas e controles internos para a gestão do risco de liquidez das carteiras de valores mobiliários

A gestão do risco de liquidez é monitorada de forma que a liquidez das carteiras obedeça aos parâmetros nos respectivos regulamentos dos fundos sob gestão, possibilitando que possam honrar suas obrigações, em linha com a Política de Gestão de Riscos adotada pela Sociedade.

A gestão dos fundos prioriza a adoção de elevado grau de liquidez dos ativos na carteira, pois assim dois grandes benefícios são oferecidos: agilidade nas mudanças de posições com a consequente proteção nos períodos de maior volatilidade, e o aproveitamento das oportunidades de negócio que surgem em situações de stress. Dessa forma, a preocupação com a liquidez dos portfólios é constante.

Gerenciamento do Ativo: a metodologia de liquidez utilizada é o ADTV (Average Daily Traded Volume), método através do qual os ativos são ponderados pelo tempo que o gestor levaria para se desfazer da posição. Para esta análise são utilizadas séries históricas de volume negociado em mercados como ações, títulos públicos e derivativos, conforme descrito em manual próprio para o gerenciamento do risco de liquidez. Tal procedimento é efetuado semanalmente. Para cada mercado, os fundos de investimento sob gestão da Companhia possuem um percentual máximo de alocação.

A gestão de liquidez considera a média de volume de negociação dos últimos 3 (três) meses de cada papel para estimar quantos dias seria necessário para vender toda a posição. É usado 20% deste volume médio diário das negociações (ADTV) para calcular o número de dias necessários para zerar a posição.

Ainda, para o monitoramento e metodologia do risco de liquidez, inclusive em situações de estresse, a Companhia utiliza os indicadores calculados pelo sistema LOTE45 de "Índice de Liquidez", que combina o risco de liquidez dos ativos e dos passivos e do critério "Valor total do fundo ou carteira em ativos liquidáveis em determinado horizonte de tempo", estabelecido em dias úteis.

Gerenciamento do Passivo: para gerenciamento do passivo do fundo (grau de dispersão das cotas/cotistas), servirá de base para a parametrização do percentual de liquidez mínima aceitável da carteira. Assim, o gerenciamento do risco de liquidez do passivo leva em consideração (i) Regras de aplicação e resgate, ou seja, o número de dias úteis ou corridos para o recebimento dos recursos e para o pagamento do resgate, estando ambos definidos no regulamento dos Fundos; (ii) Perfil de concentração de cotistas, que indica o percentual do Fundo correspondente à posição de cada cotista, limitando-se a 50% (cinquenta por cento) por cotista ou distribuidor, excetuando-se os casos em que o fundo gerido pela Companhia seja exclusivo ou restrito, ou nos primeiros 12 meses após a abertura do fundo, enquanto a captação não estiver equalizada.

Os resgates conhecidos e pendentes de liquidação são considerados como obrigação do fundo para fins do cálculo do risco de liquidez.

Histórico de resgates: são utilizadas três métricas para resgates históricos: (i) 1 (um), 2 (dois), 3 (três), 4 (quatro), 5 (cinco), 21 (vinte e um), 42 (quarenta e dois), 63 (sessenta e três) dias úteis; (ii) 99º percentil dos resgates diários; (iii) e maior resgate histórico (excluindo capital interno) nos últimos 252 dias úteis.

- Processo de Acompanhamento Gerenciamento de Risco de Liquidez/Concentração: o processo de acompanhamento e gerenciamento do risco de liquidez/concentração tem como objetivo o controle e a mitigação do risco.

Outrossim, importa frisar que compete ao Comitê de Gestão de Riscos e de Compliance a análise e revisão do consumo de risco de liquidez dos fundos sob gestão no período, bem como a tomada de decisão em caso de extrapolação.

10.6. Descrever as políticas, as práticas e controles internos para o cumprimento das normas específicas de que trata o inciso I do art. 30, caso decida atuar na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor

A Sociedade não exerce quaisquer atividades de distribuição de cotas de fundos de investimento.

10.7. Endereço da página do administrador na rede mundial de computadores na qual podem ser encontrados os documentos exigidos pelo art. 14 desta Instrução

<http://www.irbasset.com>

11. Contingências

Importante: Não é necessário avaliação do administrador a respeito da chance de perda ou do valor que acredita ser efetivamente devedor em caso de eventual condenação.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, e sejam relevantes para seu patrimônio pessoal, incluindo:

a. Principais fatos *

Não aplicável, uma vez que a Sociedade não figura no polo passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável, uma vez que a Sociedade não figura no polo passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteira de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem o seus negócios ou sua reputação profissional, incluindo:

a. Principais fatos

Não aplicável, uma vez que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários não figura no polo passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais que afetem sua reputação profissional.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável, uma vez que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários não figura no polo passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais que afetem sua reputação profissional.

11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores:

Não aplicável, uma vez que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários não figura no polo passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais que afetem sua reputação profissional.

11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas no últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que tenha figurado no polo passivo, indicando:

a. Principais fatos

Não aplicável, uma vez que não houve condenações judiciais, administrativas ou arbitrais prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos em que a Sociedade tenha figurado no polo passivo.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável, uma vez que não houve condenações judiciais, administrativas ou arbitrais prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos em que a Sociedade tenha figurado no polo passivo.

11.5. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo e tenha afetado seus negócios ou sua reputação profissional, indicando:

a. Principais fatos



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Não aplicável, uma vez que não houve condenações judiciais, administrativas ou arbitrais prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo e tenham afetado seus negócios ou sua reputação profissional.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável, uma vez que não houve condenações judiciais, administrativas ou arbitrais prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo e tenham afetado seus negócios ou sua reputação profissional.

12. Declarações

Declaração do administrador, atestando:

Que reviu o formulário de referência

Marcado

Que o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo de seus negócios (PF) ou da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa (PJ)

Marcado

Declarações adicionais do administrador, informando sobre

Acusações decorrentes de processos administrativos, bem como punições sofridas, nos últimos 5 (cinco) anos, em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, Banco Central do Brasil, Superintendência de Seguros Privados - SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar - PREVIC, incluindo que não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos

Nada a declarar

Marcado

Condenações por crime falimentar, prevaricação, suborno, concussão, peculato, "Lavagem" de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores, contra a economia popular, a ordem econômica, as relações de consumo, a fé pública ou a propriedade pública, o sistema financeiro nacional, ou a pena criminal que vede, ainda que temporariamente, o acesso a cargos públicos, por decisão transitada em julgado, ressalvada a hipótese de reabilitação

Nada a declarar

Marcado

Impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa

Nada a declarar

Marcado

Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

Nada a declarar



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Mercado

Inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado

Nada a declarar

Mercado

Títulos contra si levados a protesto

Nada a declarar

Mercado

Data de envio: 31/03/2023 - 16:51:00

Data de impressão: 31/03/2023

Hora de impressão: 16:54:06