

TERMO DE ANÁLISE E ATESTADO DE CREDENCIAMENTO DE INSTITUIÇÃO

Ente Federativo: Município de Erechim/RS – 87.613.477/0001-20

Unidade Gestora: Instituto Erechinense de Previdência – 23.681.516/0001-44

42.040.639/0001-40 – Caixa DTVM

Número do Processo Administrativo: 14/2024

Número do Termo de Análise: 01/2024

Tipo de Instituição: Gestor;

Data do Credenciamento: 25/01/2024

Validade: 2 anos

DADOS CADASTRAIS

Razão Social: CAIXA DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.

Data de Constituição: 14/04/2021

Endereço: AV PAULISTA, 2300, ANDAR 11 CONJ 112 E 114 CEP 01.310-300, São Paulo - SP

Contato: gerdi@caixa.gov.br - (11) 3572-4600

Endereço Eletrônico: <https://www.caixa.gov.br/caixa-asset/Paginas/default.aspx>

Registro na CVM: 27/09/2021 Distribuidoras, 31/08/2021 Prest. Serviços de Administração de Carteira

Registro no Banco Central: Sociedade Distribuidora de TVM

REGULARIDADE FISCAL E PREVIDENCIÁRIA

Certidão	Situação	Validade	Disponível em
Municipal	Regular	25/06/2024	https://duc.prefeitura.sp.gov.br/certidoes/forms_anonimo/frmConsultaEmissaoCertificado.aspx
Estadual	Regular	16/07/2024	https://www10.fazenda.sp.gov.br/CertidaoNegativaDeb/Pages/EmissaoCertidaoNegativa.aspx
Federal	Regular	28/04/2024	https://solucoes.receita.fazenda.gov.br/Servicos/certidaointernet/PJ/Emitir
FGTS	Regular	30/01/2024	https://consulta-crf.caixa.gov.br/consultacrf/pages/consultaEmpregador.jsf

ANÁLISE DA INSTITUIÇÃO

Decisão de investimentos

O presente documento tem a finalidade de avaliar unicamente a instituição alvo do processo de credenciamento. Para futura tomada de decisão de investimentos, deverão ser analisadas as necessidades e estratégias do RPPS, bem como as classes e categorias de fundos gerenciados pela instituição e seus respectivos riscos intrínsecos, o que será explorado no credenciamento pertinente ao fundo.

Embasamento em formulários de diligência previstos em códigos de autorregulação

A análise foi embasada no Questionário Due Diligence da Anbima, no Formulário de Referência, e informações públicas disponíveis na CVM e na rede mundial de computadores.

Estrutura e Segregação de Atividades

A CAIXA DTVM é subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL. A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL é uma empresa 100% pública, controlada pelo Governo Federal. Para mais detalhes, consulte o item 2.2 do Questionário Due Diligence. A CAIXA DTVM presta atualmente somente os serviços de gestão de Fundos de Investimento, e toda a gestão é independente, inclusive com uma mesa de operações própria. Os serviços de administração fiduciária, distribuição de fundos de investimento e custódia e controladoria são exercidos dentro da estrutura da controladora, CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, conforme abaixo: A VIART (VP Fundos de Investimento) é responsável pelos serviços de administração fiduciária e de custódia e controladoria. Trata-se de uma Vice-presidência inserida na estrutura organizacional da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, que é segregada das demais e que não integra o Conselho Diretor, conforme artigo 13, § 4º e artigo 28 do Estatuto da CAIXA. Dentro da Vice-presidência, as duas atividades são segregadas por Gerências Nacionais, sendo a atividade de Administração Fiduciária exercida pela GN Administração Fiduciária (GEAFI), e as atividades de custódia e controladoria exercidas pela GN Serviços Qualificados (GESEQ). A distribuição de fundos de

investimento é realizada pela controladora, por meio da sua rede de agências e conta com áreas especializadas no relacionamento e atendimento para nichos específicos.

Qualificação do corpo técnico

A estrutura é muito bem organizada e segmentada, com claras responsabilidades e controles. Em março de 2021, havia 256 funcionários, sendo 47 na equipe de investimento dos fundos tradicionais. A estrutura conta com um vice-presidente (CEO), dois diretores. De acordo com a documentação disponibilizada pela instituição, confirma-se que os profissionais diretamente relacionados à gestão de ativos de terceiros possuem experiência mínima de 5 anos na atividade.

A instituição está alinhada aos objetivos do RPPS quanto à independência na prestação dos serviços e ausência de potenciais conflitos de interesse nos termos do Art. 24 da Resolução CMN nº 4.963/2021?

Nas verificações realizadas, não foram localizados potenciais conflitos de interesse que desaconselhem um relacionamento seguro com a instituição. Os formulários de diligência avaliados descrevem a existência de segregação de atividades no funcionamento da organização. Ademais, a instituição possui uma área de compliance, que é responsável pela fiscalização das atividades, cumprimento das leis, normas e procedimentos internos.

CONCLUSÕES DA ANÁLISE PARA PREENCHIMENTO NO CADPREV

A instituição é autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil obrigada a instituir comitê de auditoria e de riscos, nos termos da regulamentação do Conselho Monetário Nacional (incisos I e II do parágrafo 2º do Art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021)?
Não.

Volume de recursos

Gerido: 500.529.497.715,63

A instituição se encontra em funcionamento normal junto à Comissão de Valores Mobiliários?

Sim.

Atos de registro ou autorização para funcionamento expedido por órgão competente

Registro na CVM: 27/09/2021 Distribuidoras, 31/08/2021 Prest. Serviços de Administração de Carteira

Registro no Banco Central: Sociedade Distribuidora de TVM

Observância de elevado padrão ético de conduta nas operações realizadas no mercado financeiro e ausência de restrições verificadas por órgãos competentes

A pesquisa de processos administrativos sancionados registrados na CVM não retornou resultados. A consulta de multas e descumprimentos registrados na Anbima não retornou resultados. A instituição está livre de registros de suspensão ou de inabilitação na CVM e no Banco Central, de modo que não possui restrições que desaconselhem um relacionamento seguro.

Análise do histórico de atuação da instituição e de seus controladores

Atua há 3 anos no mercado. Possui R\$ 500.529.497.715,63 sob gestão. Seu rating de gestão de qualidade foi expedido pela Fitch com nota IMQR e perspectiva Excelente.

Verificação de experiência de atuação

Atua há 3 anos no mercado, conforme registro na CVM.

Análise de volume de recursos sob sua gestão e administração, da qualificação do corpo técnico e da segregação de atividades

Possui R\$ 500.529.497.715,63 sob gestão. O corpo técnico é adequado, com certificações reconhecidas no mercado financeiro e constituição de diversos comitês para tomadas de decisão.

Avaliação da aderência da rentabilidade aos indicadores de desempenho e riscos assumidos pelos fundos sob sua gestão e administração, no período mínimo de 2 (dois) anos anteriores ao credenciamento

Foram localizados 37 fundos geridos pela instituição:

00.834.074/0001-23 | Alpha de Jensen 24m: -6,2800 | Vol 24m: 0,0900 | Ret 24m: 20,1600
01.525.057/0001-77 | Alpha de Jensen 24m: -3,4800 | Vol 24m: 19,1600 | Ret 24m: 4,1000
03.737.188/0001-43 | Alpha de Jensen 24m: 0,9500 | Vol 24m: 5,7500 | Ret 24m: 21,9100
03.737.206/0001-97 | Alpha de Jensen 24m: 0,5500 | Vol 24m: 0,1200 | Ret 24m: 26,9900
03.737.217/0001-77 | Alpha de Jensen 24m: -5,5800 | Vol 24m: 19,7200 | Ret 24m: 1,7600
05.114.716/0001-33 | Alpha de Jensen 24m: -4,5800 | Vol 24m: 0,1000 | Ret 24m: 21,8600
05.164.356/0001-84 | Alpha de Jensen 24m: 0,0000 | Vol 24m: 0,1200 | Ret 24m: 26,4300

05.164.358/0001-73 | Alpha de Jensen 24m: -0,6000 | Vol 24m: 0,1000 | Ret 24m: 25,8300
 05.164.364/0001-20 | Alpha de Jensen 24m: -0,1000 | Vol 24m: 0,1100 | Ret 24m: 26,3300
 05.900.798/0001-41 | Alpha de Jensen 24m: 7,7900 | Vol 24m: 16,9800 | Ret 24m: 18,6900
 08.046.355/0001-23 | Alpha de Jensen 24m: -9,1800 | Vol 24m: 19,6800 | Ret 24m: -1,7300
 08.070.841/0001-87 | Alpha de Jensen 24m: -1,7900 | Vol 24m: 3,8700 | Ret 24m: 21,4600
 10.577.503/0001-88 | Alpha de Jensen 24m: -3,8000 | Vol 24m: 8,0600 | Ret 24m: 19,0900
 10.577.519/0001-90 | Alpha de Jensen 24m: 2,3100 | Vol 24m: 4,8900 | Ret 24m: 26,4900
 10.646.885/0001-54 | Alpha de Jensen 24m: 0,4600 | Vol 24m: 0,1300 | Ret 24m: 26,8900
 10.646.895/0001-90 | Alpha de Jensen 24m: -3,0100 | Vol 24m: 5,2600 | Ret 24m: 21,0500
 10.740.658/0001-93 | Alpha de Jensen 24m: -2,8300 | Vol 24m: 5,1500 | Ret 24m: 21,2800
 10.740.670/0001-06 | Alpha de Jensen 24m: -0,3000 | Vol 24m: 0,4500 | Ret 24m: 26,0100
 11.060.913/0001-10 | Alpha de Jensen 24m: -2,6000 | Vol 24m: 2,3700 | Ret 24m: 22,8900
 11.061.217/0001-28 | Alpha de Jensen 24m: -0,3900 | Vol 24m: 2,4300 | Ret 24m: 24,9000
 13.058.816/0001-18 | Alpha de Jensen 24m: -0,3000 | Vol 24m: 19,2600 | Ret 24m: 7,1900
 14.120.520/0001-42 | Alpha de Jensen 24m: 0,5300 | Vol 24m: 0,4800 | Ret 24m: 26,9300
 14.386.926/0001-71 | Alpha de Jensen 24m: -3,3900 | Vol 24m: 2,5600 | Ret 24m: 22,1000
 14.507.699/0001-95 | Alpha de Jensen 24m: -2,7900 | Vol 24m: 19,6600 | Ret 24m: 4,6100
 14.508.605/0001-00 | Alpha de Jensen 24m: 1,6200 | Vol 24m: 3,2800 | Ret 24m: 26,5500
 14.508.643/0001-55 | Alpha de Jensen 24m: -3,7500 | Vol 24m: 0,1000 | Ret 24m: 22,6900
 15.154.220/0001-47 | Alpha de Jensen 24m: -24,3500 | Vol 24m: 25,8300 | Ret 24m: -19,3300
 15.154.236/0001-50 | Alpha de Jensen 24m: -0,1800 | Vol 24m: 19,7900 | Ret 24m: 7,4900
 15.154.441/0001-15 | Alpha de Jensen 24m: 3,9400 | Vol 24m: 17,3000 | Ret 24m: 14,3300
 17.502.937/0001-68 | Alpha de Jensen 24m: -46,1600 | Vol 24m: 22,4100 | Ret 24m: -18,1000
 23.215.008/0001-70 | Alpha de Jensen 24m: 0,7200 | Vol 24m: 0,1300 | Ret 24m: 27,1500
 23.215.097/0001-55 | Alpha de Jensen 24m: -1,2400 | Vol 24m: 1,5500 | Ret 24m: 24,6400
 30.036.235/0001-02 | Alpha de Jensen 24m: -11,5000 | Vol 24m: 19,6800 | Ret 24m: 7,1400
 30.068.169/0001-44 | Alpha de Jensen 24m: 1,5800 | Vol 24m: 18,3300 | Ret 24m: 11,8100
 30.068.224/0001-04 | Alpha de Jensen 24m: -12,1300 | Vol 24m: 19,5100 | Ret 24m: -3,5200
 34.660.276/0001-18 | Alpha de Jensen 24m: 0,8400 | Vol 24m: 3,9200 | Ret 24m: 23,9900
 35.536.532/0001-22 | Alpha de Jensen 24m: -1,7800 | Vol 24m: 1,6100 | Ret 24m: 24,0600

Não foram localizados fundos administrados pela instituição que sejam enquadrados para RPPS.

O Alfa de Jensen é uma medida do desempenho da fundo, indicando uma boa performance caso o coeficiente seja significativamente positivo; valores próximos de zero são neutros; e um coeficiente significativamente negativo aponta que o risco do fundo não tem se convertido em maiores retornos. A volatilidade é uma forma de representar o risco do fundo, medindo o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período. O retorno representa a rentabilidade do fundo no período.

ATESTADO DE CREDENCIAMENTO

O Termo de Credenciamento é o documento pelo qual se formaliza a relação entre a unidade gestora do RPPS e a credenciada, demonstrando o cumprimento das condições de sua habilitação e aptidão para intermediar ou receber as aplicações dos recursos. A sua assinatura não estabelece obrigatoriedade de aplicação ou adesão a nenhum fundo de investimento ou ativo financeiro emitido, administrado, gerido ou distribuído pela credenciada.

Ao firmar a assinatura abaixo, os responsáveis pelo credenciamento atestam que revisaram as informações contidas neste documento e que julgam a instituição como apta a receber recursos do RPPS.

NOME	CARGO	CPF	ASSINATURA
Diones Ricardo Weber	Comitê de Investimentos	007.430.940-42	
Renato Alencar Toso	Comitê de Investimentos	000.840.050-41	
Edson Luis Kammler	Comitê de Investimentos	688.888.050,87	
Gleison José Soletti	Comitê de Investimentos	942.445.640-72	
Marcio Martin Barbosa	Comitê de Investimentos	973.920.490-20	

DECLARAÇÃO

Nos termos do inciso VI, §1º, art. 1º da Resolução CMN nº 4.963/21, os responsáveis pela gestão do Regime Próprio de Previdência Social (RPPS) deverão realizar o prévio credenciamento das instituições administradoras e gestoras dos fundos de investimento em que serão aplicados os recursos. O § 3º do art. 1º da Resolução dispõe que credenciamento deverá observar, dentre outros critérios, o histórico e a experiência de atuação, o volume de recursos sob a gestão e administração da instituição, a solidez patrimonial, a exposição a risco reputacional, padrão ético de conduta e aderência da rentabilidade a indicadores de desempenho. Os parâmetros para credenciamento estão previstos nos arts. 103 a 106 da Portaria MTP nº1.467/22, sendo que o art. 106, IV, dispõe que “A conclusão da análise das informações e da verificação dos requisitos estabelecidos para o credenciamento deverá ser registrada em Termo de Credenciamento, devendo, dentre outros aspectos colocados no dispositivo, ser instruído com os documentos previstos na instrução de preenchimento do modelo disponibilizado na página da Previdência Social na Internet”.

A Resolução CMN nº 4.963/2021 (inciso I, § 2º, do art. 21) manteve a exigência das aplicações de recursos dos RPPS serem realizadas apenas em fundos de investimento em que o administrador ou gestor do fundo seja instituição autorizada a funcionar pelo BACEN, obrigada a instituir comitê de auditoria e comitê de riscos, nos termos das Resoluções CMN nº 4.910, de 27 de maio de 2021, e nº 4.557, de 23 fevereiro de 2017, respectivamente. Além disso, as pessoas jurídicas deverão ser registradas como administradores de carteiras de valores mobiliários (nos termos da Resolução CVM nº 21, de 25 de fevereiro de 2021).

Na prática do mercado, essas condições estão mais relacionadas aos administradores dos fundos de investimento, aos quais, adicionalmente ao requisito dos comitês de auditoria e de riscos, os recursos oriundos de RPPS sob sua administração devem representar no máximo 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração (inciso II, § 2º, Art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021), com o objetivo de que os administradores elegíveis apresentem maior diversificação de seu campo de atuação e evidenciem reconhecida confiança e competência na administração de recursos de terceiros pelo mercado.

Vale lembrar que por meio do Ofício Circular Conjunto nº 2/2018/CVM/SIN/SPREV, a SPREV e a CVM já orientaram os gestores de RPPS e prestadores de serviço dos fundos sobre a aplicação desses critérios, com a divulgação de lista das instituições que atendem aos requisitos dos incisos I e II do § 2º e § 8º do art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021, divulgada no sítio da internet da SPREV. A lista foi confeccionada com base nas informações repassadas pelo BACEN e refere-se às instituições registradas pela CVM nos termos da Resolução 21, de 25/02/2021.

Considerando que o objetivo do CMN, ao incluir esses requisitos para as aplicações dos RPPS, buscou conferir maior proteção e segurança a essas alocações, sem prejudicar a rentabilidade, os custos e a sua transparência, e que a lista das instituições que atendem aos critérios previstos nos incisos I do § 2º do art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021, divulgada pela SPREV, é taxativa, entendeu-se que, a princípio, poder-se-ia aplicar as todas as instituições que operam com os RPPS um modelo mais simplificado de Termo de Análise de Credenciamento. A utilização desse modelo não afasta a responsabilidade dos dirigentes do RPPS pela criteriosa análise do fundo de investimento que receberá os recursos do RPPS, tendo em vista que a própria Resolução CMN e a Portaria MTP nº1.467/22 tratam dos critérios mínimos de análise que devem ser observados na seleção de ativos.

Nesse contexto, a Resolução CMN nº 4.963/2021, em seu art. 1º, §5º, destaca que são incluídas no rol de responsáveis pela gestão do RPPS na medida de suas atribuições, os gestores, dirigentes e membros dos conselhos e órgãos colegiados de deliberação, de fiscalização ou do comitê de investimentos do regime próprio de previdência social, os consultores e outros profissionais que participem do processo de análise, de assessoramento e decisório sobre a aplicação dos recursos do regime próprio de previdência social, diretamente ou por intermédio de pessoa jurídica contratada e os agentes que participam da distribuição, intermediação e administração dos ativos aplicados por esses regimes. O RPPS tem o dever de monitorar periodicamente os prestadores de serviços, avaliando suas capacidades técnicas e prevenindo potenciais conflitos de interesses na relação, em linha com o disposto nos §§ 1º, 2º e 3º, do art. 24, da Resolução CMN nº 4.963/2021.

Por fim, o art. 8-A, da Lei 9.717/1998, norma que adquiriu status de Lei Complementar após a Emenda Constitucional nº 103/2019, deixa claro que os dirigentes do ente federativo instituidor do regime próprio de previdência social e da unidade gestora do regime e os demais responsáveis pelas ações de investimento e aplicação dos recursos previdenciários, inclusive os consultores, os distribuidores, a instituição financeira administradora da carteira, o fundo de investimentos que tenha recebido os recursos e seus gestores e administradores serão solidariamente responsáveis, na medida de sua participação, pelo ressarcimento dos prejuízos decorrentes de aplicação em desacordo com a legislação vigente a que tiverem dado causa.

Além dos princípios, requisitos e limites previstos na Resolução do CMN, devem ser permanentemente observados os parâmetros gerais da gestão dos investimentos previstos na Portaria MTP nº 1.467/2022, em especial o disposto em seus arts. 86, 87 e 103 a 124.

Ciente.

Assinado de forma digital por
RENATO ALENCAR
TOSO:00084005041
Dados: 2024.02.29 13:59:50 -03'00'

Assinatura do Dirigente da Unidade Gestora
com firma reconhecida ou disponibilizada no endereço eletrônico na rede mundial de computadores

DIONES RICARDO

WEBER:00743094042

Assinado de forma digital por DIONES
RICARDO WEBER:00743094042
Dados: 2024.02.29 10:10:04 -03'00'

Assinatura do Gestor de Recursos do RPPS
com firma reconhecida ou disponibilizada no endereço eletrônico na rede mundial de computadores

FABIANA BARBACOV
DAL
VESCO:97114677049

Assinado de forma digital por
FABIANA BARBACOV DAL
VESCO:97114677049
Dados: 2024.02.29 11:23:18 -03'00'

Assinatura de representante(s) legal(is) da Instituição interessada no credenciamento
com firma reconhecida ou disponibilizada no endereço eletrônico na rede mundial de computadores

 REPÚBLICA FEDERATIVA DO BRASIL CADASTRO NACIONAL DA PESSOA JURÍDICA			
NÚMERO DE INSCRIÇÃO 42.040.639/0001-40 MATRIZ	COMPROVANTE DE INSCRIÇÃO E DE SITUAÇÃO CADASTRAL		DATA DE ABERTURA 14/04/2021
NOME EMPRESARIAL CAIXA DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.			
TÍTULO DO ESTABELECIMENTO (NOME DE FANTASIA) CAIXA DTVM			PORTE DEMAIS
CÓDIGO E DESCRIÇÃO DA ATIVIDADE ECONÔMICA PRINCIPAL 66.12-6-02 - Distribuidoras de títulos e valores mobiliários			
CÓDIGO E DESCRIÇÃO DAS ATIVIDADES ECONÔMICAS SECUNDÁRIAS Não informada			
CÓDIGO E DESCRIÇÃO DA NATUREZA JURÍDICA 205-4 - Sociedade Anônima Fechada			
LOGRADOURO AV PAULISTA	NÚMERO 750	COMPLEMENTO ANDAR 7 E 8	
CEP 01.310-908	BAIRRO/DISTRITO BELA VISTA	MUNICÍPIO SAO PAULO	UF SP
ENDEREÇO ELETRÔNICO DITVM@CAIXA.GOV.BR		TELEFONE (11) 3572-4600	
ENTE FEDERATIVO RESPONSÁVEL (EFR) *****			
SITUAÇÃO CADASTRAL ATIVA		DATA DA SITUAÇÃO CADASTRAL 14/04/2021	
MOTIVO DE SITUAÇÃO CADASTRAL			
SITUAÇÃO ESPECIAL *****		DATA DA SITUAÇÃO ESPECIAL *****	

Aprovado pela Instrução Normativa RFB nº 1.863, de 27 de dezembro de 2018.

Emitido no dia **25/05/2023** às **13:34:07** (data e hora de Brasília).

Página: 1/1



MINISTÉRIO DA FAZENDA
Secretaria da Receita Federal do Brasil
Procuradoria-Geral da Fazenda Nacional

**CERTIDÃO NEGATIVA DE DÉBITOS RELATIVOS AOS TRIBUTOS FEDERAIS E À DÍVIDA
ATIVA DA UNIÃO**

Nome: CAIXA DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.
CNPJ: 42.040.639/0001-40

Ressalvado o direito de a Fazenda Nacional cobrar e inscrever quaisquer dívidas de responsabilidade do sujeito passivo acima identificado que vierem a ser apuradas, é certificado que não constam pendências em seu nome, relativas a créditos tributários administrados pela Secretaria da Receita Federal do Brasil (RFB) e a inscrições em Dívida Ativa da União (DAU) junto à Procuradoria-Geral da Fazenda Nacional (PGFN).

Esta certidão é válida para o estabelecimento matriz e suas filiais e, no caso de ente federativo, para todos os órgãos e fundos públicos da administração direta a ele vinculados. Refere-se à situação do sujeito passivo no âmbito da RFB e da PGFN e abrange inclusive as contribuições sociais previstas nas alíneas 'a' a 'd' do parágrafo único do art. 11 da Lei nº 8.212, de 24 de julho de 1991.

A aceitação desta certidão está condicionada à verificação de sua autenticidade na Internet, nos endereços <<http://rfb.gov.br>> ou <<http://www.pgfn.gov.br>>.

Certidão emitida gratuitamente com base na Portaria Conjunta RFB/PGFN nº 1.751, de 2/10/2014.

Emitida às 11:33:21 do dia 31/10/2023 <hora e data de Brasília>.

Válida até 28/04/2024.

Código de controle da certidão: **2508.335E.71F1.181E**

Qualquer rasura ou emenda invalidará este documento.



Secretaria da Fazenda e Planejamento do Estado de São Paulo

Débitos Tributários Não Inscritos na Dívida Ativa do Estado de São Paulo

CNPJ: 42.040.639/0001-40

Ressalvado o direito da Secretaria da Fazenda e Planejamento do Estado de São Paulo de apurar débitos de responsabilidade da pessoa jurídica acima identificada, é certificado que **não constam débitos** declarados ou apurados pendentes de inscrição na Dívida Ativa de responsabilidade do estabelecimento matriz/filial acima identificado.

Certidão nº 24010625268-08
Data e hora da emissão 16/01/2024 16:22:37
Validade 6 (seis) meses, contados da data de sua expedição.

Qualquer rasura ou emenda invalidará este documento.

A aceitação desta certidão está condicionada à verificação de sua autenticidade no sítio www.pfe.fazenda.sp.gov.br



**PREFEITURA DE
SÃO PAULO**
FAZENDA

SECRETARIA MUNICIPAL DA FAZENDA

Certidão Conjunta de Débitos de Tributos Mobiliários

Certidão Número: 1356293 - 2023

CPF/CNPJ Raiz: 42.040.639/

Contribuinte: CAIXA DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.

Liberação: 28/12/2023

Validade: 25/06/2024

Tributos Abrangidos: Imposto Sobre Serviços - ISS
Taxa de Fiscalização de Localização Instalação e Funcionamento
Taxa de Fiscalização de Anúncio - TFA
Taxa de Fiscalização de Estabelecimento - TFE
Taxa de Resíduos Sólidos de Serviços de Saúde - TRSS (incidência a partir de Jan/2011)
Imposto Sobre Transmissão de Bens Imóveis - ITBI

Unidades Tributárias:

CCM 6.945.911-8- Início atv :14/04/2021 (AV PAULISTA, 750 - CEP: 01310-908)

Ressalvado o direito de a Fazenda Municipal cobrar e inscrever quaisquer dívidas de responsabilidade do sujeito passivo que vierem a ser apuradas ou que se verifiquem a qualquer tempo, inclusive em relação ao período contido neste documento, relativas a tributos administrados pela Secretaria Municipal da Fazenda e a inscrições em Dívida Ativa Municipal, junto à Procuradoria Geral do Município é certificado que a Situação Fiscal do Contribuinte supra, referente aos créditos tributários inscritos e não inscritos na Dívida Ativa abrangidos por esta certidão, até a presente data é: **REGULAR.**

A aceitação desta certidão está condicionada à verificação de sua autenticidade na Internet, no endereço <http://www.prefeitura.sp.gov.br/cidade/secretarias/fazenda/>.
Qualquer rasura invalidará este documento.

Certidão expedida com base na Portaria Conjunta SF/PGM nº 4, de 12 de abril de 2017, Instrução Normativa SF/SUREM nº 3, de 6 de abril de 2015, Decreto 50.691, de 29 de junho de 2009, Decreto 51.714, de 13 de agosto de 2010; Portaria SF nº 268, de 11 de outubro de 2019 e Portaria SF nº 182, de 04 de agosto de 2021.

Certidão emitida às 16:22:06 horas do dia 16/01/2024 (hora e data de Brasília).

Código de Autenticidade: A650D9AF

A autenticidade desta certidão deverá ser confirmada na página da Secretaria Municipal da Fazenda <http://www.prefeitura.sp.gov.br/sf>

[Voltar](#)[Imprimir](#)

Certificado de Regularidade do FGTS - CRF

Inscrição: 42.040.639/0001-40
Razão Social: CAIXA DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS SA
Endereço: AV PAULISTA 750 7º E 8º ANDARES / BELA VISTA / / / 01310-908

A Caixa Econômica Federal, no uso da atribuição que lhe confere o Art. 7, da Lei 8.036, de 11 de maio de 1990, certifica que, nesta data, a empresa acima identificada encontra-se em situação regular perante o Fundo de Garantia do Tempo de Serviço - FGTS.

O presente Certificado não servirá de prova contra cobrança de quaisquer débitos referentes a contribuições e/ou encargos devidos, decorrentes das obrigações com o FGTS.

Validade: 01/01/2024 a 30/01/2024

Certificação Número: 2024010102183777414941

Informação obtida em 15/01/2024 10:00:35

A utilização deste Certificado para os fins previstos em Lei esta condicionada a verificação de autenticidade no site da Caixa: **www.caixa.gov.br**



ESTATUTO SOCIAL

CAIXA ASSET



**CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS
E VALORES MOBILIÁRIOS S/A**

ESTATUTO SOCIAL

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A

RAZÃO SOCIAL E NATUREZA JURÍDICA

Art. 1º A CAIXA Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S/A, doravante denominada CAIXA DTVM ou Companhia, subsidiária integral da Caixa Econômica Federal - CAIXA, é uma sociedade por ações, de capital fechado, constituída conforme autorização do art. 1º da Lei nº 11.908/2009 de 3 de março de 2009, e na Resolução do Conselho Monetário Nacional – CMN nº 1.120, de 04 de abril de 1986, rege-se pela Lei nº 6.404, de 15 de dezembro de 1976, Lei nº 13.303, de 30 de junho de 2016, Decreto nº 8.945, de 27 de dezembro de 2016, por este Estatuto e demais disposições legais aplicáveis.

SEDE

Art. 2º A sociedade tem sede e foro na cidade de São Paulo/SP, podendo criar, instalar e suprimir sucursais, filiais, representações e escritórios em qualquer parte do território nacional ou no exterior, observadas as normas do Conselho Monetário Nacional - CMN, do Banco Central do Brasil – BACEN e da Comissão de Valores Mobiliários - CVM.

PRAZO DE DURAÇÃO

Art. 3º O prazo de duração da sociedade é indeterminado.

OBJETO SOCIAL

Art. 4º A CAIXA DTVM tem por objeto:

- I. subscrever, isoladamente ou em consórcio com outras sociedades autorizadas, emissões de títulos e valores mobiliários para revenda;
- II. intermediar oferta pública e distribuição de títulos e valores mobiliários no mercado;
- III. comprar e vender títulos e valores mobiliários, por conta própria e de terceiros, observada a regulamentação baixada pelo Banco Central e pela Comissão de Valores Mobiliários nas suas respectivas áreas de competência;
- IV. encarregar-se da administração de carteiras, da gestão de recursos e da custódia de títulos e valores mobiliários;

- V. incumbir-se da subscrição, da transferência e da autenticação de endossos, de desdobramento de cautelas, de recebimento e pagamento de resgates, juros e outros proventos de títulos e valores mobiliários;
- VI. exercer funções de agente fiduciário;
- VII. instituir, organizar e administrar fundos e clubes de investimento;
- VIII. constituir sociedade de investimento - capital estrangeiro e administrar a respectiva carteira de títulos e valores mobiliários;
- IX. praticar operações no mercado de câmbio de taxas flutuantes;
- X. praticar operações de conta margem, conforme regulamentação da Comissão de Valores Mobiliários;
- XI. realizar operações compromissadas;
- XII. praticar operações de compra e venda de metais preciosos no mercado físico, por conta própria e de terceiros, nos termos da regulamentação baixada pelo Banco Central;
- XIII. operar em bolsas de mercadorias e de futuros, por conta própria e de terceiros, observada regulamentação baixada pelo Banco Central e pela Comissão de Valores Mobiliários nas suas respectivas áreas de competência;
- XIV. prestar serviços de intermediação e de assessoria ou assistência técnica em operações e atividades nos mercados financeiro e de capitais;
- XV. exercer outras atividades para as quais obtiver autorização expressa do Banco Central do Brasil ou da Comissão de Valores Mobiliários;

VEDAÇÕES

Art. 5º É vedado à CAIXA DTVM:

- I. realizar operações que caracterizem, sob qualquer forma, a concessão de financiamentos, empréstimos ou adiantamentos a seus clientes, inclusive por meio da cessão de direitos, ressalvadas as hipóteses de operação de conta margem e as demais previstas na regulamentação em vigor;
- II. cobrar, de seus comitentes, corretagem ou qualquer outra comissão referente a negociações com determinado valor mobiliário durante seu período de distribuição primária;

- III. adquirir bens não destinados ao uso próprio, salvo os recebidos em liquidação de dívidas de difícil ou duvidosa solução, caso em que deverá vendê-los dentro do prazo de 1 (um) ano, a contar do recebimento, período este prorrogável por até 2 (duas) vezes, a critério do Banco Central;
- IV. dar ordens às sociedades corretoras para a realização de operações envolvendo comitente final que não tenha identificação cadastral na bolsa de valores;
- V. prestar garantias estranhas ao seu objeto social;
- VI. lançar debêntures ou outros títulos ou valores mobiliários, conversíveis em ações;
- VII. emitir partes beneficiárias.

CAPITAL SOCIAL

Art. 6º O capital social da CAIXA DTVM é de R\$ 50.000.000,00 (cinquenta milhões de reais) representado por

50.000.000 (cinquenta milhões) de ações, ordinárias nominativas, sem valor nominal.

Parágrafo único. O Capital Social poderá ser aumentado até o limite autorizado de R\$ 100.000.000,00 (cem milhões de reais) independente de reforma estatutária, por aprovação do Conselho de Administração, após manifestação do Conselho Fiscal.

EXERCÍCIO SOCIAL E DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS

Art. 7º O exercício social da CAIXA DTVM coincide com o ano civil, com término em 31 de dezembro de cada ano.

Art. 8º A Companhia deverá elaborar demonstrações financeiras trimestrais e divulgá-las em sítio eletrônico.

§1º Aplicam-se as regras de escrituração e elaboração de demonstrações financeiras contidas na Lei nº 6.404/76, devendo a auditoria independente ser realizada por auditor registrado na CVM.

§2º Ao fim de cada exercício social, a Diretoria fará elaborar, com base na legislação vigente e na escrituração contábil, as demonstrações financeiras aplicáveis às empresas de capital aberto, discriminando com clareza a situação do patrimônio da Companhia e as mutações ocorridas no exercício.

§3º Outras demonstrações financeiras intermediárias serão preparadas, caso necessárias ou exigidas por legislação específica.

ASSEMBLEIA GERAL

Art. 9º A Assembleia Geral é órgão decisório máximo e soberano da companhia, pelo qual o acionista se manifesta diretamente.

§1º A Assembleia Geral é composta pelo acionista único CAIXA sendo seus trabalhos dirigidos por mesa composta pelo presidente e secretário, escolhidos pelo acionista, dentre os membros presentes.

§2º A Assembleia Geral reunir-se-á na sede da CAIXA DTVM ordinariamente nos 4(quatro) meses seguintes ao término do exercício social, para os fins previstos em lei e extraordinariamente sempre que os interesses sociais o exigirem.

CONVOCAÇÃO

Art. 10º A Assembleia Geral será convocada pelo Conselho de Administração ou, nas hipóteses admitidas em lei, pela Diretoria, pelo Conselho Fiscal ou pelo acionista único CAIXA.

§1º A primeira convocação da Assembleia Geral será feita com antecedência mínima de 8 (oito) dias.

§2º Nas Assembleias Gerais tratar-se-á, exclusivamente, do objeto declarado nos editais de convocação, não se admitindo a inclusão, na pauta da Assembleia Geral, de assuntos gerais.

§3º As deliberações serão registradas no livro de atas, que podem ser lavradas de forma sumária, nos casos previstos na Lei nº 6.404/76.

COMPETÊNCIA

Art. 11 Compete à Assembleia Geral, além de outras atribuições especificadas na Lei nº 6.404/76 e demais normas aplicáveis, deliberar sobre:

- I. alteração do Estatuto Social;
- II. alteração do capital social da companhia inclusive aumento mediante a subscrição de novas ações;
- III. alienação de ações do capital social da CAIXA DTVM;
- IV. abertura do capital social da CAIXA DTVM;

- V. transformação, fusão, incorporação, cisão, dissolução e liquidação da CAIXA DTVM;
- VI. eleição e destituição, a qualquer tempo, de liquidantes, julgando-lhes as contas;
- VII. permuta de ações ou outros valores mobiliários;
- VIII. alienação ações do capital social da CAIXA DTVM, mantidas em tesouraria;
- IX. aprovação das contas, demonstrações financeiras, destinação do resultado do exercício, da distribuição de dividendos e do pagamento de juros sobre o capital próprio;
- X. eleição e destituição, a qualquer tempo, dos membros do Conselho de Administração;
- XI. eleição e destituição, a qualquer tempo, dos membros do Conselho Fiscal e respectivos suplentes;
- XII. fixação da remuneração dos administradores, dos membros do Conselho Fiscal e dos membros do Comitê de Auditoria, se não compartilhados com a controladora e dos membros do Comitê de Risco e de Capital, que não forem membros do Conselho de Administração;
- XIII. autorização para ajuizamento de ação de responsabilidade civil contra os administradores pelos prejuízos causados ao patrimônio da CAIXA DTVM;
- XIV. quaisquer outros assuntos que forem propostos pelos Conselhos de Administração e/ou Fiscal, nos termos da legislação em vigor.

ADMINISTRAÇÃO E ORGANIZAÇÃO

ÓRGÃOS DE ADMINISTRAÇÃO

Art. 12 A CAIXA DTVM terá Assembleia Geral e os seguintes Órgãos de Administração:

- I. Conselho de Administração;
- II. Diretoria Colegiada.

Art. 13 A Sociedade será administrada por um Conselho de Administração, como órgão de orientação superior, deliberativo, fiscalizador e estratégico das atividades da companhia, e por uma Diretoria Colegiada, órgão executivo, de administração, e representação, com os poderes conferidos pela lei e de acordo com o presente Estatuto Social.

Art. 14 As reuniões dos órgãos da administração serão realizadas presencialmente ou por meio eletrônico, admitindo-se ainda a participação de membro por áudio ou videoconferência.

Parágrafo único. A pauta de reunião e a respectiva documentação serão distribuídas com antecedência mínima de 2 (dois) dias úteis, salvo quando nas hipóteses devidamente justificadas pela Companhia e acatadas pelos respectivos colegiados.

CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

Art. 15 O Conselho de Administração é o órgão de decisão colegiada e de orientação geral dos negócios da CAIXA DTVM, responsável por definir diretrizes, objetivos, por monitorar e avaliar os resultados da CAIXA DTVM.

COMPOSIÇÃO

Art. 16 O Conselho de Administração será composto por 07 (sete) membros, todos eleitos pela Assembleia Geral e por ela destituíveis a qualquer tempo, devendo atender aos requisitos estabelecidos no art. 54º e seguintes deste Estatuto Social, sendo:

- I. 1 (um) membro indicado pelo Ministério da Gestão e da Inovação em Serviços Públicos;
- II. 1 (um) membro indicado pelo Ministério da Fazenda;
- III. 3 (três) membros indicados pela CAIXA; e
- IV. 2 (dois) membros indicados pela CAIXA, com atributo de Conselheiro Independente nos termos do art. 22, § 1º da Lei 13.303/2016.

Parágrafo único - O presidente e o vice-presidente do Conselho de Administração serão eleitos dentre os membros indicados pela CAIXA.

GESTÃO

Art. 17 O Conselho de Administração terá prazo de gestão unificado de 2 (dois) anos, permitidas, no máximo, 3 (três) reconduções consecutivas.

§1º Na contagem do limite do prazo de mandato unificado e reconduções a que se refere o caput, serão considerados os períodos anteriores de gestão ocorridos há menos de dois anos no mesmo cargo na CAIXA DTVM, se houver.

§2º Atingido o limite a que se refere o caput, o retorno de membro do Conselho de Administração para a companhia só poderá ocorrer decorridos, no mínimo dois anos do término do seu último mandato.

Art. 18 Finda a gestão, os membros do Conselho de Administração permanecerão em exercício até a posse dos novos Conselheiros.

FUNCIONAMENTO

Art. 19 O Conselho de Administração se reunirá, ordinariamente, uma vez por mês, ou extraordinariamente sempre que os interesses sociais assim o exigirem, ou quando convocado por qualquer de seus membros, instalando-se a reunião com a presença da maioria de seus membros.

Art. 20 Caberá ao Presidente do Conselho convocar, instalar e presidir as reuniões do Conselho de Administração, mandando lavrar as respectivas atas em livro próprio.

Art. 21 No caso de ausência ou impedimento temporário, o Presidente do Conselho será substituído por Conselheiro por ele designado, vedado que o substituto seja o Diretor-Presidente da CAIXA DTVM, ainda que temporariamente.

Art. 22 O Conselho de Administração deliberará por maioria absoluta de votos, cabendo ao Presidente do Conselho o voto de qualidade, além do voto ordinário.

Parágrafo único. No caso de ausências ou impedimentos eventuais de qualquer membro do Conselho, o colegiado deliberará com os remanescentes, visto que a função de Conselheiro de Administração é pessoal e não admite substituto temporário ou suplente.

Art. 23 Na ausência de qualquer membro do Conselho de Administração em duas reuniões seguidas ou três reuniões alternadas, sem motivo justificado, o cargo será considerado vago.

Parágrafo único. Caberá ao Presidente do Conselho no caso de vacância da função de Conselheiro de Administração, dar conhecimento à Assembleia Geral para que realize a eleição do novo membro do Conselho de Administração.

COMPETÊNCIA

Art. 24 Compete ao Conselho de Administração dentre outras atribuições previstas na Lei nº 6.404/76, na Lei nº 13.303/16, Decreto nº 8.945/2016, nas demais normas aplicáveis e no Regimento Interno:

- I. convocar as assembleias gerais;

- II. aprovar as políticas gerais da CAIXA DTVM, dentre as quais, conformidade, gerenciamento de riscos, dividendos, participações societárias, transações com partes relacionadas e governança corporativa;
- III. fiscalizar a gestão dos diretores, examinar, a qualquer tempo, os livros e papéis da companhia, solicitar informações sobre contratos celebrados, ou em via de celebração, e quaisquer outros atos;
- IV. manifestar-se sobre o relatório da administração e as contas da diretoria;
- V. aprovar e fiscalizar o cumprimento das metas e resultados específicos a serem alcançados pelos membros da Diretoria Colegiada;
- VI. eleger e destituir os Diretores Executivos da CAIXA DTVM, fixando-lhes atribuições;
- VII. aprovar o Regulamento de Pessoal, os planos de cargos, carreiras e salários da Companhia, e o quantitativo de pessoal próprio, observada a competência da Secretaria de Coordenação e Governança das Empresas Estatais (SEST), nos termos da legislação vigente;
- VIII. manifestar-se sobre as propostas de orçamento de capital, de destinação de resultados e de pagamentos de juros sobre o capital próprio, inclusive sobre plano e pagamento de participação dos empregados nos lucros e resultados, a serem submetidos à deliberação da Assembleia Geral;
- IX. autorizar a contratação de auditores independentes, bem como a rescisão dos respectivos contratos;
- X. aprovar seu Regimento Interno e do Comitê de Auditoria, quando este não for compartilhado com a controladora
- XI. criar comitês de assessoramento ao Conselho de Administração, para aprofundamento dos estudos de assuntos estratégicos, de forma a garantir que a decisão a ser tomada pelo Colegiado seja tecnicamente bem fundamentada;
- XII. aprovar a política de participações societárias elaborada pela Diretoria, que contenham prática de governança e controle, e riscos do negócio;
- XIII. definir os assuntos e valores para sua alçada decisória e da Diretoria Colegiada;
- XIV. analisar, ao menos trimestralmente, o balancete e demais demonstrações financeiras elaboradas periodicamente pela companhia, sem prejuízo da atuação do Conselho Fiscal;

- XV. manifestar-se sobre as propostas a serem submetidas à deliberação dos acionistas em Assembleia Geral;
- XVI. aprovar o plano de negócios para o exercício anual seguinte apresentado pela Diretoria;
- XVII. aprovar e acompanhar o plano estratégico, de investimentos, o plano de negócios para o exercício seguinte e as metas de desempenho apresentados pela Diretoria;
- XVIII. aprovar a estratégia de longo prazo atualizada com análise de riscos e oportunidades para, no mínimo, os próximos 5 (cinco) anos;
- XIX. aprovar o orçamento anual, o orçamento plurianual que deverão ser apresentados pela Diretoria;
- XX. aprovar o plano de dispêndios globais (“PDG”), e o orçamento anual de investimentos (“OAI”), que deverão ser apresentados pela Diretoria;
- XXI. aprovar o Plano Anual de Atividades de Auditoria Interna – Paint e o Relatório Anual das Atividades de Auditoria Interna – Raint, sem a presença do Diretor-Presidente da CAIXA DTVM;
- XXII. avaliar formalmente, ao término de cada ano, seu próprio desempenho e o desempenho da Diretoria;
- XXIII. subscrição da Carta Anual com explicitação dos compromissos de consecução de objetivos de políticas públicas e governança corporativa;
- XXIV. deliberar sobre os casos omissos do Estatuto social da Companhia, em conformidade com o disposto na Lei nº 6.404/76 e sobre os demais assuntos previstos na legislação aplicável.
- XXV. Conceder afastamento e licença remunerada do Diretor -Presidente.

DIRETORIA COLEGIADA

Art. 25 A Diretoria é o órgão executivo de administração e representação da companhia, cabendo-lhe assegurar o funcionamento regular da companhia em conformidade com a orientação geral traçada pelo Conselho de Administração.

Parágrafo único. Os membros da Diretoria terão avaliação de desempenho, individual e coletiva, de periodicidade anual realizada pelo Conselho de Administração.

COMPOSIÇÃO

Art. 26 A Diretoria é composta pelo Diretor-Presidente e 3(três) Diretores Executivos.

§1º Os membros da Diretoria serão eleitos e destituídos a qualquer tempo pelo Conselho de Administração.

§2º É condição para investidura em cargo de Diretoria da Companhia a assunção de compromisso com metas e resultados que serão aprovados pelo Conselho de Administração.

§3º A investidura no cargo depende do atendimento dos requisitos estabelecidos no art. 52º e desde que não se enquadrem nas vedações impostas por este Estatuto Social.

§4º A Companhia será representada, em juízo ou fora dele, por 2 (dois) Diretores, e nos termos do Regimento Interno da Diretoria, de maneira isolada, por apenas 1 (um) Diretor.

GESTÃO

Art. 27 O prazo de gestão da Diretoria será unificado e de 2 (dois) anos, sendo permitidas, no máximo, 3 (três) reconduções consecutivas.

§1º Atingido o limite a que se refere o caput, o retorno de membro da diretoria só poderá ocorrer após decorridos 2 (dois) anos do término do seu último mandato.

§2º O prazo de gestão dos membros da Diretoria se prorrogará até a efetiva investidura dos novos membros.

FUNCIONAMENTO

Art. 28 A Diretoria Colegiada se reunirá, ordinariamente, uma vez por semana, ou extraordinariamente sempre que os interesses sociais assim o exigirem, ou quando convocado por qualquer de seus membros.

Parágrafo único - A reunião somente será instalada com a presença da maioria de seus membros em exercício.

Art. 29 Caberá ao Diretor-Presidente convocar, instalar e presidir as reuniões da Diretoria Colegiada, mandando lavrar as respectivas atas em livro próprio.

Art. 30 A Diretoria Colegiada deliberará por maioria absoluta de votos, cabendo ao Diretor-Presidente o voto ordinário e no caso de empate, o voto de qualidade.

Parágrafo único. No caso de ausências ou impedimentos eventuais de qualquer membro da Diretoria Colegiada, o colegiado deliberará com os remanescentes, observado o quórum de instalação da reunião.

Art. 31 Serão de responsabilidade da Diretoria a administração geral, o estabelecimento da orientação superior de negócios e serviços referentes a Administração de Carteira de Valores Mobiliários conforme CVM e a gestão Colegiada da CAIXA DTVM, incluindo o estabelecimento de metas e resultados, sempre com observância às políticas, estratégias e objetivos definidos pelo Conselho de Administração.

LICENÇA, VACÂNCIA E SUBSTITUIÇÃO EVENTUAL

Art. 32 Em caso de vacância do Diretor-Presidente da Companhia, o Conselho de Administração designará o seu substituto dentre um dos Diretores Executivos, até a posse do novo escolhido.

§1º Em caso de ausências ou impedimentos eventuais, o Diretor-Presidente designará o seu substituto dentre um dos membros da Diretoria.

§2º O substituto do Diretor-Presidente não o substitui no Conselho de Administração nos termos do art. 21º deste Estatuto.

Art. 33 Em caso de vacância, ausências ou impedimentos eventuais de um dos Diretores Executivos, o Diretor-Presidente designará o substituto dentre um dos empregados subalternos da respectiva Diretoria, e se for o caso de vacância até a posse do novo escolhido, devido aos impedimentos previstos na Resolução CVM 21.

Parágrafo Único. Os empregados que substituem os Diretores devem atender a todos os requisitos e não incidir nos impedimentos e vedações aplicáveis aos administradores, nos termos da lei e deste Estatuto, sujeito à análise do Comitê de Pessoas, Elegibilidade, Sucessão e Remuneração.

Art. 34 É assegurado ao Diretor-Presidente e aos Diretores Executivos da CAIXA DTVM o gozo de 30 dias de licença remunerada que podem ser acumuladas até o máximo de (2) dois períodos, sendo vedada sua conversão em espécie e indenização.

§1º O Diretor-Presidente autorizará a licença dos diretores.

§2º É vedada a concessão de licença remunerada no mesmo período de dois ou mais diretores.

COMPETÊNCIA

Art. 35 Compete à Diretoria Colegiada, no uso das suas atribuições e respeitadas as diretrizes fixadas pelo Conselho de Administração:

- I. gerir as atividades da CAIXA DTVM e avaliar os seus resultados;
- II. monitorar a sustentabilidade dos negócios, os riscos estratégicos e respectivas medidas de mitigação, elaborando relatórios gerenciais com indicadores de gestão;
- III. elaborar os orçamentos anuais e plurianuais da CAIXA DTVM, submetê-los à aprovação do CA e acompanhar sua execução;
- IV. definir a estrutura organizacional da CAIXA DTVM e a distribuição interna das atividades administrativas;
- V. aprovar as normas internas de funcionamento da CAIXA DTVM;
- VI. promover a elaboração, em cada exercício, do relatório da administração e das demonstrações financeiras, submetendo essas últimas à Auditoria Independente e aos Conselhos de Administração e Fiscal e ao Comitê de Auditoria;
- VII. autorizar previamente os atos e contratos relativos à sua alçada decisória;
- VIII. indicar os representantes da CAIXA DTVM nos órgãos estatutários de suas participações societárias;
- IX. submeter, instruir e preparar adequadamente os assuntos que dependam de deliberação do Conselho de Administração, manifestando-se previamente quando não houver conflito de interesse;
- X. cumprir e fazer cumprir este Estatuto, as deliberações da Assembleia Geral e do Conselho de Administração, bem como avaliar as recomendações do Conselho Fiscal;
- XI. colocar à disposição dos outros órgãos societários pessoal qualificado para secretariá-los e prestar o apoio técnico necessário;
- XII. aprovar o seu Regimento Interno;
- XIII. deliberar sobre os assuntos que lhe submeta qualquer Diretor;

XIV. apresentar, até a última reunião ordinária do Conselho de Administração do ano anterior, plano de negócios para o exercício anual seguinte e estratégia de longo prazo atualizada com análise de riscos e oportunidades para, no mínimo, os próximos cinco anos;

XV. propor a constituição de subsidiárias e a aquisição de participações acionárias minoritárias para cumprir o objeto social da CAIXA DTVM (quando houver autorização legal); e

XVI. elaborar política de participações societárias que contenham prática de governança e controle, e riscos dos negócios, submetendo-a ao Conselho de Administração.

DIRETOR-PRESIDENTE

Art. 36 Sem prejuízo das demais atribuições da Diretoria, compete especificamente ao Diretor-Presidente da CAIXA DTVM:

I. dirigir, supervisionar, coordenar e controlar as atividades e a política administrativa da CAIXA DTVM;

II. coordenar as atividades dos membros da Diretoria Colegiada;

III. representar a companhia em juízo e fora dele, podendo, para tanto, constituir procuradores “ad- negotia” e “ad-judicia”, especificando os atos que poderão praticar nos respectivos instrumentos do mandato;

IV. assinar, com um Diretor, os atos que constituam ou alterem direitos ou obrigações da companhia, bem como aqueles que exonerem terceiros de obrigações para com ela, podendo, para tanto, delegar atribuições ou constituir procurador para esse fim;

V. expedir atos de admissão, designação, promoção, transferência e dispensa de empregados, podendo, para tanto, delegar atribuições ou constituir procurador para esse fim;

VI. baixar as resoluções da Diretoria Colegiada;

VII. criar e homologar os processos de licitação, podendo delegar tais atribuições;

VIII. conceder afastamento e licenças aos demais membros da Diretoria Colegiada, inclusive a título de licença remunerada;

IX. designar os substitutos dos membros da Diretoria Colegiada;

X. convocar e presidir as reuniões da Diretoria Colegiada;

- XI. manter os Conselho de Administração e Fiscal informados das atividades da companhia e
- XII. exercer outras atribuições que lhe forem fixadas pelo Conselho de Administração.

DIRETORES EXECUTIVOS

Art. 37 São atribuições dos Diretores Executivos da CAIXA DTVM:

- I. gerir as atividades da sua área de atuação;
- II. participar das reuniões da Diretoria Colegiada, concorrendo para a definição das políticas a serem seguidas pela sociedade e relatando os assuntos da sua respectiva área de atuação;
- III. cumprir e fazer cumprir a orientação geral dos negócios da sociedade estabelecida pelo Conselho de Administração na gestão de sua área específica de atuação.

Parágrafo Único. As atribuições e poderes de cada Diretor Executivo serão detalhados no Regimento Interno da Diretoria Colegiada.

SEGREGAÇÃO DE RESPONSABILIDADES

Art. 38 As competências dos Diretores da CAIXA DTVM respeitarão a segregação de responsabilidades trazidas no arcabouço legal.

Parágrafo Único. Os dirigentes podem acumular outras responsabilidades, perante Banco Central do Brasil e Comissão de Valores Mobiliários, observado o que dispõe os atos normativos que regulam os temas.

ÓRGÃOS AUXILIARES DA ADMINISTRAÇÃO

Art. 39 A CAIXA DTVM compartilhará custos, estruturas, políticas e mecanismos de divulgação com a CAIXA para execução dos serviços necessários ao exercício de suas atividades operacionais e ao cumprimento da Lei nº 13.303/16 e seu respectivo Decreto regulamentador, observadas as normas sobre segregação da administração e gestão de recursos de terceiros.

CONSELHO FISCAL

Art. 40 O Conselho Fiscal funcionará em caráter permanente e será constituído por 03 (três) membros efetivos e respectivos suplentes, eleitos pela Assembleia Geral.

§ 1º O Conselho Fiscal se reunirá, pelo menos, uma vez a cada três meses quando não convocado extraordinariamente.

§ 2º Um dos membros do Conselho Fiscal será indicado pelo Ministério da Fazenda nos termos do Art. 40, §2º, do Decreto nº 8.945/2016.

DOS REQUISITOS

Art. 41 Além das condições previstas neste Estatuto, quando aplicáveis, os conselheiros fiscais sujeitam-se, inclusive quanto aos seus poderes, deveres e responsabilidades, requisitos e impedimentos para a investidura e remuneração, às disposições contidas na Lei 6.404/76, Lei nº 13.303/2016 e seu respectivo Decreto regulamentador, demais normas e regulamentos aplicáveis e no seu Regimento Interno.

DO MANDATO

Art. 42 O prazo de gestão dos membros do Conselho Fiscal não será superior a 2 (dois) anos, permitidas 2 (duas) reconduções consecutivas.

§1º Os conselheiros fiscais terão prazos de mandato até a Assembleia Geral Ordinária do exercício subsequente à sua eleição, podendo ser destituídos a qualquer tempo.

§2º O cargo será considerado vago quando o conselheiro deixar de comparecer, sem justificativa por escrito a 2 (duas) reuniões consecutivas ou 3 (três) alternadas, nas últimas 12 (doze) reuniões.

§3º Na hipótese de vacância, renúncia, impedimento ou destituição do membro titular, o Presidente do Conselho convocará o respectivo suplente até a eleição do novo titular.

§4º O suplente eleito para preencher cargo vago completará o mandato do substituído.

§5º Os membros do Conselho Fiscal serão investidos em seus cargos mediante assinatura do termo de posse, desde a respectiva eleição.

COMPETÊNCIA

Art. 43 Compete ao Conselho Fiscal, além do definido em lei e de seu regimento interno:

I. fiscalizar, por qualquer de seus membros, os atos dos administradores e verificar o cumprimento de seus deveres legais e estatutários;

- II. examinar sobre o relatório anual da administração e as demonstrações financeiras do exercício social, fazendo constar do seu parecer as informações complementares que julgar necessárias ou úteis à deliberação do Conselho de Administração;
- III. opinar sobre as propostas dos órgãos da administração, a serem submetidas à Assembleia Geral, relativas a:
 - a) orçamento da CAIXA DTVM;
 - b) modificação do capital social;
 - c) destinação do resultado líquido;
 - d) planos de investimento ou orçamentos de capital;
 - e) constituição de fundos, reservas e provisões;
 - f) absorção de eventuais prejuízos com as reservas de lucros;
 - g) pagamento de dividendos e juros sobre capital próprio;
 - h) transformação, incorporação, fusão ou cisão;
- IV. denunciar, por qualquer de seus membros, aos órgãos de administração e, se estes não tomarem as providências necessárias para a proteção dos interesses da CAIXA DTVM, à Assembleia Geral, os erros, fraudes ou crimes que descobrirem, e sugerir providências;
- V. analisar, ao menos trimestralmente, o balancete e demais demonstrações financeiras elaboradas periodicamente pela CAIXA DTVM;
- VI. convocar a Assembleia Geral Ordinária se os órgãos da administração retardarem por mais de um mês essa convocação, e a Extraordinária, sempre que ocorrerem motivos graves ou urgentes;
- VII. exercer essas atribuições durante a eventual liquidação da companhia;
- VIII. examinar o Relatório Anual das Atividades de Auditoria Interna – RAINTE e Plano Anual de Atividades de Auditoria Interna – PAINT;
- IX. aprovar seu Regimento Interno e seu plano de trabalho anual;
- X. realizar a autoavaliação anual de seu desempenho;
- XI. acompanhar a execução patrimonial, financeira e orçamentária, podendo examinar livros, quaisquer outros documentos e requisitar informações;

XII. assistir às reuniões do Conselho de Administração, ou da Diretoria, em que se deliberar sobre os assuntos que ensejam parecer do Conselho Fiscal.

§1º O Conselho Fiscal, a pedido de qualquer dos seus membros, solicitará aos órgãos de administração e à auditoria independente esclarecimentos ou informações necessárias ao exercício de sua função fiscalizadora.

§2º As atribuições e poderes conferidos pela lei ao Conselho Fiscal não podem ser outorgados a outro órgão da Companhia.

COMITÊ DE AUDITORIA

Art. 44 O Comitê de Auditoria é o órgão de suporte ao Conselho de Administração no que se refere ao exercício de suas funções de auditoria e de fiscalização sobre a qualidade das demonstrações contábeis e efetividade dos sistemas de controle interno e de auditorias interna e independente, obedecendo às disposições do art. 38 do Decreto nº 8.945/2016 e ao previsto em seu Regimento Interno.

Parágrafo único. Adotar-se-á o Regime de Comitê de Auditoria único, no qual a Companhia utiliza o Comitê de Auditoria da CAIXA, mediante convênio de compartilhamento de atividades e de infraestrutura operacional com a CAIXA.

COMITÊ DE ELEGIBILIDADE

Art. 45 A companhia disporá de Comitê de Elegibilidade que visará auxiliar os acionistas na verificação da conformidade do processo de indicação e de avaliação dos administradores e conselheiros fiscais, obedecendo às disposições legais e ao previsto em seu Regimento Interno.

Parágrafo único. Adotar-se-á o Regime de Comitê de Elegibilidade único, no qual a Companhia utiliza o Comitê de Elegibilidade da CAIXA, mediante convênio de compartilhamento de atividades e de infraestrutura operacional com a CAIXA.

COMITÊ DE INDICAÇÃO E REMUNERAÇÃO

Art. 46 A companhia disporá de Comitê de Indicação e Remuneração, que é um órgão de caráter deliberativo e de assessoramento ao Conselho de Administração, com a finalidade de elaborar, propor e supervisionar a implementação e operacionalização da política de remuneração dos administradores da CAIXA DTVM, obedecendo às disposições legais e ao previsto em seu Regimento Interno.

Parágrafo único. Adotar-se-á o Regime de Comitê de Remuneração único, no qual a Companhia utiliza o Comitê de Remuneração da CAIXA, mediante convênio de compartilhamento de atividades e de infraestrutura operacional com a CAIXA.

COMITÊ DE RISCOS E DE CAPITAL

Art. 47 A companhia disporá de Comitê de Gestão de Riscos e de Capital, que é um órgão de caráter deliberativo e de assessoramento ao Conselho de Administração, obedecendo às disposições legais e ao previsto em seu Regimento Interno.

§1º Comitê de Risco e Capital será composto por três membros, sendo no mínimo um dos seus membros escolhido dentre os Conselheiros da Administração da CAIXA DTVM, desde que obedecidos os critérios de elegibilidade do §6º do art. 47;

§2º A critério do Conselho de Administração, poderão ser escolhidos 2 (dois) membros externos, obedecidos requisitos de elegibilidade do §6º do art. 47;

§ 3º Os membros do Comitê serão eleitos e destituídos pelo Conselho de Administração, obedecendo, além da legislação aplicável e do Estatuto Social da CAIXA DTVM;

§4º O Presidente do Comitê de Risco e Capital será escolhido pelo Conselho de Administração não podendo ter sido nos últimos seis meses, presidente do Conselho de Administração ou de qualquer outro comitê da Caixa DTVM;

§ 5º O prazo de gestão dos membros do Comitê de Risco e de Capital não será superior a 2 (dois) anos, permitidas 2 (duas) reconduções consecutivas.

§ 6º O comitê de riscos deve ser composto por integrantes que:

I - não sejam e não tenham sido empregados da instituição nos últimos seis meses;

II - não sejam cônjuges, ou parentes em linha reta, em linha colateral ou por afinidade, até o segundo grau, das pessoas referidas no inciso I;

III - não recebam da instituição outro tipo de remuneração que não decorra do exercício da função de integrante do comitê de riscos ou do conselho de administração;

IV - possuam comprovada experiência em gerenciamento de riscos;

V - não detenham o controle da instituição e não participem das decisões em nível executivo.

AUDITORIA INTERNA

Art. 48 A Auditoria Interna é vinculada ao Conselho de Administração e será executada pela Auditoria da Controladora, mediante convênio de compartilhamento de atividades e de infraestrutura operacional com a CAIXA.

GESTÃO DE RISCOS E CONFORMIDADE

Art. 49 As áreas de Conformidade e Gerenciamento de Riscos se vinculam diretamente ao Diretor-Presidente, podendo ser conduzidas por ele próprio ou por outro diretor estatutário.

Parágrafo único. A área de conformidade poderá se reportar diretamente ao Conselho de Administração, ou ao Conselho de Administração da Controladora, em situações em que se suspeite do envolvimento do Diretor-Presidente em irregularidades ou quando este se furtar à obrigação de adotar medidas necessárias em relação à situação a ele relatada.

Art. 50 Compete às áreas de Conformidade e Gerenciamento de Riscos:

- I. propor políticas de Conformidade e Gerenciamento de Riscos para a companhia, as quais deverão ser periodicamente revisadas e aprovadas pelo Conselho de Administração, e comunicá-las a todo o corpo funcional da organização;
- II. verificar a aderência da estrutura organizacional e dos processos, produtos e serviços da companhia às leis, normativos, políticas e diretrizes internas e demais regulamentos aplicáveis;
- III. comunicar à Diretoria Colegiada, aos Conselhos de Administração e Fiscal e ao Comitê de Auditoria a ocorrência de ato ou conduta em desacordo com as normas aplicáveis à companhia;
- IV. verificar a aplicação adequada do princípio da segregação de funções, de forma que seja evitada a ocorrência de conflitos de interesse e fraudes;
- V. verificar o cumprimento do Código de Conduta e Integridade, conforme art. 18 do Decreto nº 8.945/2016, bem como promover treinamentos periódicos aos empregados e dirigentes da companhia sobre o tema;
- VI. coordenar os processos de identificação, classificação e avaliação dos riscos a que está sujeita a companhia;

- VII. coordenar a elaboração e monitorar os planos de ação para mitigação dos riscos identificados, verificando continuamente a adequação e a eficácia da gestão de riscos;
- VIII. estabelecer planos de contingência para os principais processos de trabalho da organização;
- IX. elaborar relatórios periódicos de suas atividades, submetendo-os à Diretoria-Colegiada, aos Conselhos de Administração e Fiscal e ao Comitê de Auditoria;
- X. disseminar a importância da Conformidade e do Gerenciamento de Riscos, bem como a responsabilidade de cada área da companhia nestes aspectos;
- XI. outras atividades correlatas definidas pelo Diretor ao qual se vincula.

OUVIDORIA

Art. 51A CAIXA DTVM utilizará a Ouvidoria da estrutura organizacional da Controladora mediante convênio de compartilhamento de atividades e de infraestrutura operacional com a CAIXA.

REQUISITOS E VEDAÇÕES

ADMINISTRADORES DA COMPANHIA

Art. 52 Sem prejuízo do disposto neste Estatuto, os administradores da Companhia serão submetidos às normas previstas na Lei nº 13.303, de 30 de junho de 2016, na Lei nº 6.404, de 15 de dezembro 1976, na Lei nº 12.813, de 16 de maio de 2013, e no Decreto nº 8.945, de 27 de dezembro de 2016.

Parágrafo único. Os administradores deverão atender os seguintes requisitos obrigatórios:

- I. ser brasileiro, residente e domiciliado no país;
- II. ser cidadão de reputação ilibada e dotado de idoneidade moral;
- III. ter notório conhecimento compatível com o cargo para o qual foi indicado;
- IV. ter formação acadêmica compatível com o cargo para o qual foi indicado.

Art. 53 Os Diretores ao entrarem ou se desligarem do cargo deverão apresentar a declaração anual de bens à Comissão de Ética Pública da Presidência da República - CEP/PR e à companhia, ficando também à disposição do Banco Central do Brasil.

Art. 54 Para o exercício do cargo de Diretor além dos requisitos previstos no caput, deverão comprovar ainda que tenham exercido nos últimos dez anos:

- a) cargos gerenciais em instituições integrantes do Sistema Financeiro Nacional, por no mínimo dois anos; ou
- b) cargos gerenciais na área financeira em outras entidades detentoras de patrimônio líquido não inferior a um quarto dos limites mínimos de capital realizado e patrimônio líquido da CAIXA, por no mínimo quatro anos; ou
- c) cargos relevantes em órgãos ou entidades da administração pública, por no mínimo dois anos.

VEDAÇÕES

Art. 55 Não poderão ser eleitos ou permanecer nos órgãos estatutários, além dos impedidos por lei e demais normas aplicáveis:

- I. os que estiverem impedidos de exercer cargos em distribuidoras de títulos e valores mobiliários, por ato da CVM ou do BACEN;
- II. os declarados inabilitados para cargos de administração em instituições autorizadas a funcionar pela SUSEP, pela CVM, pelo BACEN ou em outras instituições sujeitas a autorização, controle e fiscalização de órgãos e entidades da Administração Pública, direta e indireta, incluídas as entidades de previdência privada, as sociedades seguradoras, as sociedades de capitalização e as Companhias abertas;
- III. os que estiverem respondendo pessoalmente, ou como controlador ou administrador de pessoa jurídica, por pendências relativas a protesto de títulos, cobranças judiciais, emissão de cheques sem fundos, inadimplemento de obrigações e outras ocorrências ou circunstâncias análogas;
- IV. os declarados falidos ou insolventes;
- V. os que detiverem o controle ou participarem da administração de pessoa jurídica em recuperação judicial, falida ou insolvente, no período de cinco anos anteriores à data da eleição ou nomeação, salvo na condição de síndico, comissário, ou administrador judicial;
- VI. sócio, ascendente, descendente, parente colateral ou afim, até o terceiro grau, cônjuge ou sócio de membro dos órgãos de administração, do Conselho Fiscal e do Comitê de Auditoria;

VII. os que estiverem inadimplentes com a Companhia, suas subsidiárias ou com a sua controladora e/ou pessoa político-administrativa a que se vincula, ou que lhes tenham causado prejuízo ainda não ressarcido;

VIII. os que detenham controle ou participação relevante no capital social da pessoa jurídica inadimplente com as sociedades citadas no inciso anterior ou que lhes tenham causado prejuízo ainda não ressarcido, estendendo-se esse impedimento aos que tenham ocupado cargo de administração em pessoa jurídica nessa situação, no exercício social imediatamente anterior à data da eleição ou nomeação;

IX. os condenados, por decisão transitada em julgado, por crime falimentar, de sonegação fiscal, de prevaricação, de corrupção ativa ou passiva, de concussão, de peculato, contra a economia popular, contra a fé pública, contra a propriedade, contra o Sistema Financeiro Nacional e os condenados à pena criminal que vede, ainda que temporariamente, o acesso a cargos públicos;

X. os que ocupem cargos em sociedades que possam ser consideradas concorrentes no mercado, em especial em Conselhos Consultivos, de Administração ou Fiscal, salvo os casos de dispensa justificada e aprovada pelo Conselho de Administração;

Art. 56 Os requisitos e vedações exigíveis para os administradores deverão ser respeitados por todas as nomeações e eleições realizadas, inclusive em caso de recondução.

§1º Os requisitos deverão ser comprovados documentalmente, na forma exigida pelo formulário padronizado, aprovado pela Secretaria de Coordenação e Governança das Companhias Estatais e disponibilizado em sítio eletrônico.

§2º A ausência dos documentos referidos no parágrafo anterior importará em rejeição do formulário pelo Comitê de Elegibilidade.

§3º As vedações serão verificadas por meio de autodeclararção apresentada pelo indicado, nos moldes do formulário padronizado.

Art. 57 É expressamente vedado e será nulo de pleno direito o ato praticado por qualquer administrador, procurador ou funcionário da Companhia que o envolva em obrigações relativas a negócios e operações estranhos ao objeto social ou que estejam em desacordo com este Estatuto Social, sem prejuízo da responsabilidade civil ou criminal, se for o caso, a que estará sujeito o infrator deste dispositivo.

POSSE E RECONDUÇÃO

Art. 58 Os administradores serão investidos em seus cargos mediante assinatura de termo de posse no livro de atas do respectivo colegiado, no prazo máximo de até 30 dias, contados a partir da eleição.

§1º O termo de posse deverá conter, sob pena de nulidade, a indicação de pelo menos um domicílio no qual o administrador receberá citações e intimações em processos administrativos e judiciais relativos a atos de sua gestão, as quais se reputarão cumpridas mediante entrega no domicílio indicado, o qual somente poderá ser alterado mediante comunicação por escrito à companhia.

§2º Aos Conselheiros de Administração e aos Diretores é dispensada a garantia de gestão para investidura no cargo.

§3º Os membros da Administração devem exercer suas atribuições de forma a atingir os interesses da Companhia, sendo-lhes vedado, nos termos do art. 156 da Lei 6.404/76, intervir em qualquer ato ou operação social em que tiverem interesse conflitante com o da Companhia, bem como nas deliberações que a esse respeito tomarem os demais administradores, sendo que nestes casos o administrador cujo interesse conflitar com o da Companhia deverá notificar seu impedimento, consignando em ata a natureza e extensão de seu interesse.

Art. 59 Os cargos de Presidente do Conselho de Administração e de Diretor-Presidente não poderão ser acumulados pela mesma pessoa, ainda que interinamente.

PERDA DO CARGO

Art. 60 Além dos casos previstos em lei, dar-se-á vacância quando:

- I. o membro do Conselho de Administração, do Conselho Fiscal ou do Comitê de Auditoria que deixar de comparecer, sem justificativa escrita, a duas reuniões ordinárias consecutivas ou a três reuniões ordinárias intercaladas, nos últimos doze meses, salvo motivo de força maior ou caso fortuito;
- II. o membro da Diretoria Executiva se afastar do exercício do cargo por mais de 30 dias consecutivos, salvo em caso de licença, inclusive férias, ou nos casos autorizados pelo Conselho de Administração.

Parágrafo único. A perda do cargo não elide a responsabilidade civil e penal a que estejam sujeitos os membros dos órgãos de administração e os Diretores Executivos, em virtude de descumprimento de suas obrigações.

REMUNERAÇÃO

Art. 61 A remuneração global e individual, vantagens e benefícios dos membros do Conselho de Administração, do Conselho Fiscal, da Diretoria, do Comitê de Auditoria e dos demais Comitês quando não compartilhados com a Controladora, serão fixados, anualmente, pela Assembleia Geral, nos termos da legislação vigente.

§1º É vedado o pagamento de qualquer remuneração, vantagem ou benefício não estabelecido pela Assembleia Geral.

§2º A CAIXA DTVM divulgará toda e qualquer forma de remuneração dos membros do Conselho de Administração, da Diretoria e do Conselho Fiscal.

§3º Os membros dos Conselhos de Administração e Fiscal terão ressarcidas suas despesas de locomoção e estada necessárias ao desempenho da função, sempre que residentes fora da cidade em que for realizada a reunião.

§4º A remuneração mensal, quando devida aos membros dos Conselhos de Administração e Fiscal da CAIXA DTVM, não excederá a dez por cento da remuneração mensal média dos membros da Diretoria, excluídos os valores relativos, eventuais adicionais e benefícios, sendo vedado o pagamento de participação, de qualquer espécie, nos lucros da companhia.

Art. 62 Os Administradores e Conselheiros Fiscais devem participar na posse e anualmente de treinamentos específicos disponibilizados direta ou indiretamente pela companhia sobre:

- I. legislação societária e de mercado de capitais;
- II. divulgação de informações;
- III. controle interno;
- IV. código de conduta;
- V. responsabilização administrativa e civil de pessoas jurídicas pela prática de atos contra a administração pública, nacional ou estrangeira (Lei nº 12.846/2013); e
- VI. demais temas relacionados às atividades da Companhia.

Parágrafo único. É vedada a recondução dos administradores ou membros do Conselho Fiscal que não participarem de nenhum dos treinamentos anualmente disponibilizados pela companhia nos últimos dois anos.

DEFESA JUDICIAL E SEGURO DE RESPONSABILIDADE CIVIL

Art. 63 A CAIXA DTVM, na forma definida pelo Conselho de Administração, assegurará aos integrantes e ex-integrantes do Conselho de Administração, do Conselho Fiscal, da Diretoria e dos demais órgãos estatutários a defesa em processos judiciais e administrativos contra eles instaurados pela prática de atos no exercício de cargo ou função, desde que não tenha sido constatado fato que dê causa a ação de responsabilidade e que não haja incompatibilidade com os interesses da Companhia, de suas subsidiárias e participadas.

§1º O benefício previsto no caput aplica-se, no que couber e a critério do Conselho de Administração, àqueles que figuram no polo passivo de processo judicial ou administrativo, em decorrência de atos que tenham praticado no exercício de competência delegada pelos administradores.

§2º O Conselho de Administração poderá, ainda, na forma por ele definida e observado, no que couber, o disposto no caput, autorizar a contratação de seguro de responsabilidade civil em favor dos integrantes e ex- integrantes dos órgãos estatutários relacionados no caput, bem como do titular máximo não estatutário da área de gestão de riscos, controles internos e compliance, para resguardá-los de responsabilidade por atos ou fatos pelos quais eventualmente possam vir a ser demandados judicial ou administrativamente, cobrindo todo o prazo de exercício dos seus respectivos mandatos.

§3º A inclusão de outros beneficiários no seguro de responsabilidade civil de que trata o parágrafo anterior ficará a critério do Conselho de Administração.

§4º Se alguma das pessoas mencionadas no caput e nos parágrafos anteriores for condenada por decisão judicial transitada em julgado, com fundamento em violação da lei ou do Estatuto Social, deverá ressarcir a Companhia de todos os custos e despesas decorrentes da defesa de que trata o caput, além de eventuais prejuízos.

QUARENTENA PARA DIRETORIA

Art. 64 Os membros da Diretoria Colegiada ficam impedidos do exercício de atividades que configurem conflito de interesse, observados a forma e o prazo estabelecidos na legislação pertinente e as regras da controladora.

§1º Após o exercício da gestão, o ex-membro da Diretoria Colegiada, que estiver em situação de impedimento, poderá receber remuneração compensatória equivalente apenas ao honorário mensal da função que ocupava observados os §§ 2º e 3º deste artigo.

§2º Não terá direito à remuneração compensatória, o ex-membro da Diretoria Colegiada que retornar, antes do término do período de impedimento, ao desempenho da função que ocupava na administração pública ou privada anteriormente à sua investidura, desde que, não caracterize conflito de interesses.

§3º A configuração da situação de impedimento dependerá de prévia manifestação da Comissão de Ética Pública da Presidência da República.

CÓDIGO DE CONDUTA E INTEGRIDADE

Art. 65 Deverá ser elaborado e divulgado Código de Conduta e Integridade, que disponha sobre:

- I. princípios, valores e missão da Companhia, bem como orientações sobre a prevenção de conflito de interesses e vedação de atos de corrupção e fraude;
- II. instâncias internas responsáveis pela atualização e aplicação do Código de Conduta e Integridade;
- III. canal de denúncias que possibilite o recebimento de denúncias internas e externas relativas ao descumprimento do Código de Conduta e Integridade e das demais normas internas de ética e normas obrigacionais;
- IV. mecanismos de proteção que impeçam qualquer espécie de retaliação a pessoa que utilize o canal de denúncias;
- V. sanções aplicáveis em caso de violação às regras do Código de Conduta e Integridade;
- VI. previsão de treinamento periódico, no mínimo anual, sobre Código de Conduta e Integridade, a empregados, administradores e conselheiros fiscais, e sobre a política de gestão de riscos, a administradores.

EMPREGADOS

Art. 66 O quadro de pessoal da CAIXA DTVM será composto exclusivamente por empregados disponibilizados pela Caixa Econômica Federal, mediante ressarcimento integral de custos conforme convênio de compartilhamento.

§1º Os empregados da CAIXA disponibilizados para a CAIXA DTVM não poderão exercer nenhuma outra atividade remunerada na CAIXA.

§2º A estrutura de funções gratificadas deverá respeitar a correlação de atribuições e de remuneração vigente na CAIXA.

DISTRIBUIÇÃO DE DIVIDENDOS

Art. 67 Serão levantadas demonstrações financeiras ao final de cada trimestre.

Parágrafo único. Do lucro líquido apurado e após a absorção de eventuais prejuízos acumulados e deduzido a provisão para pagamento de imposto de renda, serão destacadas as seguintes verbas, na proporção abaixo indicada e observados os limites e condições estabelecidos em lei:

- I. 5% (cinco por cento) para constituição de Reserva Legal, até o limite de 20% do capital integralizado;
- II. demais reservas, propostas pela Diretoria e aprovadas pelo Conselho de Administração;
- III. dividendo mínimo obrigatório de vinte e cinco por cento sobre o lucro líquido ajustado como definido na lei, para destinação ao acionista único.

Art. 68 Observada a legislação vigente, o Conselho de Administração autorizará o pagamento ou o crédito, ao acionista, de juros, a título de remuneração do capital próprio, bem como imputação do seu valor ao dividendo mínimo obrigatório.

§1º Caberá ao Conselho de Administração fixar o valor e a data de pagamento ou crédito de cada parcela

dos juros, autorizado na forma do “caput” deste artigo.

§2º Os valores dos juros, a título de remuneração sobre o capital próprio, devidos ao acionista, sofrerão incidência de encargos financeiros equivalentes à taxa SELIC, a partir do encerramento do exercício social até o dia do efetivo recolhimento ou pagamento, sem prejuízo da incidência de juros moratórios quando esse recolhimento não se verificar na data fixada em

lei, assembleia ou deliberação do Conselho de Administração, devendo ser considerada como a taxa diária, para a atualização desse valor durante os cinco dias uteis anteriores à data do pagamento ou recolhimento, a mesma taxa SELIC divulgada no quinto dia útil que antecede o dia da efetiva quitação da obrigação.

DISPOSIÇÕES GERAIS

Art. 69 A participação acionária no capital social em outras sociedades, mediante subscrição ou integralização de ações, garantia de subscrição de ações ou debêntures destinadas à colocação pública ou privada, a aquisição de debêntures, partes beneficiárias e bônus de subscrição, bem como quaisquer outras operações de apoio financeiro, somente poderão ser realizadas quando observadas as normas operacionais aprovadas pelo Conselho de Administração desde que observadas simultaneamente as condições abaixo:

- I. os exames técnico e econômico-financeiro comprovarem a viabilidade e a oportunidade do negócio, tendo presente a segurança e a adequada remuneração dos capitais envolvidos; e
- II. não houver restrições à idoneidade do beneficiário e nem à de seus titulares e administradores, se pessoa jurídica.

Estatuto Social consolidado da CAIXA Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S/A – CNPJ 42.040.639/0001-40 e NIRE 35.3.0056913-0 - conforme a deliberação da Assembleia Geral Extraordinária de 07 de dezembro de 2023, arquivada na JUCESP sob protocolo 26.747/24-8, em 19 de janeiro de 2024.

DECLARAÇÃO

A CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A – **CAIXA ASSET**, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 42.040.639/0001-40, com sede na cidade de São Paulo - SP, na Avenida Paulista, nº 2.300 - 11º Andar – CEP 01310-300, registrada por meio do Ato Declaratório CVM nº 19.043, de 30 de agosto de 2021, declara para os devidos fins que:

- a) os regulamentos dos fundos de investimento cujos RPPS estejam incluídos como público-alvo, estão em conformidade com a Resolução CMN nº 3.922/2010, e alterações posteriores, ciente da obrigatoriedade de declarar eventuais ocorrências posteriores.
- b) não possui em seu quadro de empregados menores de 18 anos em trabalho noturno, perigoso ou insalubre, bem como em qualquer trabalho, menores de 16 anos, salvo na condição de aprendiz, a partir de 14 anos, consoante o inciso XXXIII, do artigo 7º da Constituição Federal e o que se estabeleceu no artigo 1º da Lei nº 9.854, de 27 de outubro de 1999.
- c) não se encontra impedida, nem suspensa, nem foi declarada inidônea para participar de licitações, ou contratar com o Poder Público. Informará, sob as penalidades cabíveis, a superveniência de fato impeditivo ou suspensivo da manutenção do Credenciamento.
- d) possui aptidão técnica para desempenhar as atividades de administração e gestão de fundos de investimentos destinados aos Regimes Próprios de Previdência Social — RPPS.
- e) possui elevado padrão ético de conduta nas operações realizadas no mercado financeiro e ausência de restrições que, a critério do Banco Central do Brasil, da Comissão de Valores Mobiliários ou de outros órgãos competentes desaconselham um relacionamento seguro.
- f) as informações contidas nos documentos apresentados para credenciamento são verdadeiras e autênticas.

São Paulo, 29 de dezembro de 2021.

GABRIEL DUTRA
CARDOZO VIEIRA DE
GOES:31056399856

Assinado de forma digital por
GABRIEL DUTRA CARDOZO VIEIRA
DE GOES:31056399856
Dados: 2021.12.30 10:13:05 -03'00'

JORGE LOUZADA
KOZLOVSKY:339089
21848

Assinado de forma digital por
JORGE LOUZADA
KOZLOVSKY:33908921848
Dados: 2021.12.29 19:03:07 -03'00'

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A – **CAIXA ASSET**
CNPJ/MF 42.040.639/0001-40

Formulário de Referência
CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

(informações prestadas com base nas posições de 31 de DEZEMBRO de 2022)

ADMINISTRADORES DE CARTEIRAS DE VALORES MOBILIÁRIOS

1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário

1.1. Declarações dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e da Resolução CVM 21, atestando que:

- a. reviram o formulário de referência**
- b. o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa**

Diretor responsável pela implementação e cumprimento das regras, políticas, procedimentos, controles internos e gestão de risco:

Nome: Gabriel Dutra Cardozo Vieira de Goes

Cargo: Diretor-Presidente da CAIXA Asset

Diretor responsável pela gestão de recursos:

Nome: Álvaro Cunha Matos Lessa de Oliveira

Cargo: Diretor Executivo, em exercício, de Gestão Fundos de Investimento da CAIXA Asset.

Os diretores acima qualificados declaram que reviram o Formulário de Referência e que o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa.

As declarações assinadas, encontram-se arquivadas nas dependências da CAIXA Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. ("CAIXA Asset").

2. Histórico da empresa¹

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

¹ A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.

A CAIXA Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários ('CAIXA Asset' ou 'Companhia'), subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL ('CAIXA' ou 'Controladora'), foi fundada em 2021, com sede na cidade de São Paulo, com o objetivo de conferir maior agilidade e eficiência à gestão de recursos de terceiros da Controladora.

A administração da Companhia é realizada por meio do Conselho de Administração, que conta com a participação de membros independentes, e da Diretoria Colegiada.

A gestão da Companhia é fiscalizada por um Conselho Fiscal constituído de forma permanente, conforme exigido pela Lei 13.303/16. A Companhia utiliza ainda, por compartilhamento, a estrutura de Auditoria Interna da Controladora no monitoramento dos negócios.

No Ranking de Gestão de Fundos de Investimento ANBIMA de dezembro de 2022, a CAIXA Asset era a 4ª maior gestora de recursos, com R\$ 481,65 bilhões em patrimônio líquido sob gestão, representando 6,50% da indústria de gestão de fundos.

Em dezembro de 2021, a Fitch Ratings atribuiu o Rating de Qualidade de Gestão de Investimentos 'Excelente' à CAIXA Asset, considerada a nota máxima atribuída pela agência.

Em julho de 2022, a Fitch Ratings afirmou o Rating de Qualidade de Gestão de Investimentos 'Excelente' da CAIXA Asset.

O rating 'Excelente' da CAIXA Asset reflete a opinião da Fitch de que a gestora tem capacidade de investimento e características operacionais muito fortes em relação às estratégias de investimento oferecidas, processo bem disciplinado de investimento, estrutura organizacional bem segmentada e robusta, equipe experiente e qualificada, sólidos recursos tecnológicos, além de sólidas estruturas de gestão de riscos.

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

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

A CAIXA Asset tem origem nas atividades de gestão de recursos de terceiros anteriormente prestados pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL ("Controladora") por meio de sua Vice-Presidência Fundos de Investimento/VIART.

A CAIXA Asset não realizou eventos societários de incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle acionário.

Em 22 de julho de 2021, o Conselho de Administração tomou conhecimento da renúncia Sr. Alexandre Xavier Ywata de Carvalho do cargo de Diretor-Presidente da companhia e designou para ocupar o cargo o Sr. Gabriel Dutra Cardozo Vieira de Goes.

Em 30 de dezembro de 2021, o Conselho de Administração elegeu o Sr. Rodrigo Luiz Sias de Azevedo para o cargo de Diretor Executivo da Diretoria Distribuição e Produto, que tomou posse em 03 de janeiro de 2022.

Em 29 de março de 2022, o Conselho de Administração destituiu o Sr. Jorge Louzada Kozlovsky do cargo de Diretor Executivo da DITER e designou o Sr. Álvaro Cunha Matos Lessa de Oliveira como Diretor Executivo em exercício, até a posse do novo titular.

Em 05 de julho de 2022, o Conselho de Administração tomou conhecimento da renúncia do Sr. Pedro Duarte Guimarães ao cargo de Membro Titular e Presidente do Conselho de Administração da Companhia.

A Sra. Fabiana Magalhães Almeida Rodopoulos foi eleita como Membro do Conselho de Administração da Companhia em Assembleia Geral Extraordinária de 30 de setembro de 2022 e tomou posse em 04 de outubro de 2022.

O Sr. Bruno Westin Prado Soares Leal foi eleito como Membro do Conselho de Administração da Companhia em Assembleia Geral Extraordinária de 21 de outubro de 2022, e tomou posse em 24 de outubro de 2022.

Em 04 de novembro de 2022, o Conselho de Administração tomou conhecimento da renúncia do Sr. Rogério Rodrigues Bimbi ao cargo de Membro Independente do Conselho de Administração da Companhia.

O Sr. Felipe Moreira Cruzeiro foi eleito como Membro do Conselho de Administração da Companhia em Assembleia Geral Extraordinária de 21 de dezembro de 2022, e tomou posse na data de sua eleição.

Em 19 de janeiro de 2023, o Conselho de Administração decidiu pela destituição do Sr. Rodrigo Luiz Sias de Azevedo do cargo de Diretor Executivo da Diretoria Distribuição e Produto, a partir de 25 de janeiro de 2023, e designou o Sr. Mario Erbolato Neto como Diretor Executivo em exercício, até a posse do novo titular.

b. escopo das atividades

Considerando o acima exposto, não houve mudanças relevantes no escopo das atividades da CAIXA Asset, que é responsável pela gestão de carteiras de fundos de investimento e carteiras administradas.

c. recursos humanos e computacionais

O quadro de pessoal da CAIXA Asset é composto por empregados disponibilizados pela Controladora, que compartilha a estrutura de cargos efetivos, funções gratificadas e cargos em comissão previstos no Plano de Cargos e Salários.

Para início de suas atividades, o quadro funcional da CAIXA Asset foi dimensionado em mais de 150 empregados².

Em busca de melhoria do Resultado Operacional, foram adotadas medidas de racionalização de despesas, aperfeiçoamento e automatização de processos.

Dentro do contexto de uma empresa do conglomerado CAIXA, vale observar que, nos últimos anos, foram investidos recursos na renovação do parque computacional das áreas da empresa, bem como no desenvolvimento e atualização de sistemas especializados para realização de suas atividades.

A CAIXA Asset está inserida nos investimentos realizados pela sua controladora no que se refere aos recursos computacionais, como acima mencionado.

d. regras, políticas, procedimentos e controles internos

Em sintonia com a evolução regulamentar do mercado financeiro nacional e internacional e, ainda, com as inovações financeiras de operações e produtos, a CAIXA Asset tem orientado as atividades da Companhia e de gestão de carteiras de valores mobiliários dentro das melhores práticas de controles internos e *compliance*.

Podem ser destacadas as ações para revisão sistemática de processos, a adoção de políticas internas, os programas de disseminação da cultura de controles internos e integridade e a tomada de decisões em colegiado como instrumentos que consolidam esse trabalho.

As regras, políticas, procedimentos e controles internos implantados são registrados no manual eletrônico de procedimentos que consolida conceitos e metodologias, traçando as linhas internas de verificação do atendimento às regras emitidas pelos órgãos de controle de supervisão.

Nesse sentido, destacamos a adoção de Metodologia de Abordagem Baseada em Risco (ABR) para classificação de eventos relacionados a LDFTP, a adoção de Matriz de Conformidade para monitoramento das atividades da CAIXA Asset, a normatização do Monitoramento do processo de adequações às normas externas e a padronização dos documentos internos da empresa através de normatização, trazendo maior nível de governança e controle das atividades da Companhia. Ressaltamos que as demais políticas e regras gerais passam por processo de revisão periódica, o que também inclui a “Política de Controles Internos e *Compliance* da CAIXA Asset”.

² Referem-se aos empregados CAIXA disponibilizados pela Controladora à Companhia para atuar única e exclusivamente nas atividades da CAIXA Asset, mediante ressarcimento integral de custos conforme convênio de compartilhamento (Estatuto Social, Art. 66 e parágrafos).

3. Recursos humanos³**3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:****a. número de sócios**

1 - A CAIXA Asset é subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL. A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL é uma empresa 100% pública, controlada pelo Governo Federal.

b. número de empregados

187 - Em 31 de dezembro de 2022.

c. número de terceirizados

A Companhia não possui funcionários terceirizados.

As atividades relacionadas a serviços de copa, vigilância, limpeza, recepção e manutenção predial são contratadas pela CAIXA, conforme previsão de convênio de compartilhamento de estrutura.

d. Indicar o setor de atuação dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e os respectivos exames de certificação realizados para fins do art. 3º, III, c/c art. 4º, III, desta Resolução

NOME	SETOR	Exames de certificação
Álvaro Cunha Matos Lessa de Oliveira	Gestão de recursos	CGA/CGE

e. Lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e que atuem exclusivamente como prepostos, empregados ou sócios da empresa, bem como seus respectivos setores de atuação

NOME	CPF	SETOR
Álvaro Cunha Matos Lessa de Oliveira	326.638.608-67	Gestão de recursos
Ricardo Troes	311.948.148-32	Risco, Governança e <i>Compliance</i>
Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré	313.898.178-06	Gestão de recursos

4. Auditores

³ 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:**a. nome empresarial**

BDO RCS AUDITORES INDEPENDENTES.

b. data de contratação dos serviços

04/01/2022

c. descrição dos serviços contratados

Prestação de serviços de auditoria das demonstrações contábeis da CAIXA Asset elaboradas de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil.

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 Resolução CVM 21⁴

Não se aplica, tendo em vista a CAIXA Asset ser uma instituição financeira e prestar os serviços de gestão de carteira de valores mobiliários.

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.)**

A CAIXA Asset presta o serviço de gestão de carteiras em fundos de investimento e carteiras administradas. O serviço de gestão discricionária é

⁴ A apresentação destas demonstrações financeiras e deste relatório é obrigatória apenas para o administrador registrado na categoria administrador fiduciário de acordo com o inciso II do § 2º do art. 1º.

estabelecido com base em diretrizes deliberadas em comitês e inclui abordagem *top-down* e setorial, com visão de longo prazo, suportada por análises da área de risco e jurídica, bem como área de pesquisa (*research*) proprietária.

O processo de investimento de ativos em FIP, FIDC, e FII segue a estrutura de governança da CAIXA Asset, levando-se em conta (i) a política de investimento, estabelecida no regulamento de cada fundo estruturado, (ii) análise de cenários econômico-financeiros, (iii) análise do mercado de atuação da companhia emissora do ativo objeto de investimento, (iv) projeções de fluxo de caixa, apresentando as premissas consideradas e demonstrativos financeiros, (v) relatório de avaliação do investimento em questão, (vi) estruturação financeira da operação, (vii) aspectos societários, fiscais, trabalhistas, ambientais, bem como quaisquer outros riscos decorrentes do investimento.

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.)

O portfólio gerido pela CAIXA Asset possui 406 veículos de investimento, entre fundos de investimento e carteiras administradas, buscando atender aos investidores pessoas físicas e pessoas jurídicas, estes últimos dos segmentos corporativo, público e institucional.

O portfólio pode ser composto por fundos de investimentos de renda fixa, de ações, multimercados, cambial, fundo de índice ETF, fundos mútuos de privatização FGTS, fundos imobiliários, de participação e de direitos creditórios.

c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Os fundos de investimento e carteiras administradas sob gestão da CAIXA Asset possuem em suas carteiras ativos financeiros tais como ações e outros ativos de renda variável, contratos de derivativos, debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras e não financeiras, direitos creditórios e cotas de fundos de investimentos, além de títulos públicos federais e imóveis, no caso de fundos imobiliários.

d. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor

A CAIXA Asset pode atuar como distribuidora de cotas de fundos de investimento considerando se tratar de integrante do sistema de distribuição de títulos de valores mobiliários.

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

a. os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades; e

A CAIXA Asset desenvolve atualmente o serviço de gestão de carteira de valores mobiliários e pode atuar na distribuição de títulos e valores mobiliários, inclusive aqueles em que é a gestora.

A CAIXA Asset pode ser a gestora de recursos de fundos de investimento ou carteiras administradas que tenham ou venham a ter investimento em título e/ou valor mobiliário emitido por empresa que integre o conglomerado CAIXA.

Nesses casos, a arquitetura organizacional e o modelo de gestão da CAIXA Asset destacam que a CAIXA Asset é uma subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA e separada das demais empresas do conglomerado.

A CAIXA Asset atua observando os deveres fiduciários previstos na legislação vigente de forma a desenvolver suas atividades visando os interesses dos cotistas, possuindo política de exercício de direito de voto própria e independente, além de estrutura colegiada internalizada que delibera sobre os processos de investimento e demais temas de governança nas atividades de gestão de recursos.

Por fim, um conjunto de políticas e códigos, tanto da CAIXA Asset quanto da sua Controladora, dispõe sobre situações de potenciais conflitos de interesse, a exemplo da Política de Controle Interno, *Compliance* e Integridade CAIXA, da Política de Relacionamento com Clientes e Usuários de Produtos e Serviços CAIXA, da Política de Transações com Partes Relacionadas da CAIXA e da CAIXA Asset, da Política de Prevenção ao Conflito de Interesses da CAIXA Asset, do Código de Ética da CAIXA, do Código de Conduta da CAIXA e do Código de Ética e de Conduta da CAIXA Asset.

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.

A CAIXA, Controladora integral da CAIXA Asset, é uma instituição financeira sob a forma de [empresa pública](#), que exerce papel fundamental no desenvolvimento urbano e da justiça social do país, vez que prioriza setores como habitação, saneamento básico e infraestrutura e atua como principal operador dos programas sociais do Governo Federal, como Seguro Desemprego e Bolsa Família, contribuindo significativamente para melhorar a vida das pessoas, principalmente as de baixa renda.

A CAIXA apoia inúmeras atividades artístico-culturais, educacionais e desportivas e oferece extensa gama de serviços bancários e financeiros: depósito e captações de recursos, poupança, cartões, crédito e financiamento habitacional, seguros, previdência privada, penhor, financiamento estudantil, capitalização, consórcio, serviços para o poder judiciário, crédito rural, conectividade social, FGTS, comércio exterior dentre outros.

Dentro da estrutura organizacional da CAIXA, a VP Fundos de Investimento (“VIART”), vice-presidência segregada do Conselho Diretor, conforme artigo 13, § 4º e artigo 28 do Estatuto Social da CAIXA, é responsável pelos serviços de administração fiduciária, inclusive para os fundos geridos pela CAIXA Asset e pela gestão de carteiras em fundos de investimento e carteiras administradas que movimentam exclusivamente recursos do FGTS. O estatuto da CAIXA prevê a existência do Conselho de Administração e Gestão de Ativos de Terceiros como órgão colegiado deliberativo, responsável pela gestão e representação da CAIXA quanto às atividades VIART.

Dessa forma, eventuais situações de conflito de interesse relacionadas às demais atividades desempenhadas pela instituição são mitigadas por meio de segregação física, tecnológica e organizacional, bem como pelas estruturas de governança que contam com comitês segregados, assegurando que a tomada de decisão ocorra de forma colegiada e independente.

Não obstante, a CAIXA Asset possui igualmente estrutura de governança apartada e órgãos estatutários próprios, como Conselho de Administração, Conselho Fiscal e Comitê de Riscos e de Capital, dedicados unicamente às atividades da Companhia, além de estrutura própria de comitês internos para gestão dos ativos de terceiros.

Por fim, a “Política de Controle Interno, *Compliance* e Integridade”, a “Política de Relacionamento com Clientes e Usuários de Produtos e Serviços CAIXA”, o “Código de Ética da CAIXA”, o “Código de Conduta da CAIXA”, além do “Código de Ética e de Conduta da CAIXA Asset” (todos documentos públicos⁵) dispõem sobre situações de potencial conflitos de interesse.

As empresas que integram o conglomerado CAIXA, conjuntamente à CAIXA Asset, estão relacionadas na alínea “e” do item 7.1.

6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos⁶ e carteiras administradas geridos pela empresa, fornecendo as seguintes informações:

a. número de investidores (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)

FUNDOS (INV QUALIFICADOS)	54.403
FUNDOS (INV NÃO QUALIFICADOS):	2.305.669
CARTEIRAS (INV QUALIFICADOS)	0
CARTEIRAS (INV NÃO QUALIFICADOS):	6
TOTAL:	2.360.078

⁵ Disponíveis em <https://www.caixa.gov.br/caixa-asset/Paginas/default.aspx>.

⁶ Se for o caso, fornecer informações apenas dos investidores dos fundos **feeders**, e não do fundo **master**.

b. número de investidores, dividido por:

TIPO DE INVESTIDOR	INV NÃO QUALIFICADOS	INV QUALIFICADOS
PESSOAS NATURAIS	1.743.538	45.157
PESSOAS JURÍDICAS (NÃO FINANCEIRAS OU INSTITUCIONAIS)	560.586	8.939
INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	0	20
ENTIDADES ABERTAS DE PREVIDÊNCIAS COMPLEMENTAR	0	5
ENTIDADES FECHADAS DE PREVIDÊNCIAS COMPLEMENTAR	0	13
REGIMES PRÓPRIOS DE PREVIDÊNCIA SOCIAL	1.551	227
SEGURADORAS	0	18
SOCIEDADES DE CAPITALIZAÇÃO E ARRENDAMENTO MERCANTIL	0	3
CLUBES DE INVESTIMENTO	0	0
FUNDOS DE INVESTIMENTO	0	20
INVESTIDORES NÃO RESIDENTES	0	1
OUTROS (INVESTIDOR QUE NÃO PF, SEM PERSONALIDADE JURÍDICA)	0	0
TOTAL	2.305.675	54.403

c. recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)

FUNDOS (INV.QUALIFICADOS)	260.963.904.182,65
FUNDOS (INV.NÃO QUALIFICADOS)	239.444.601.822,64
CARTEIRAS (INV.QUALIFICADOS)	0,00
CARTEIRAS (INV.NÃO QUALIFICADOS)	706.332.490,84
TOTAL	501.114.838.496,13

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

R\$ 54.256.388,01

e. recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)

POS	SALDO R\$
1	134.092.297.242,98

2	7.059.643.391,06
3	6.976.198.540,27
4	3.720.127.782,79
5	3.690.801.469,52
6	3.073.899.924,75
7	3.058.139.386,38
8	2.457.177.032,33
9	2.276.395.571,71
10	2.151.221.787,36

f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

TIPO DE INVESTIDOR	Total (RS)
PESSOAS NATURAIS	73.179.797.783,35
PESSOAS JURÍDICAS (NÃO FINANCEIRAS OU INSTITUCIONAIS)	218.172.889.053,56
INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	2.267.110.089,00
ENTIDADES ABERTAS DE PREVIDÊNCIAS COMPLEMENTAR	134.769.843.353,64
ENTIDADES FECHADAS DE PREVIDÊNCIAS COMPLEMENTAR	1.050.496.577,72
REGIMES PRÓPRIOS DE PREVIDÊNCIA SOCIAL	69.474.826.833,72
SEGURADORAS	1.193.499.800,68
SOCIEDADES DE CAPITALIZAÇÃO E ARRENDAMENTO MERCANTIL	980.596.758,27
CLUBES DE INVESTIMENTO	0,00
FUNDOS DE INVESTIMENTO	25.772.746,93
INVESTIDORES NÃO RESIDENTES	5.499,26
OUTROS (INVESTIDOR QUE NÃO PF, SEM PERSONALIDADE JURÍDICA)	0,00
TOTAL	501.114.838.496,13

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

TIPO DE ATIVO	TOTAL R\$
ações	13.523.660.218,24
debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras	12.525.319.449,57
títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	55.706.288.765,91
cotas de fundos de investimento em ações	2.265.603.910,13
cotas de fundos de investimento em participações	0,00
cotas de fundos de investimento imobiliário	190.612.107,81
cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	601.138.360,72
cotas de fundos de investimento em renda fixa	39.036,52
cotas de outros fundos de investimento	1.366.338.224,77
derivativos (valor de mercado)	57.588.919,55
outros valores mobiliários	54.256.388,01
títulos públicos	414.744.001.313,97
outros ativos	26.457.051,09
TOTAL	501.061.303.746,28

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

A CAIXA Asset não exerce atividades, nem presta serviços, de administrador fiduciário em fundos de investimento.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes.**7. Grupo econômico****7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:****a. controladores diretos e indiretos**

A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL é uma instituição financeira sob a forma de empresa pública, criada nos termos do Decreto-Lei nº 759, de 12 de agosto de 1969, vinculada ao Ministério da Fazenda⁷.

O Conglomerado CAIXA é o conjunto de empresas formado pela CAIXA e pelas empresas nas quais possui participação societária direta ou por meio de suas subsidiárias integrais, CAIXA Seguridade Participações S/A (CAIXA Seguridade), CAIXA Loterias S/A, CAIXA Cartões Holding S/A e CAIXA Asset.

b. controladas e coligadas

A CAIXA Asset não possui participações acionárias em sociedades do grupo.

c. participações da empresa em sociedades do grupo

A CAIXA Asset não possui participações acionárias em sociedades do grupo.

d. participações de sociedades do grupo na empresa

Não se aplica.

e. sociedades sob controle comum

CONGLOMERADO CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		
CNPJ	Participações Societárias	Percentual
32.356.381/0001-32	CAIXA Cartões Holding S/A	100,00%
22.543.331/0001-00	CAIXA Seguridade Participações S/A	82,75%
24.038.490/0001-83	CAIXA Loterias S/A	100,00%
14.841.292/0001-08	CAIXA Imóveis S/A	49,98%

⁷ DECRETO Nº 11.344, DE 1º DE JANEIRO DE 2023, que aprova a Estrutura Regimental e o Quadro Demonstrativo dos Cargos em Comissão e das Funções de Confiança do Ministério da Fazenda e remaneja cargos em comissão e funções de confiança.

33.113.708/0001-08	Negócios Digitais S/A	49,00%
51.427.102/0001-29	Tecnologia Bancária S/A - TECBAN	13,01%
28.042.871/0001-97	Gestora de Inteligência de Crédito S/A - QUOD	15,29%
44.393.564/0001-07	CIP S.A. – Nuclea	8,33%
25.197.090/0001-83	Galgo Sistema de Informações S/A	6,67%
09.613.583/0001-09	Banco Interamericano de Ahorro y Prestamo (BIAPE) - Em liquidação	30,24%

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 item 7.1.

8. Estrutura operacional e administrativa⁸

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

A CAIXA Asset dispõe de um Diretor-Presidente, de uma Diretoria Executiva responsável pela distribuição e estratégia de produtos e de uma Diretoria Executiva responsável pela gestão de recursos, à qual estão vinculadas uma Superintendência responsável pela gestão de fundos tradicionais (mútuos) e uma Gerência responsável pela gestão de fundos estruturados e fundos de fundos.

Além disso, estão também diretamente vinculadas à Presidência da CAIXA Asset a Superintendência responsável pelo gerenciamento de riscos, controles internos, *compliance* e governança, que dispõe de uma Gerência responsável pelo gerenciamento de riscos e uma Gerência responsável pela governança e o *compliance* da CAIXA Asset, bem como uma Gerência responsável pela controladoria e finanças e uma Gerência responsável pela gestão da empresa.

A CAIXA Asset possui estrutura de órgãos colegiados de caráter deliberativo para a tomada de decisão, constituídos pelos representantes das unidades que compõem a companhia.

Seguem abaixo as principais atribuições do Conselho de Administração da CAIXA Asset, da Diretoria Colegiada e dos Comitês Internos da empresa:

CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO CAIXA Asset:

O Conselho de Administração é o órgão de decisão colegiada e de orientação geral dos negócios da CAIXA Asset, responsável por definir diretrizes e objetivos e por monitorar e avaliar os resultados da CAIXA Asset.

DIRETORIA COLEGIADA

⁸ A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.

A Diretoria Colegiada é o órgão executivo de administração e representação da companhia, cabendo-lhe assegurar o funcionamento regular da companhia em conformidade com a orientação geral traçada pelo Conselho de Administração.

COMITÊ DE GESTÃO DE FUNDOS MÚTUOS

Responsável pelas diretrizes de gestão para fundos líquidos e carteiras administradas com características de fundos líquidos.

COMITÊ DE INVESTIMENTO E GESTÃO DE FUNDOS ESPECIAIS

Responsável pelas diretrizes de gestão para Fundos Especiais⁹ e carteiras administradas com características de fundos estruturados.

COMITÊ DE ESTRATÉGIA DE RISCOS, COMPLIANCE E GOVERNANÇA

Responsável por monitorar e deliberar sobre os assuntos relacionados à limites operacionais, gestão de riscos, *compliance* e governança no âmbito do gestor de recursos.

COMITÊ DE PRODUTO E COLOCAÇÃO DE FUNDOS

Responsável por monitorar o movimento da indústria de fundos de investimento e deliberar sobre a viabilidade, constituição, alteração, reposicionamento de produtos e sua estratégia de colocação, além de encerramento de produtos de rede.

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

A regularidade de reuniões dos Comitês Internos da CAIXA Asset é descrita nos respectivos Regimentos Internos.

Todas as reuniões dos Comitês Internos ocorrem com a presença de representantes das equipes de governança e *compliance* e da equipe de gestão de risco.

As deliberações dos Órgãos Colegiados são registradas em atas e arquivadas em ferramenta própria.

Abaixo, seguem a composição e periodicidade de cada Colegiado.

CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO:

Mensal

⁹ Fundos especiais: fundos de investimento em direitos creditórios, fundos de investimento em participações, fundos de investimento imobiliário, fundos de investimento em cotas de fundos de investimento geridos por outras instituições (FOF).

Composição: 2 (dois) membros indicados pelo Ministério da Fazenda¹⁰; 3 (três) membros indicados pela CAIXA; 2 (dois) membros indicados pela CAIXA, com atributo de Conselheiro Independente nos termos do art. 22, §1º da Lei 13.303/2016. O presidente e o vice-presidente do Conselho de Administração serão eleitos dentre os membros indicados pela CAIXA.

DIRETORIA COLEGIADA

Semanal

Composição: Diretor-Presidente da CAIXA Asset, que será presidente do Colegiado, Diretor Executivo de Gestão Fundos de Investimento; Diretor Executivo de Distribuição e Produto.

COMITÊ DE GESTÃO DE FUNDOS MÚTUOS

Mensal

Composição: Diretor Executivo de Gestão Fundos de Investimento, que será presidente do Comitê; Superintendente Nacional de Gestão de Fundos Líquidos; Gerente Nacional de Fundos de Renda Variável; Gerente Nacional de Fundos de Renda Fixa.

COMITÊ DE INVESTIMENTO E GESTÃO DE FUNDOS ESPECIAIS

Bimestral

Composição: Diretor Executivo de Gestão Fundos de Investimento, que será presidente do Comitê; Gerente Nacional de Fundos Estruturados; e Gerente Nacional de Risco de Ativos de Terceiros.

COMITÊ DE ESTRATÉGIA DE RISCOS, COMPLIANCE E GOVERNANÇA

Mensal

Composição: Diretor-Presidente da CAIXA Asset, que será presidente do Comitê; Diretor Executivo de Gestão Fundos de Investimento; Diretor Executivo de Distribuição e Produto; o Superintendente Nacional de Risco, *Compliance* e Governança; Gerente Nacional de *Compliance* e Governança; Gerente Nacional de Risco de Ativos de Terceiros.

COMITÊ DE PRODUTO E COLOCAÇÃO DE FUNDOS

Mensal

Composição: Diretor Executivo de Distribuição e Produto, que será presidente do Comitê; Diretor-Presidente da CAIXA Asset; Diretor Executivo de Gestão Fundos de Investimento; Superintendente Nacional de Gestão de Fundos Líquidos; Superintendente Nacional de Risco, *Compliance* e Governança;

¹⁰ DECRETO Nº 11.344, DE 1º DE JANEIRO DE 2023, que aprova a Estrutura Regimental e o Quadro Demonstrativo dos Cargos em Comissão e das Funções de Confiança do Ministério da Fazenda e remaneja cargos em comissão e funções de confiança.

Gerente Nacional de Relacionamento e Distribuição; Gerente Nacional de Produtos, Inteligência, Mercado e Inovação; e Gerente Nacional de Fundos Estruturados.

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

As principais atribuições e poderes individuais do Diretor Presidente da CAIXA Asset (Presidente) compreendem dirigir, supervisionar, coordenar e controlar as atividades e a política administrativa da CAIXA Asset, coordenar as atividades dos membros da Diretoria Colegiada, representar a companhia em juízo e fora dele, podendo, para tanto, constituir procuradores *ad-negotia* e *ad-judicia*, especificando os atos que poderão praticar nos respectivos instrumentos do mandato, criar e homologar os processos de licitação, podendo delegar tais atribuições, convocar e presidir as reuniões da Diretoria Colegiada, manter os Conselhos de Administração e Fiscal informados das atividades da companhia e exercer outras atribuições que lhe forem fixadas pelo Conselho de Administração.

As principais atribuições e poderes individuais dos Diretores Executivos são gerir as atividades da sua área de atuação, participar das reuniões da Diretoria Colegiada, concorrer para a definição das políticas a serem seguidas pela sociedade e relatar os assuntos da sua respectiva área de atuação, cumprir e fazer cumprir a orientação geral dos negócios da sociedade estabelecida pelo Conselho de Administração na gestão de sua área específica de atuação.

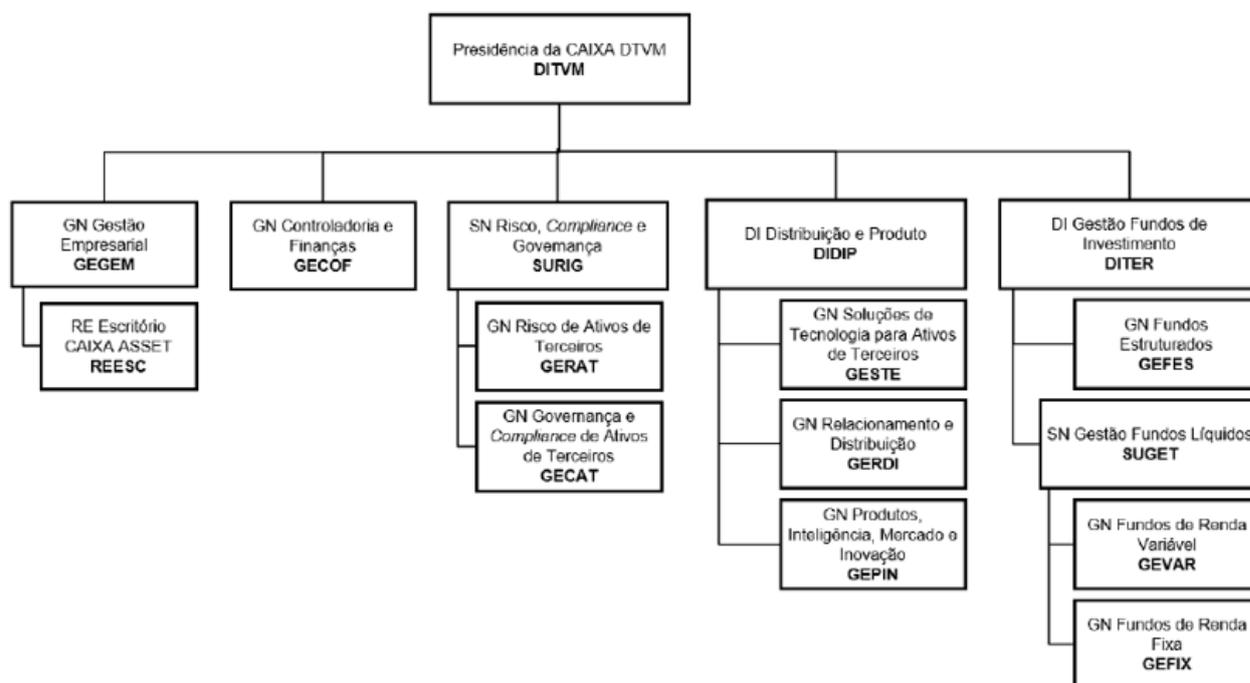
SEGREGAÇÃO DE ATIVIDADES E RESPONSABILIDADES DE DIRIGENTES ESTATUTÁRIOS

O Diretor-Presidente responde pela área de gestão de riscos e *compliance* perante a Comissão de Valores Mobiliários, devendo exercer suas funções com independência e a ele não poderão ser atribuídas atividades relacionadas à administração de carteiras de valores mobiliários, à intermediação e distribuição ou à consultoria de valores mobiliários, ou a qualquer atividade que limite a sua independência, na instituição ou fora dela.

Ao Diretor Executivo responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento não poderão ser atribuídas atividades relacionadas à gestão de recursos, à gestão de riscos e ao *compliance*.

Ao Diretor Executivo responsável pela gestão de recursos de terceiros não podem ser atribuídas a administração, a supervisão ou a coordenação das áreas responsáveis pelas atividades e operações da CAIXA Asset realizadas por conta própria ou no próprio interesse, pelos serviços relativos à liquidação e custódia dos ativos de terceiros e pela administração fiduciária, gestão de riscos e *compliance*.

8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 8.1.



8.3. Em relação a cada um dos diretores de que tratam os itens 8.4, 8.5, 8.6 e 8.7 e dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar, em forma de tabela:

Membros do Conselho de Administração da CAIXA Asset

a. nome	Paulo Henrique Ângelo Souza	Messias dos Santos Esteves	Fabiana Magalhães Almeida Rodopoulos
b. idade	41 anos	50 anos	46 anos
c. profissão	Administrador de Empresas	Economiário	Servidora Pública Federal – Auditoria Federal Finanças e Controle
d. CPF	649.580.942-53	181.769.808-70	634.867.841-53
e. cargo ocupado	Conselheiro de Administração	Conselheiro de Administração	Conselheira de Administração
f. data da posse	14/04/2021	14/04/2021	04/10/2022
g. prazo do mandato	02 anos, conf. Estatuto	02 anos, conf. Estatuto	02 anos, conf. Estatuto
h. outros cargos ou funções exercidos na empresa	Não se aplica	Não se aplica	Não se aplica

a. nome	Bruno Westin Prado Soares Leal	Felipe Moreira Cruzeiro
b. idade	39 anos	41 anos
c. profissão	Economista	Economiário
d. CPF	055.230.506-52	051.933.636-44
e. cargo ocupado	Conselheiro de Administração	Conselheiro de Administração
f. data da posse	24/10/2022	21/12/2022
g. prazo do mandato	02 anos, conf. Estatuto	Até a Assembleia Geral Ordinária de 2023
h. outros cargos ou funções exercidos na empresa	Não se aplica	Não se aplica

Membros da Diretoria Colegiada

a. nome	Gabriel Dutra Cardozo Vieira de Goes	Álvaro Cunha Matos Lessa de Oliveira	Mario Erbolato Neto
b. idade	40 anos	38 anos	41 anos
c. profissão	Bancário	Administrador de empresas	Economista
d. CPF	310.563.998-56	326.638.608-67	214.017.048-24
e. cargo ocupado	Diretor Presidente	Diretor Executivo em exercício Responsável pela Gestão de Recursos	Diretor Executivo em exercício Responsável pela Distribuição e Produto
f. data da posse	14/04/2021	30/03/2022	25/01/2023
g. prazo do mandato	02 anos, conf. Estatuto	02 anos, conf. Estatuto	02 anos, conf. Estatuto
h. outros cargos ou funções exercidos na empresa	Não se aplica	Não se aplica	Não se aplica

8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer:

a) currículo, contendo as seguintes informações:

Diretor	Álvaro Cunha Matos Lessa de Oliveira
i. cursos concluídos;	Pós-graduação em Gestão de Ativos Financeiros

	Graduação em Administração de Empresas
ii. aprovação em exame de certificação profissional	Certificação de Gestores, ANBIMA (CGA) Certificação Gestores ANBIMA para Fundos Estruturados (CGE)
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	1. Diretor Executivo, em exercício - Diretoria Executiva de Gestão de Fundos de Investimento (CAIXA Asset) 2. Gerente Nacional – Gerência de Desenvolvimento de fundos Estruturados (CAIXA) 2. Gerente Executivo – Superintendência de Gestão de Ativos de Terceiros (CAIXA)
· nome da empresa	1. CAIXA Asset 2. CAIXA
· cargo e funções inerentes ao cargo	1. Diretor Executivo, em exercício - Diretoria Executiva de Gestão de Fundos de Investimento (CAIXA Asset) 1. Gerente Nacional – Gerência de Desenvolvimento de fundos Estruturados (CAIXA) 2. Gerente Executivo – Superintendência de Gestão de Ativos de Terceiros (CAIXA)
· atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	1. Gestora de Carteira de Valores Mobiliários 2. Instituição Financeira
· datas de entrada e saída do cargo	1. 30.03.2022 até o presente momento - Diretor Executivo, em exercício; 1. 02.02.2021 a 30.03.2022 – Gerente Nacional, Gerência de Desenvolvimento de Fundos Estruturados; 2. 21.11.2019 a 01.02.2021 – Gerente Executivo, Gerência de Desenvolvimento de Fundos Estruturados; 2. 23.02.2018 a 20.11.2019 – Gerente Executivo, Superintendência de Gestão de Ativos de Terceiros; 2. 01.10.2014 a 22.02.2018 – Operador de Mesa Sênior, Superintendência de Gestão de Ativos de Terceiros; 2. 07.10.2011 a 30.09.2014 – Operador de Mesa Sênior, Gerência de Fundos de Renda Variável; 2. 04.03.2011 a 06.10.2011 – Operador de Mesa Pleno, Gerência de Fundos de Renda Variável; 2. 03.11.2010 a 03.03.2011 – Operador de Mesa Pleno, Gerência de Fundos Especiais; 2. 01.07.2010 a 02.11.2010 – Operador de Mesa Junior, Gerência de Fundos de Renda Fixa;

8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e da Resolução CVM 21, fornecer:

a) currículo, contendo as seguintes informações:

Diretor	Gabriel Dutra Cardozo Vieira de Goes
i. cursos concluídos;	Graduação em Administração de Empresas Pós-Graduação em Análise Econômica
ii. aprovação em exame de certificação profissional	
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	Diretor-Presidente (CAIXA Asset) Vice-Presidente de Finanças e Controladoria da CAIXA (07/2019 – 06/2021) Diretor de Controladoria da CAIXA (04/2019 – 12/2019) Head da Tesouraria e Mercado de Capitais da CAIXA (07/2012 – 04/2019)
· nome da empresa	1.CAIXA Asset 2.CAIXA 3.ANBIMA 4.CAIXA Cartões 5. Fundo Garantidor de Créditos 6.Companhia Brasileira de Securitização - CIBRASEC
· cargo e funções inerentes ao cargo	1. Diretor Presidente 2.Head da Tesouraria e Mercado de Capitais da CAIXA (07/2012 – 04/2019), Diretor de Controladoria (04/2019 – 12/2019), Vice- Presidente de Finanças e Controladoria (07/2019 – 06/2021) 3.Membro da Diretoria Executiva (2020 – dezembro 2021) 4.Conselheiro Fiscal (2020 – dezembro 2021) 5.Conselheiro Consultivo (2019 -2021) 6.Conselheiro de Administração (2014-2017)
· atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	1. Gestora de Carteira de Valores Mobiliários 2. Instituição Financeira 3. Entidades Representativa do setor Financeiro e Mercado de Capitais 4. Prestadora de Serviços em Meios de Pagamentos 5. Fundo Garantidor de Créditos 6. Companhia Securitizadora
· datas de entrada e saída do cargo	1.Diretor Presidente (22.07.2021 até o presente momento) 2.Head da Tesouraria e Mercado de Capitais da CAIXA (03/07/2012 – 15/04/2019), Diretor de Controladoria (16/04/2019 – 11/12/2019), Vice-Presidente de Finanças e Controladoria (24/07/2019 – 22/06/2021) 3.Membro da Diretoria Executiva (2020 – dezembro 2021) 4.Conselheiro Fiscal (2020 – 2021) 5.Conselheiro Consultivo (2019 -2021) 6.Conselheiro de Administração (2014-2017)

8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:

a. currículo, contendo as seguintes informações:

i. cursos concluídos;

- ii. **aprovação em exame de certificação profissional**
- iii. **principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:**
 - **nome da empresa**
 - **cargo e funções inerentes ao cargo**
 - **atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram**
 - **datas de entrada e saída do cargo**

O diretor responsável pela gestão de risco é a mesma pessoa indicada no item anterior.

8.7. Em relação ao diretor responsável pela atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento, caso não seja a mesma pessoa indicada no item 8.4, fornecer:

- a. **currículo, contendo as seguintes informações:**
 - i. **cursos concluídos;**
 - ii. **aprovação em exame de certificação profissional**
 - iii. **principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:**
 - **nome da empresa**
 - **cargo e funções inerentes ao cargo**
 - **atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram**
 - **datas de entrada e saída do cargo**

Não se aplica.

A CAIXA Asset pode vir a atuar como distribuidora de títulos e valores mobiliários, considerando integrar o sistema de distribuição de títulos e valores mobiliários.

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

- a. **quantidade de profissionais**

76 profissionais atuam diretamente na gestão de recursos.

- b. **natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes**

Gestão de recursos de fundos tradicionais - gestão de fundos de renda fixa, renda variável, multimercados e carteiras administradas por meio da atuação de suas gerências vinculadas, de renda fixa e renda variável.

Gestão de recursos de fundos especiais - gestão de FIP, Fundos de Fundos, FIDC e FII. São atividades: prospectar, implementar e customizar os fundos, implantar modelos de gestão, mediante interface com os serviços de administração fiduciária, custódia, controladoria e escrituração; realizar análises e/ou estudos setoriais; planejar a composição da carteira dos fundos; selecionar, formatar e simular carteiras teóricas e prospectivas; efetuar análise e organização financeira, técnica e legal dos fundos; analisar propostas de parcerias; prospectar, avaliar e negociar títulos e valores mobiliários e realizar a gestão financeira dos fundos.

Os operadores de mesa são responsáveis por operacionalizar a negociação dos ativos financeiros, otimizando a utilização dos recursos, de modo a contribuir para maximização dos lucros e alcance dos objetivos organizacionais e resultados sustentáveis. As atribuições englobam o enquadramento e o fluxo de caixa dos fundos, elaborar relatórios gerenciais com análises sobre rentabilidade, mercado e gestão das carteiras, prestar informações para órgãos reguladores e fiscalizadores.

Os gerentes executivos são responsáveis por gerenciar equipes de trabalho composta pelos operadores de mesa, monitorar todas as operações realizadas no dia pela equipe, planejar e definir metodologias de atuação, padrões e normas relacionados aos processos, produtos e serviços da gestão de recursos; gerir e controlar a execução das atividades, gerenciamento de carteiras administradas e fundos de investimento operacionalização das estratégias de alocação de recursos.

Os gerentes nacionais são responsáveis por gerenciar equipes e trabalhos de sua unidade, formular políticas, definir diretrizes e estabelecer metas; planejar, acompanhar e definir os indicadores de desempenho das atividades; garantir a qualidade dos processos, produtos e serviços da gestão de recursos, gestão de carteiras administradas e fundos de investimento e pelas estratégias de alocação de recursos.

O superintendente nacional é responsável por gerir as unidades de gestão de recursos, a formulação políticas e estratégias, visando o alcance dos objetivos organizacionais e resultados sustentáveis; planejar, acompanhar e avaliar o desempenho global dos processos, produtos e serviços da gestão de recursos, definir políticas e estratégias que viabilizem a implantação do planejamento estratégico, garantindo a execução das diretrizes traçadas pela Diretoria da CAIXA Asset e a conformidade dos processos sob sua responsabilidade, definir as estratégias para composição de fundos de investimento e carteiras administradas.

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

As rotinas e procedimentos envolvem, principalmente: a) verificar o caixa dos fundos, considerando movimentações (aplicações e resgates), operações

realizadas, custos e recebimentos de cupons e títulos, amortizações, pagamentos de proventos, dentre outros; b) registrar, conferir e autorizar operações compromissadas nos sistemas custodiantes, conforme parâmetros previamente estabelecidos pela gerência; c) monitorar o enquadramento e o fluxo de caixa dos fundos através dos relatórios disponibilizados pelos custodiantes, conforme seus respectivos regulamentos, legislação vigente, política de risco e demais fatores, se houver; d) realizar operações necessárias à gestão diária de fluxo de caixa e ao enquadramento dos fundos, inclusive entre fundos, desde que tais operações não gerem alteração no perfil da carteira de investimento dos fundos, considerando ainda critérios de liquidez, volatilidade e enquadramento, e) registrar, conferir e autorizar nos sistemas custodiantes operações com títulos públicos, privados, derivativos, cotas de fundos, ações, margens de garantia e movimentações financeiras, entre outros; f) gerenciar a composição de fundos e carteiras administradas através da definição de estratégias e do monitoramento da evolução das exposições; g) monitorar o cumprimento das obrigações previstas nos instrumentos dos títulos e valores mobiliários.

As rotinas e procedimentos da gestão de fundos estão dispostos em normativos internos e manuais operacionais disponíveis em sistema de manuais normativos.

São utilizados os seguintes sistemas de informação:

- Sistema de Carteiras - Permite o acompanhamento da performance dos fundos e carteiras geridos pela Caixa e a comparação com a performance dos concorrentes;
- Sistema de Administração de Recursos de Terceiros - Permite acesso aos serviços de consulta de aplicação, resgate, on-line, auxiliando na gestão do fluxo de caixa;
- Sistema Financeiro - Controle das carteiras custodiadas e registro das operações dos fundos de investimento e carteiras administradas custodiadas na Caixa;
- Provedores de informação tais como Broadcast, CEIC (Internet Securities), Bloomberg, ANBIMA, Economática e Quantum (Paramita);
- Sistema de Front Office utiliza a solução Bloomberg AIM.

O sistema de Front Office da Caixa Asset, utilizado pelos gestores e operadores, é o sistema AIM (Asset and Investment Manager), fornecido pela Bloomberg. Este sistema tem como principal funcionalidade o módulo de gerenciamento de ordens (OMS - Ordem Management System) que permite o registro da ordem, passando pelo roteamento da ordem para contrapartes, acompanhamento de quantidades e preços de execução e distribuição conforme parâmetros preestabelecidos, com todas as informações de cada um destes processos registradas e passíveis de recuperação por função de trilha de auditoria. O sistema também conta com módulo de gerenciamento de posições, onde é feita a gestão dos portfólios, elaboração e acompanhamento de estratégias e simulação de cenários considerando operações e movimentos de mercado.

Além destes, o módulo de *compliance* do sistema permite acompanhamento pelo time de *compliance* da CAIXA Asset das regras de enquadramentos previstas em legislação, regulamentos e mandatos dos Fundos de Investimento, emitindo alertas de limites próximos e impedindo operações que gerem violações de regras.

Também são utilizados relatórios econômicos e projeções elaborados pela área de pesquisa da diretoria responsável pela gestão de recursos, além de relatórios disponibilizados por bancos e corretoras.

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

a. quantidade de profissionais

14 profissionais atuam nas atividades de controles internos e 07 (sete), na fiscalização de prestadores de serviços contratados, em especial corretoras.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

As atividades desempenhadas pela área de *compliance* da CAIXA Asset possuem natureza técnica de monitoramento, acompanhamento e controle dos procedimentos e documentos com o objetivo de gerir o sistema de *compliance* e relacionamento com órgãos reguladores, com dinâmica e constante interação junto a área de controle e risco da CAIXA.

A área de *compliance* da CAIXA Asset também atua de maneira preventiva, por meio da disseminação de conteúdos voltados para os mais variados temas sob seus mandatos, como ética, conduta, integridade, PLDFTP etc. A disseminação é realizada por meio de vídeos educativos, *lives*, eventos com palestrantes de mercado e empregados especialistas do Conglomerado, cards, página web e por meio de demais comunicações eletrônicas.

Adicionalmente, a Célula de Middle Office da SUGET é responsável pelos procedimentos de habilitação, seleção e contratação de terceiros, para atuar na intermediação de títulos e valores mobiliários e na centralização de custódia e liquidação de Mercados administrados pela B3. O monitoramento e controle dos serviços prestados pelos terceiros contratados, e do atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à gestão de recursos, é realizado pelos profissionais que atuam diretamente na gestão de recursos, atuando como primeira linha de defesa no processo. Periodicamente, a Célula de Middle Office da SUGET, realiza ações de supervisão dos terceiros contratados, seguindo a metodologia de Supervisão Baseada em Risco da ANBIMA, para certificar-se sobre o cumprimento dos requisitos mínimos para habilitação, e se apresenta padrão de qualidade satisfatório na prestação dos serviços

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

As rotinas e os procedimentos englobam identificação e monitoramento de possíveis riscos operacionais, manutenção da conformidade da CAIXA Asset em relação às normas e regulamentos internos e externos, decisões em comitês, manuais de alçadas e operacionais. Incluindo também ações para revisão sistemática de processos, a adoção de políticas internas e programas de disseminação da cultura de controles internos.

É realizado monitoramento e verificação de indicadores de efetividade da Política de *Compliance* na atividade de administração e gestão de carteiras de valores mobiliários e realização de testes periódicos de conferência e controle.

O processo de *Due Diligence* para a contratação de prestadores de serviços para os fundos de investimento geridos pela CAIXA Asset é conduzido de acordo com as normas vigentes e melhores práticas do mercado.

A revisão dos documentos, processos e informações apresentadas pelo prestador de serviços é efetuada periodicamente, conforme normas internas vigentes.

Há o monitoramento dos prestadores, considerando a qualidade dos serviços prestados (ocorrências de falhas e intempestividades no atendimento), bem como as recomendações realizadas no processo de *Due Diligence*.

A fiscalização dos serviços prestados por terceiros também compreende a verificação da política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Financiamento ao Terrorismo – PLDFT, dos prestadores de serviço em relação ao atendimento da legislação vigente.

Para isso, a companhia utiliza sistema de mercado para o acompanhamento das normas publicadas - ferramenta denominada Compliasset - e realiza a execução das rotinas da área com o uso de aplicativos para edições de texto, planilha de dados, banco de dados, troca de mensagens eletrônicas, entre outras atividades, além de se valer de sistema de monitoramento reputacional para acompanhamento regulatório quanto aos entes que mantém ou venha a manter algum tipo de relacionamento.

A companhia também utiliza a ferramenta Bloomberg AIM (Asset and Investment Manager) nas operações da mesa de gestão, com monitoramento integrado do *Compliance* nas atividades de pré-negociação, pós execução e de fim de dia.

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

A CAIXA Asset, como subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, tem uma estrutura segregada na arquitetura organizacional e no modelo de gestão da CAIXA, de forma a assegurar os interesses dos clientes desse segmento de negócio, atender a regulação vigente no que diz respeito ao princípio da segregação de atividades, evitar conflitos de interesses e para que não ocorra qualquer interferência das demais áreas da instituição nesse processo.

As atividades sob responsabilidade da CAIXA Asset são monitoradas pela unidade de Risco, *Compliance* e Governança, áreas dedicadas unicamente às atividades da CAIXA Asset e lotadas fisicamente nas dependências da companhia. São subordinadas diretamente ao Presidente da CAIXA Asset, dirigente estatutário responsável pela gestão de risco e controles internos da companhia. Sua atuação está pautada também no monitoramento do estado de *compliance*, manutenção da conformidade da CAIXA Asset em relação às normas e regulamentos internos e externos, decisões em comitês, manuais de alçadas e operacionais.

As atividades da CAIXA Asset - como empresa do conglomerado CAIXA - são ainda acompanhadas pela Vice-Presidência de Riscos – VICOR, estrutura da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL.

As áreas de Controle Interno/*Compliance* da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL e da CAIXA Asset participam de treinamentos periódicos e possuem acesso às informações internas, de modo a acompanhar as atividades e ocorrências relacionadas à cada área de especialização. Também se mantém em dinâmica e constante interação, possuindo níveis de reporte e comunicação.

A CAIXA Asset é monitorada, ainda, pelos órgãos reguladores e fiscalizadores, bem como às orientações expedidas pela autorregulação.

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

a. quantidade de profissionais

21 profissionais atuam nas atividades de gestão de riscos.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

O processo de gestão de riscos da CAIXA Asset está estruturado segundo a “Política de Gerenciamento de Riscos para Gestão de Ativos de Terceiros”, que estabelece as diretrizes para o gerenciamento dos riscos aos quais os Fundos de Investimento, as Carteiras Administradas, os processos e os serviços de gestão de Ativos de Terceiros podem estar expostos, considerando suas características e em consonância com as regulamentações interna e externa e às melhores práticas de mercado.

A Gestão de Riscos envolve a identificação, avaliação, mensuração, monitoramento, estabelecimento de limites, controle, reporte, proposição de ações de mitigação e simulação da exposição em cenários de normalidade e de estresse, abrangendo todas as fontes relevantes de risco.

A estrutura de gerenciamento de riscos engloba políticas, regras e procedimentos, sistemas para mensurar, monitorar e controlar considerando a natureza e a complexidade dos produtos, processos e a dimensão da exposição aos riscos de crédito, mercado, liquidez, imagem e reputação, socioambiental,

Compliance, operacional e demais riscos relevantes para os produtos, processos e serviços que envolvem a gestão de Ativos de Terceiros.

A Gestão de Riscos promove também os princípios de desenvolvimento sustentável implantando os conceitos da gestão integrada ao meio ambiente, qualidade, saúde e segurança no trabalho e responsabilidade social ao negócio.

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

A CAIXA Asset controla, monitora e mitiga as exposições aos riscos dos seus produtos, processos e serviços, a fim de minimizar os impactos de eventos inesperados e indesejados na performance e no cumprimento dos objetivos de seus produtos e serviços, com monitoramento contínuo do atendimento às regulamentações internas e externas, bem como execução de ações preventivas e corretivas.

No desempenho das atividades, é utilizado o sistema Argus (fornecido pela empresa Maps S.A. Soluções e Serviços) para gestão de risco de mercado e, para a gestão de risco de liquidez e crédito, é utilizado sistema departamental – Sistema de Risco de Ativos de Terceiros.

Os sistemas, rotinas, procedimentos e desempenho das metodologias e dos modelos utilizados são avaliados de forma sistemática e periódica, com vistas à validação dos resultados obtidos, correções e ajustes necessários e a verificação da suficiência da documentação para possibilitar a identificação dos elementos construtivos do processo de desenvolvimento e testes.

A tomada de decisão quanto à mitigação, transferência, ou assunção do risco tem atuação efetiva por parte do gestor responsável e da cadeia de governança com alçadas de decisão estabelecidas previamente pela Alta Administração da CAIXA Asset.

O monitoramento dos riscos é realizado diariamente e está estruturado com linhas de reporte para assegurar a avaliação e gerenciamento dos níveis de riscos assumidos pelos fundos, conforme seu grau de comprometimento de limite. Os eventos de riscos estão estruturados em Nível I e Nível II.

O acionamento de um evento de Nível I reflete comprometimento moderado do limite e serve de gatilho para maior atenção do gestor. Os eventos são reportados pela área de gestão de riscos diariamente por meio de relatórios de risco ao gestor dos fundos.

O acionamento de um evento de Nível II reflete comprometimento do limite estabelecido. A área de gestão de riscos comunica o gestor de fundos com os apontamentos e informações/suporte para análise. Caso o gestor de fundos não reenquadre as posições do(s) fundo(s) dentro dos limites em até 1 dia útil, deverá apresentar plano de ação que será monitorado pela área de gestão de riscos.

Mensalmente a equipe de gestão de riscos emite para às áreas competentes e à Alta Administração Relatório Gerencial de Riscos apresentando as

informações, as análises, os monitoramentos realizados e, caso ocorra, qualquer descumprimento dos limites estabelecidos.

As situações excepcionais ou não previstas na política e diretrizes de gestão de risco são analisadas e deliberadas em âmbito de comitê interno e reportadas à Alta Administração periodicamente. Tais situações são, ainda, analisadas pela área de risco que revisa os procedimentos e critérios estabelecidos de maneira a garantir que novas situações semelhantes ou decorrentes estejam previamente previstas na política.

Risco de Mercado

O processo de gerenciamento de risco de mercado a que os fundos de investimento estão expostos divide-se em três etapas distintas: (1) determinação dos fatores de risco e quantificação de seus efeitos, (2) determinação dos níveis aceitáveis de exposições aos fatores de risco, (3) adequação das exposições de risco originais aos níveis definidos, objetivando desta forma o equilíbrio risco/retorno de cada fundo.

O risco de mercado é mensurado através da metodologia *Value at Risk* (VaR), modelo paramétrico com grau de confiança de 95% para um intervalo de tempo de 1 (um) dia, utilizando para o cálculo da volatilidade o modelo estatístico EWMA, sob condições normais de mercado, por meio de solução tecnológica contratada.

A aderência do modelo e dos parâmetros utilizados para cálculo do risco é verificada pelo processo de *backtesting*, realizado no mínimo anualmente.

Para monitoramento do risco de mercado sob situação não capturada pelo modelo de VaR Paramétrico, são realizados testes de stress com base em cenários projetados que buscam refletir possíveis situações atípicas de mercado.

São atribuídos limites de exposição ao risco de mercado considerando as características do fundo e o seu perfil de risco, de acordo com o objetivo da sua política de investimento estabelecida em regulamento.

Risco de Crédito, Concentração e Contraparte

O processo de análise e gerenciamento do risco de crédito é realizado através da aplicação de metodologias quantitativas e qualitativas, de execução de análise fundamentalista baseada em análises técnicas das demonstrações financeiras auditadas, informações públicas e de relatórios setoriais, resultando na confecção e divulgação ao demandante de parecer técnico contendo a respectiva classificação de risco de crédito. Importa mencionar que a reavaliação do risco de crédito do Emissor/Operação é realizada e reportada ao demandante frequentemente, a depender da qualidade no nível de crédito ou tempestivamente, ao tempo do conhecimento de Fatos Relevantes que possam impactar na capacidade creditícia do Emissor/Operação avaliada. As novas avaliações são atendidas por meio do recebimento de solicitação formal pelo demandante.

O controle do risco de crédito é baseado em política de crédito e realizado por meio de processo de análise e monitoramento dos emissores e dos ativos financeiros.

O gerenciamento da exposição ao risco de crédito dos Fundos de Investimento utiliza como premissa a avaliação de risco de crédito do emissor e emissão, o prazo da operação e o enquadramento na política de investimento do Fundo por meio de monitoramento diário das exposições e dos níveis de utilização dos limites estabelecidos, visando assegurar o conhecimento da evolução dessas posições e o potencial aumento dos riscos decorrentes à gestão e às instâncias deliberativas.

Os limites máximos de crédito são definidos considerando o emissor de forma individual, o grupo econômico/conglomerado, o valor de emissão, o objetivo da política de investimento do fundo, a exposição de cada produto e a exposição global considerando as notas de avaliação de risco de crédito e o prazo do ativo. Todas as avaliações de risco de crédito de emissor e de operação possuem prazo de validade, que visam promover a integridade dos resultados gerados pelos modelos e análises de risco de crédito.

O risco de crédito é reavaliado periódica ou tempestivamente em observância às normas estabelecidas pelos órgãos reguladores, contemplando a natureza, prazo, situação do contrato e relevância da operação.

Para fins de mitigação dos riscos de concentração e contraparte são atribuídos limites máximos de alocação de ativos, considerando as características do fundo e o seu perfil de risco, e nas operações que não tenham garantia de liquidação por câmaras ou prestadoras de serviços de compensação e de liquidação autorizados a funcionar pelo BACEN ou pela CVM observam-se as regras, critérios e limites de análise e gestão de risco de crédito.

Para atribuição dos limites máximos na alocação de ativos, consideram-se o tomador de forma individual, o grupo econômico/conglomerado, o valor de emissão, o objetivo da política de investimento do fundo, a exposição de cada produto e a exposição global tendo como parâmetro as notas de avaliação de risco de crédito e o prazo do ativo.

As regras e os limites de exposição a riscos são revisados periodicamente, ou sempre que modificações nas condições macroeconômicas, nas condições do mercado financeiro ou na estratégia empresarial justificarem.

Para o acompanhamento e reporte aos gestores e à Alta Administração, a área de riscos emite relatórios periódicos com informações de exposição global, por tipo de ativo, emissor e limites de exposição ao risco de crédito.

Para o monitoramento do risco de contraparte, o processo de seleção, contratação e supervisão dos prestadores de serviços pelo gestor aos fundos de investimento e de corretoras é realizado com base em manuais operacionais específicos e estão descritos no item 10.1 deste Formulário de Referência.

Os fundos geridos pela CAIXA Asset não têm como contraparte pessoas físicas nas operações de mercado. As operações realizadas pelos fundos e carteiras com a instituição administradora, gestora ou parte a elas relacionada são, a exemplo das demais operações, realizadas a preço de mercado.

Risco de Liquidez

O gerenciamento do risco de liquidez utiliza práticas de maneira a evitar escassez de caixa e dificuldades em honrar os resgates solicitados, utilizando modelo baseado em histórico de aplicações e resgate e em índice de negociabilidade dos ativos no mercado secundário. Além disso, é monitorada a concentração de volumes financeiros por prazo e por cotistas.

A metodologia de mensuração do risco de liquidez contempla projeção de fluxo de caixa baseado em histórico de entradas e saídas, classificação de liquidez que utiliza o histórico de negociação dos ativos no mercado secundário, prazo de cotização e acompanhamento de concentração de volumes por vencimentos, por prazo e por cotistas.

A aderência do modelo e dos parâmetros utilizados para cálculo do risco de liquidez é verificada pelo processo de *backtesting*, para a validação ou verificação da precisão do modelo de risco de liquidez adotado, o qual é realizado no mínimo anualmente.

Para o monitoramento da liquidez em cenários adversos, as carteiras dos Fundos são submetidas a testes de estresse periódicos que levam em consideração cenários estressados tanto para o ativo quanto para o passivo dos fundos.

Os cenários estressados são obtidos a partir de combinações dos piores cenários históricos para a liquidez dos ativos e para os resgates das carteiras e, também, das particularidades dos fundos.

O limite de exposição ao risco de liquidez é definido considerando o perfil do passivo do fundo, o nível de exposição dos ativos alocados em carteira, os custos e despesas.

Risco Operacional

A metodologia de gestão de riscos operacionais para ativos de terceiros consiste na avaliação, de maneira descentralizada pela área de risco de ativos de terceiros e pela visão dos gestores dos processos nas unidades subordinadas, da efetividade dos controles e da potencialidade dos riscos, possibilitando a percepção de exposições indesejadas e a implementação de medidas mitigadoras.

As etapas da avaliação de riscos e controles compreendem identificar, mensurar, avaliar, monitorar, reportar, controlar e mitigar os riscos operacionais, por meio de ações e estratégias que visam manter a exposição ao risco operacional das atividades em níveis adequados, de forma a auxiliar a Instituição no alcance de seus objetivos, no cumprimento dos limites estabelecidos, leis e regulamentos, bem como na correção de eventuais desvios.

A gestão de riscos operacionais nas atividades mandatórias compreende estrutura para responder de forma adequada à recuperação, à restauração e aos níveis acordados de disponibilidade para os processos mais críticos das unidades subordinadas, no caso de ocorrência de eventos que provoquem a interrupção dos seus serviços, preservando, assim, os interesses de todas as partes envolvidas.

O Plano de Resposta à Emergências é definido para garantir a continuidade das atividades em situação de contingência.

A contratação de terceiros para prestação de serviços a fundos e carteiras contém processo estruturado de avaliação e contratação de terceiros. Regrado por normativo interno aprovado pela alta administração, o processo conta com o estabelecimento de regras, procedimentos, papéis e responsabilidades, que definem os requerimentos mínimos a serem observados e avaliados, garantindo o atendimento de aspectos relacionados à estrutura/capacidade operacional, segurança da informação, aderência às exigências regulamentares, entre outros aspectos requeridos de acordo com a natureza do serviço.

O relacionamento com parceiros, fornecedores e prestadores de serviços é monitorado periodicamente, podendo ser interrompido a qualquer tempo, quando for identificado sua possível vinculação com ações e condutas inidôneas e/ou infringências legais, que possam representar riscos de imagem e reputação à CAIXA Asset.

Risco ASG

A CAIXA Asset considera nas suas decisões de gestão de ativos de terceiros e nos processos de gestão de riscos, os critérios de análise de investimento relacionados às dimensões ASG (ambientais, sociais e de governança), vislumbrando, portanto, a sustentabilidade dos seus negócios a longo prazo.

Essas informações são consideradas com a finalidade de evitar que a assimetria informacional possibilite a tomada de decisão equivocada de investimentos, e, conseqüentemente, corrobora o compromisso em atuar com ética, transparência e sustentabilidade dos seus negócios a longo prazo.

Risco de Imagem/Reputação

Os mecanismos adotados para a mitigação desses riscos estão relacionados à contratação de conselheiros independentes, a criação de áreas de *compliance* nas empresas. Todas são iniciativas que visam evitar que danos de imagem virem problemas de reputação.

As unidades de 1ª Linha de Defesa, gestores e administradores, são responsáveis por elaborar metodologia que permita avaliar a percepção de seus stakeholders em relação aos seus processos, produtos e serviços.

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

A CAIXA Asset possui uma unidade dedicada ao gerenciamento de riscos subordinada à unidade de Risco, *Compliance* e Governança, com vinculação direta à Presidência da companhia, o que garante o exercício das suas atividades de forma independente, com a responsabilidade em executar efetivamente o controle, monitoramento e gerenciamento dos riscos dos produtos, processos e serviços da CAIXA Asset.

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

- a. quantidade de profissionais**
- b. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos**
- c. a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade.**

Não se aplica, considerando que a CAIXA Asset exerce as atividades de gestão de recursos de terceiros e as atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas são contratadas e monitoradas pelo administrador fiduciário dos fundos.

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

A atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento geridos pela CAIXA Asset é atualmente realizada pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL.

A CAIXA Asset pode vir a atuar como distribuidora de títulos e valores mobiliários, inclusive fundos de investimento.

a. quantidade de profissionais

Não se aplica, considerando o disposto acima e o Formulário de Referência trata das atividades de gestão de Recursos.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Não se aplica, considerando o disposto acima e o Formulário de Referência trata das atividades de gestão de Recursos.

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

Não se aplica, considerando o disposto acima e o Formulário de Referência trata das atividades de gestão de Recursos.

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

Não se aplica, considerando o disposto acima e o Formulário de Referência trata das atividades de gestão de Recursos.

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

Não se aplica, considerando o disposto acima e o Formulário de Referência trata das atividades de gestão de Recursos.

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

9. Remuneração da empresa

9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 6.1, indicar as principais formas de remuneração que pratica

A remuneração da CAIXA Asset advém preponderantemente da parcela referente aos serviços de gestão de recursos oriundos da taxa de administração dos fundos de investimento e carteiras administradas.

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

TIPO DE RECEITA	% PART
a. taxas com bases fixas	99,88%
b. taxas de performance	0,05%
c. taxas de ingresso	-
d. taxas de saída	0,04%
e. outras taxas	0,03%
TOTAL	100%

9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

10. Regras, procedimentos e controles internos

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

O processo de seleção, contratação e supervisão dos prestadores de serviços para os fundos de investimento se baseia em Política interna, a qual é revisada periodicamente.

A seleção tem início com a solicitação de proposta comercial a, pelo menos, três prestadores. No processo, são observados critérios como, mas não se limitando à: i) custo dos serviços; ii) histórico na prestação do serviço; e iii) rankings publicados pela ANBIMA.

Adicionalmente, os processos de seleção dos prestadores de serviço são submetidos, por meio de voto, à deliberação em comitê, quando da constituição de Fundo de Investimento; caso a contratação do serviço seja posterior à deliberação da constituição do fundo, o comitê toma conhecimento do processo de seleção do prestador.

Após aprovação, a contratação do prestador selecionado é precedida de processos de *due diligence*, incluído metodologia de ABR para classificação de risco LDFTP, (quando aplicável).

A supervisão do prestador de serviços ocorre com base em procedimentos definidos em manuais operacionais e de acordo com o tipo de serviço prestado, além de práticas de mercado.

O processo de seleção e contratação de corretoras é realizado com base em manual operacional específico. Para atuar na intermediação de operações junto aos Fundos de Investimento, as corretoras, primeiramente, são submetidas a um processo de habilitação, no qual se verifica a idoneidade e capacidade técnica do postulante, e se confirma a associação ou adesão ao Código ANBIMA de Negociação de Instrumentos Financeiros.

A habilitação é a etapa na qual as corretoras e distribuidoras são selecionadas pela CAIXA Asset e pode ser realizada a qualquer tempo, havendo interesse mútuo entre corretora e gestora.

As corretoras habilitadas são submetidas ao processo de *due diligence* e ABR de LDFTP, conduzido pelo *Compliance*, previamente à contratação. Não havendo apontamentos impeditivos em relatório de *due diligence*, as corretoras podem ser contratadas.

Anualmente, são estabelecidos os limites máximos de corretagem para as corretoras, a fim de compatibilizar a distribuição do volume de corretagem gerado e a qualidade dos serviços prestados pelas corretoras e seu respectivo grau de risco atribuído. As corretoras contratadas estão sujeitas a ações de supervisão, com base na metodologia de Supervisão Baseada em Risco da ANBIMA, a qual tem como propósito direcionar maior atenção aos terceiros que demonstrem maior probabilidade de incorrer em falhas.

Anualmente, as corretoras contratadas são classificadas, conforme critérios estabelecidos em manual operacional específico, em baixo, médio e alto risco, e de acordo com a classificação de risco é definida a periodicidade das ações de supervisão para a corretora.

Constituem-se como ações de supervisão a avaliação da qualidade operacional dos serviços prestados e a realização de pesquisas reputacionais, com objetivo de certificar o cumprimento dos requisitos mínimos para manter a habilitação e verificar se o terceiro apresenta padrão de qualidade satisfatório na prestação dos serviços.

O processo de seleção e contratação de agente centralizador de custódia e liquidação é realizado com base em manual operacional específico.

Previamente ao processo de seleção, as corretoras são submetidas a um processo de habilitação e pré-seleção, nos quais se verifica a idoneidade, capacidade técnica, associação ou adesão aos Códigos ANBIMA, e porte da instituição.

As corretoras habilitadas participam do processo de seleção, que envolve a avaliação de critérios objetivos como custo do serviço, capacidade de atendimento, volume sob custódia e recursos tecnológicos informados em formulário pela corretora.

Após aprovação, a contratação do prestador selecionado é precedida de processos de *due diligence*, e metodologia de ABR para classificação de risco LDFTP, se aplicável. selecionada a corretora que obtiver a maior nota na soma dos critérios. O agente centralizador de custódia e liquidação está sujeito a ações de supervisão.

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

Os maiores custos de transação são as corretagens e emolumentos pagos nos mercados de balcão e de bolsa. Os emolumentos das bolsas são fixos e não são negociáveis. Os valores máximos de corretagem pagos pelos fundos nos diversos mercados de atuação são estabelecidos pelo gestor e, constam em manuais normativos internos. Os percentuais de devolução de corretagem (bolsas) e de *spreads* sobre títulos públicos e privados são revisados periodicamente e adequados, quando necessário, em virtude de volume negociado e comparação com as melhores práticas do mercado.

O gestor faz um acompanhamento de todas as operações realizadas, considerando o volume gerado de corretagem e spread pago às contrapartes.

O gestor atua diariamente para adequar os percentuais de corretagem pagos nos mercados Balcão, BM&F e Bovespa aos limites estabelecidos anualmente para distribuição do volume de corretagem.

Os custos envolvidos nas transações estão incluídos no monitoramento das operações realizadas desde o momento de sua concepção, fazendo parte da avaliação do gestor sobre a viabilidade e relação risco vs. retorno de cada operação.

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

É vedado aos empregados e dirigentes da CAIXA Asset solicitar ou aceitar qualquer tipo de pagamento, remuneração, comissão, presente, brinde, entretenimento, contribuição, dação ou doação, compensação, gratificação ou qualquer outra vantagem financeira ou de qualquer natureza, bem como obter, de outra forma, proveito da posição ocupada em benefício próprio, de seus familiares ou de outras pessoas vinculadas.

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

A CAIXA Asset, na qualidade de subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL observa as regras e diretrizes da controladora no que se refere aos planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados.

A Política de Continuidade dos negócios da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL estabelece princípios e diretrizes norteadores da Gestão de Continuidade dos Negócios na CAIXA, visando assegurar a continuidade das atividades críticas na ocorrência de eventos que impossibilitem a utilização, parcial ou total, da infraestrutura operacional e de recursos de Tecnologia da Informação e Comunicações, no intuito de evitar que os prejuízos financeiros e os impactos negativos à imagem institucional atinjam níveis inaceitáveis.

A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL criou em 2004 o Programa de Continuidade dos Negócios – PCN CAIXA, aderente às melhores práticas de mercado e as regulamentações vigentes, para atuar frente às possíveis interrupções nos serviços prestados aos clientes, como fator fundamental para o sucesso de qualquer iniciativa de preservação ou recomposição da capacidade de realizar negócios.

O PCN CAIXA é um processo contínuo e evolutivo composto por cinco fases:

- a) Desenvolver a cultura em gestão de Continuidade de Negócios;
- b) Conhecer a instituição;
- c) Definir as estratégias de continuidade dos negócios;
- d) Desenvolver e implementar ações de respostas tempestivas às interrupções;
- e) Realizar testes, manutenção e revisão dos planos.

Sob a ótica do PCN CAIXA, as prioridades de continuidade e recuperação são determinadas pela Análise de Impacto nos Negócios – *Business Impact Analysis* – *BIA*, com objetivo de mensurar os impactos financeiros, operacionais, de imagem, e outros, decorrentes de uma interrupção nas atividades desempenhadas pelas unidades.

Adicionalmente, a CAIXA Asset possui um Plano de Resposta a Emergências, que tem por objetivo garantir a continuidade dos negócios em situações de contingência, tendo como principais pilares:

- Preparação de Planos para o pior cenário possível;
- Definição do Local para o ambiente alternativo;
- Ter os recursos necessários para o desenvolvimento das atividades críticas;

- Manutenção dos serviços essenciais;
- Manutenção em servidor de contingência, de Informações essenciais ao Desenvolvimento das atividades críticas e estratégicas.

No local alternativo, são efetuados testes periódicos, inclusive com a execução de atividades equivalentes às realizadas nas dependências regulares da CAIXA Asset, visando à manutenção de estrutura preventiva que possibilite o restabelecimento das atividades essenciais em situações emergenciais.

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

Conforme item 8.10, “c”, o gerenciamento do risco de liquidez utiliza práticas de maneira a evitar escassez de caixa e dificuldades em honrar os resgates solicitados, utilizando modelo baseado em histórico de aplicações e resgate e em índice de negociabilidade dos ativos no mercado secundário.

Além disso, é monitorada a concentração de volumes financeiros por prazo e por cotistas.

A metodologia de mensuração do risco de liquidez contempla projeção de fluxo de caixa baseado em histórico de entradas e saídas, classificação de liquidez que utiliza o histórico de negociação dos ativos no mercado secundário, prazo de cotização e acompanhamento de concentração de volumes por vencimentos, por prazo e por cotistas.

O limite de exposição ao risco de liquidez é definido considerando o perfil do passivo do fundo, o nível de exposição dos ativos alocados em carteira, os custos e despesas.

A aderência do modelo e dos parâmetros utilizados para cálculo do risco de liquidez é verificada pelo processo de *backtesting*, para a validação ou verificação da precisão do modelo de risco de liquidez adotado. O *backtesting* é efetuado no mínimo anualmente.

Para o monitoramento da liquidez dos fundos em cenários adversos, as carteiras dos Fundos são submetidas a testes de estresse periódicos que levam em consideração cenários estressados tanto para o ativo quanto para o passivo dos fundos.

Os cenários estressados são obtidos a partir de combinações dos piores cenários históricos para a liquidez dos ativos e para os resgates das carteiras e, também, das particularidades dos fundos.

Ainda conforme descrito acima no item 8.10, “c”, “O monitoramento dos riscos é realizado diariamente e está estruturado com linhas de reporte para assegurar a avaliação e gerenciamento dos níveis de riscos assumidos pelos fundos, conforme seu grau de comprometimento de limite. Os eventos de riscos estão estruturados em Nível I e Nível II”.

10.6. Descrever as políticas, as práticas e os controles internos para o cumprimento das normas específicas de que trata o inciso I do art. 33, caso decida atuar na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor

A atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento geridos pela CAIXA Asset é atualmente realizada preponderantemente pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL.

A CAIXA Asset pode atuar como distribuidora de títulos e valores mobiliários, inclusive 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. 16 da Resolução CVM n.º 21:

<https://www.caixa.gov.br/caixa-asset>

11. Contingências¹¹

11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, que sejam relevantes para os negócios da empresa, indicando:

a. principais fatos

Não há processos judiciais, administrativos ou arbitrais relevantes, relativos à administração de carteiras de valores mobiliários, que possam afetar a continuidade dos negócios ou a saúde financeira da CAIXA Asset.

b. valores, bens ou direitos envolvidos

Não se aplica, considerando o item “a” acima.

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

a. principais fatos

Não há.

b. valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

¹¹ A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.

11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores

Não foram localizadas outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores.

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

Dada a criação recente da CAIXA Asset, não há condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos em que a empresa tenha figurado no polo passivo.

b. valores, bens ou direitos envolvidos

Não se aplica, considerando o item “a” acima.

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**

Não há.

b. valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, informando sobre:

a. 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

b. 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

- c. impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa**
- d. inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito**
- e. inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado**
- f. títulos contra si levados a protesto**

Diretor responsável pela gestão de recursos

Nome: Álvaro Cunha Matos Lessa de Oliveira

Cargo: Diretor Executivo, em exercício, de Gestão de Fundos de Investimento da CAIXA Asset.

O diretor acima qualificado prestou as declarações adicionais (alíneas de “a” a “f”) contidas nesse item, conforme documento assinado e arquivado nas dependências da CAIXA Asset.

Declaração

Eu, Álvaro Cunha Matos Lessa de Oliveira, inscrito no CPF/MF sob nº. 326.638.608-67, Diretor Executivo em exercício da Diretoria de Gestão de Fundos de Investimento, na qualidade de diretor responsável pela Gestão de Recursos de Carteiras de Valores Mobiliários na CAIXA Asset perante a Comissão de Valores Mobiliários – CVM, declaro para os devidos fins que:

- a) revi o Formulário de Referência Pessoa Jurídica elaborado nos termos da Resolução CVM nº. 21/2021, que dispõe sobre o exercício profissional de administração de carteiras de valores mobiliários;
- b) o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela CAIXA Asset;
- c) não há contra mim 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;
- d) não fui condenado 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;
- e) não estou impedido de administrar meus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa;
- f) não estou incluído em cadastro de serviços de proteção ao crédito;
- g) não estou incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado;
- h) não há contra mim títulos levados a protesto;

São Paulo, na data da assinatura eletrônica.

Álvaro Cunha Matos Lessa De Oliveira

Diretor Executivo em exercício

Diretoria Gestão Fundos de Investimento

CAIXA Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.

Declaração

Eu, Gabriel Dutra Cardozo Vieira de Goes, inscrito no CPF/MF sob nº 310.563.998-56, Diretor-Presidente da CAIXA Asset na qualidade de diretor responsável pela gestão de riscos e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos da Caixa Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários perante a Comissão de Valores Mobiliários – CVM, declaro para os devidos fins que:

- a) revi o Formulário de Referência Pessoa Jurídica elaborado nos termos da Resolução CVM nº. 021/2021, que dispõe sobre o exercício profissional de administração de carteiras de valores mobiliários;
- b) o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela CAIXA Asset.

São Paulo, na data da assinatura eletrônica.

Gabriel Dutra Cardozo Vieira de Goes

Diretor-Presidente

CAIXA Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.



CERTIDÃO

Certifica-se que, nesta data, o (a) CAIXA DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A. (CNPJ 42.040.639/0001-40) encontra-se na situação **Autorizada em Atividade**, no segmento **Sociedade Distribuidora de TVM**, estando habilitada, nos termos da legislação em vigor, a praticar operações permitidas às instituições da espécie.

2. Certifica-se, ainda, que, quando da emissão desta certidão, constava em nossos cadastros que a instituição não se encontrava submetida a regime de administração especial temporária, de intervenção ou de liquidação extrajudicial por parte deste Banco Central.

3. Certidão emitida eletronicamente às 12:14:47 do dia 25/5/2023, com base na Lei nº 9.051, de 18 de maio de 1995. Para verificar a autenticidade deste documento acesse o endereço <https://www3.bcb.gov.br/certiaut/validar>.

Código de validação: Ma1LDlpAbMRqPe7RMUrN

Certidão emitida gratuitamente.

GERÊNCIA ADMINISTRATIVA EM SÃO PAULO

EXTRATO DE CONTRATO

Processo nº 197583. Contrato: Bacen/ADSPA-50528/2021. Objeto: Autorização para acessar o Sisbacen. Contratante: VR DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.. CNPJ 64.835.226/0001-95. Sem ônus. Vigência: indeterminado. Assinatura: 24/09/2021. Inexigibilidade de licitação por inviabilidade de competição. Base Legal: Art. 25, caput, da Lei nº 8.666/93.

GERÊNCIA ADMINISTRATIVA NO RIO DE JANEIRO

EXTRATO DE CONTRATO

Processo Eletrônico nº 98182. Contrato: Bacen/ADRIA- 50525/2021. Objeto: Autorização para acessar o Sisbacen. Contratante: Cooperativa de Economia e Crédito Mútuo dos Médicos e Categorias Afins - Unicred Niterói Ltda. CNPJ 01.090.027/0001-85. Sem ônus para o Banco Central. Vigência: indeterminada. Assinatura: 24.09.2021. Inexigibilidade de licitação por inviabilidade de competição. Base legal: Art. 25, caput, da Lei nº 8.666/1993.

ÁREA DE ORGANIZAÇÃO DO SISTEMA FINANCEIRO E DE RESOLUÇÃO
DEPARTAMENTO DE ORGANIZAÇÃO DO SISTEMA FINANCEIRO

AVISO

PROCESSO APROVADO PELO DEPARTAMENTO DE ORGANIZAÇÃO DO SISTEMA FINANCEIRO

179444 - CAIXA Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (CNPJ 42.040.639). Assunto: autorização para funcionamento, cuja constituição foi autorizada por despacho do Chefe do Deorf, de 3 de fevereiro de 2021; sede em São Paulo (SP); capital social de R\$50.000.000,00; controlador: Caixa Econômica Federal (Escritura Pública de Constituição de 14.4.2021; Escritura Pública de Retificação de 3.5.2021 e AGE de 20.9.2021). Decisão: Gerente-Técnico da GTSP1. Data: 23.9.2021.

CAROLINA PANCOTTO BOHRER
Chefe

AVISO DE RETIFICAÇÃO

No Diário Oficial nº 180, de 22.9.2021, seção 3, página 43, referente ao processo aprovado: PE 175657 - Mérito Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. (CNPJ 41.592.532), onde se lê: "cuja constituição foi autorizada pelo Gerente-Técnico da GTSP3, em 24.3.2021", leia-se: "cuja constituição foi autorizada pelo Chefe do Deorf, em 14.1.2021".

CAROLINA PANCOTTO BOHRER
Chefe

ÁREA DE POLÍTICA MONETÁRIA
DEPARTAMENTO DE OPERAÇÕES DO MERCADO ABERTO

COMUNICADO Nº 37.707, DE 23 DE SETEMBRO DE 2021

Divulga as condições de oferta pública para a realização de operações de swap para fins de rolagem do vencimento de 01/12/2021.

O Banco Central do Brasil, tendo em vista o disposto na Resolução CMN nº 2.939 de 26 de março de 2002, e na Resolução BCB nº 76, de 24 de fevereiro de 2021, torna público que, das 11:30 às 11:40 horas do dia 24 de setembro de 2021, acolherá propostas das instituições financeiras participantes do módulo Oferta Pública (Ofpub) para a realização de operações de swap a serem registradas na B3 - Brasil, Bolsa, Balcão S.A., nos termos do "Contrato de Swap Cambial com Ajuste Periódico Baseado em Operações Compromissadas de Um Dia - SCS" daquela bolsa, com as seguintes características:

Data de Início	Data de Vencimento	Posição assumida pelo Banco Central	Posição assumida pelas inst. financeiras	Quantidade de contratos
01/12/2021	01/02/2022	compradora	vendedora	até 15.000
01/12/2021	01/07/2022	compradora	vendedora	até 15.000

2. Serão aceitos no máximo até 15.000 (quinze mil) contratos a serem distribuídos a critério do Banco Central do Brasil, entre os vencimentos acima mencionados.

3. Na formulação das propostas, limitadas a 5 (cinco) por instituição, deverão ser informadas a quantidade de contratos e a respectiva taxa de juros representativa de cupom cambial, expressa como taxa linear anual, base 360 (trezentos e sessenta) dias corridos, com 3 (três) casas decimais.

4. Na apuração da presente oferta pública será utilizado o critério de preço único, acatando-se todas as propostas com taxa igual ou inferior à taxa máxima aceita pelo Banco Central do Brasil, a qual será aplicada a todas as propostas vencedoras.

5. O resultado desta oferta pública será divulgado após apuração realizada pelo Banco Central do Brasil.

6. Após a divulgação do resultado, o Banco Central do Brasil enviará à B3 a relação das instituições contempladas, a quantidade de contratos aceita para cada uma e a taxa de juros apurada no leilão.

7. Conforme previsto em ofício-circular da B3, as instituições que tiverem suas propostas aceitas deverão eleger uma corretora associada àquela bolsa para que proceda ao pré-registro das operações de swap de que se trata.

8. As pessoas físicas e as demais pessoas jurídicas poderão participar da oferta de que trata este comunicado, por intermédio das instituições referidas no parágrafo primeiro.

9. A presente oferta pública será realizada exclusivamente pelo módulo Ofpub, previsto no Regulamento do Sistema Especial de Liquidação e de Custódia (Selic).

COMUNICADO Nº 37.708, DE 23 DE SETEMBRO DE 2021

Divulga condições para a realização de operações compromissadas com instituições financeiras participantes do módulo Oferta Pública (Ofpub).

O Banco Central do Brasil, com base no disposto na Resolução nº 75, de 31 de dezembro de 1964, e no art. 1º da Circular nº 2.884, de 6 de maio de 1999, torna público que, das 12:00 às 12:30 horas do dia 24 de setembro de 2021, acolherá propostas das instituições financeiras participantes do módulo Ofpub para a realização de operações de venda de títulos públicos com compromisso de revenda assumido pela instituição financeira compradora, admitida a livre movimentação dos títulos, com as seguintes características:

I - títulos:

a) Letras do Tesouro Nacional (LTN): vencimentos em 1º/4/2022, 1º/7/2022, 1º/10/2022, 1º/1/2023, 1º/7/2023, 1º/1/2024, 1º/7/2024 e 1º/1/2025;

b) Notas do Tesouro Nacional, Série B (NTN-B): vencimentos em 15/8/2022, 15/5/2023, 15/8/2024, 15/5/2025, 15/8/2026, 15/8/2028, 15/8/2030, 15/5/2035, 15/8/2040, 15/5/2045, 15/8/2050 e 15/5/2055;

c) Notas do Tesouro Nacional, Série F (NTN-F): vencimentos em 1º/1/2023, 1º/1/2025, 1º/1/2027, 1º/1/2029 e 1º/1/2031; e

d) Letras Financeiras do Tesouro (LFT): vencimentos em 1º/3/2022, 1º/9/2022, 1º/3/2023, 1º/9/2023, 1º/9/2024, 1º/3/2025, 1º/3/2026, 1º/9/2026, 1º/3/2027 e 1º/9/2027.

II - valor financeiro máximo desta oferta: R\$ 4.000.000.000,00 (quatro bilhões de reais), observado que, de um mesmo título/vencimento, cada instituição financeira poderá adquirir, no máximo, 100% do valor de sua(s) proposta(s) aceita(s);

III - preços unitários de venda: os informados pelo Departamento de Operações do Mercado Aberto (Demab), às 11h30 de 24/9/2021, na página do Sistema Especial de Liquidação e de Custódia (Selic) na internet (www.selic.rtm);

IV - divulgação do resultado: 24/9/2021, a partir das 12h30;

V - data de liquidação da venda: 27/9/2021; e

VI - data de liquidação da revenda: 27/12/2021.

2. Na formulação das propostas, limitadas a 3 (três) por instituição, deverão ser informados o percentual, com 4 (quatro) casas decimais, a ser aplicado sobre o fator diário da taxa Selic deduzido de uma unidade e o valor financeiro, em milhares de reais.

3. As propostas deverão ter curso no módulo Ofpub/Ofdealer do Selic, opção "Lançamento" do submenu "Operações Compromissadas".

4. O resultado será apurado pelo critério de percentual único, acatando-se todas as propostas com percentual igual ou inferior ao percentual máximo aceito pelo Banco Central do Brasil, o qual será aplicado a todas as propostas vencedoras.

5. A instituição com proposta aceita deverá informar ao Demab, até as 16:00 horas de 24/9/2021, o vencimento e o valor financeiro de cada um dos títulos objeto de sua compra, utilizando o módulo "Lastro" do Selic.

6. O preço unitário da revenda será calculado com a seguinte fórmula:

$$n$$

$$PU_{revenda} = PU_{venda} \times P \{ [(fk - 1) \times S/100] + 1 \} - CJ1 \times P \{ [(fk - 1) \times$$

$$k=1$$

$$q$$

$$S/100+1 \} - CJ2 \times P \{ [(fk - 1) \times S/100+1 \}$$

$$k=1$$

em que:

I - PU_{revenda} corresponde ao preço unitário de revenda do título ao Banco Central do Brasil na data do compromisso, arredondado na oitava casa decimal;

II - PU_{venda} corresponde ao preço unitário de venda do título pelo Banco Central do Brasil, conforme definido no primeiro parágrafo, inciso III;

III - f corresponde ao fator diário da taxa Selic, divulgado pelo Banco Central do Brasil, relativo ao k-ésimo dia útil;

IV - S corresponde ao percentual definido no quarto parágrafo;

V - n corresponde ao número de dias úteis compreendidos entre a data de liquidação da venda, inclusive, e a data de liquidação da revenda, exclusive;

VI - CJ1 corresponde ao primeiro cupom de juros unitário pago pelo título durante a vigência do compromisso;

VII - m corresponde ao número de dias úteis compreendidos entre a data de pagamento do cupom de juros, inclusive, e a data de liquidação da revenda, exclusive;

VIII - CJ2 corresponde ao segundo cupom de juros unitário pago pelo título durante a vigência do compromisso;

IX - q corresponde ao número de dias úteis compreendidos entre a data de pagamento do segundo cupom de juros, inclusive, e a data de liquidação da revenda, exclusive; e

X - P corresponde ao produtório.

7. Não havendo pagamento de cupom de juros durante a vigência do compromisso, os valores "CJ1" e "CJ2" contidos na fórmula definida no sexto parágrafo serão iguais a zero.

8. As operações de que tratam este Comunicado devem ser registradas no Selic sob o código 1047.

ANDRE DE OLIVEIRA AMANTE
Chefe

COMUNICADO Nº 37.711, DE 24 DE SETEMBRO DE 2021

Divulga a Taxa Básica Financeira (TBF), o Redutor "R" e a Taxa Referencial (TR) relativos a 23 de setembro de 2021.

De acordo com o que determina a Resolução nº 4.624, de 18.1.2018, comunicamos que a Taxa Básica Financeira (TBF), o Redutor "R" e a Taxa Referencial (TR) relativos ao período de 23.9.2021 a 23.10.2021 são, respectivamente: 0,5218% (cinco mil, duzentos e dezoito décimos de milésimo por cento), 1,0062 (um inteiro e sessenta e dois décimos de milésimo) e 0,0000% (zero por cento).

ANDRE DE OLIVEIRA AMANTE
Chefe

COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS
SUPERINTENDÊNCIA ADMINISTRATIVO-FINANCEIRA
GERÊNCIA DE LICITAÇÕES E CONTRATOS

AVISO DE PENALIDADE

PROCESSO: 19957.000895/2021-44

A COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM TORNA PÚBLICA a aplicação à empresa KAIRÓS SERVIÇOS COMERCIAIS EIRELI-ME (CNPJ 23.349.536/0001-12) da penalidade de MULTA, conforme previsto nos itens 19.3.2.4 e 19.3.2.5. do Termo de Referência, por descumprimento da Cláusula Sétima (item 7.1) do Contrato CVM nº 20/2018 e do item 19.2.2 desse mesmo Termo de Referência, com fulcro no artigo 87 da Lei nº 8.666/93.

DARCY CARLOS DE SOUZA OLIVEIRA
Superintendente Administrativo-Financeiro

DIRETORIA DE AVALIAÇÃO DA CONFORMIDADE

EXTRATO DE COMPROMISSO

Espécie: Termo de Compromisso

Compromitente: REK INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE REBOQUES E ENGATES EIRELI-ME
CNPJ: 90.073.529/0001-28

Registro da Declaração do Fornecedor Número 030, de 05/06/2012, esta sendo renovado por um período de 18 (dezoito) meses a partir do dia 24/09/2021.

Renovação de Registro

Escopo: Fabricação de Dispositivo de Acoplamento Mecânico (Engate)

Marca/Modelo:

019/18 GOL V - EF125 (ANO DE APLICAÇÃO DE 2009 EM DIANTE)

023/18 COBALT - EF 113 {APLICAÇÃO TODOS MODELOS DO COBALT E PRISMA 2013 EM DIANTE}

024/18 UNO ATE 2003 - EF15 ATE 2003

020/19 STRADA 111 - EF354 (2005 EM DIANTE)

025/18 SAVEIRO V - EF92 (2009 em diante)

018/18 S10 STRONG - RS001 (2012 EM DIANTE)

Q21/18 MONTANA II - EF324 (2011 EM DIANTE)

043/19 COROLLA 2015 - EF369 (2015 À 2019)

050/19 TUCSON - EF43 (ATÉ 2017)

045/19 ONIX PLUS - EF478 (TODOS)

049/19 PÁLIO 111- EF210 (2016 EM DIANTE)



DADOS CADASTRAIS DE PREST. SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO DE CARTEIRAS

Não há fundo(s)
administrado(s) por este
administrador

Há fundo(s) gerido(s)
por este administrador

Também cadastrado
como:

DISTRIBUIDORAS

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

CNPJ : 42.040.639/0001-40

Denominação Comercial : CAIXA DTVM

Endereço : AV. PAULISTA, 2300/11º ANDAR CJ 112 E 114 - CERQUEIRA CESAR

Cidade : SÃO PAULO

UF : SP

CEP : 01310-300

DDD :

FAX : 0

DDD : 11

TEL : 3572-4600

DIRETOR GESTÃO DE CARTEIRA: JORGE LOUZADA KOZLOVSKY

Data de Registro : 31/08/2021

Situação : EM FUNCIONAMENTO NORMAL

Website : www.caixa.gov.br/caixadtvm

Categoria : Gestor de Carteira

[Fale com a CVM](#)

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

Razão Social

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

CNPJ

42.040.639/0001-40

Website

www.caixa.gov.br/caixa-asset

Códigos seguidos

Essa instituição segue **4 de nossos códigos**. Eles estabelecem regras de conduta que garantem a sustentabilidade do mercado e a segurança do investidor. Nossa equipe supervisiona o cumprimento dessas regras, aplicando sanções que necessário.

Confira abaixo os códigos seguidos por esta empresa:

CÓDIGO DE ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS DE TERCEIROS

Status de Adesão

Definitiva

Atividades desempenhadas no mercado

- Carteira Administrada
- Base de Dados
- Base de Dados – FIP
- Gestão

Selos que utiliza



CÓDIGO DE ÉTICA

Status de Adesão
Definitiva

CÓDIGO DOS PROCESSOS DA REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS

Status de Adesão
Definitiva

CÓDIGO PARA O PROGRAMA DE CERTIFICAÇÃO CONTINUADA

Status de Adesão
Definitiva

Atividades desempenhadas no mercado

- Gestão de recursos de terceiros

Participação

Essa instituição não participa de grupos.

Certificações

Essa instituição possui profissionais com **391 certificações ANBIMA**. Eles foram aprovados em nossos exames de certificação e possuem o conhecimento técnico necessário para atuar na distribuição de investimentos e/ou gestão de recursos de terceiros na instituição.

Confira abaixo a distribuição de profissionais certificados nesta empresa:

CPA-10

50

Profissionais vinculados

CPA-20

148

Profissionais vinculados

CEA

48

Profissionais vinculados

CFG

54

Profissionais vinculados

CGA

48

Profissionais vinculados

CGE

43

Profissionais vinculados

Orientações e penalidades

As instituições que participam da autorregulação são supervisionadas por nossa equipe para garantir que estejam seguindo as regras dos códigos aos quais são aderentes. Quando são encontradas irregularidades, elas podem receber orientações, multas ou outras penalidades, de acordo com a gravidade do caso.

Confira abaixo as orientações e penalidades recebidas pela instituição.

Termos de compromisso antecipado e Cartas de recomendação

Termo de compromisso antecipado

As instituições supervisionadas podem apresentar uma proposta para celebração de acordo antes da instauração de um PAI (Procedimento para Apuração de Irregularidades) ou de um processo.

No Termo de compromisso antecipado, a instituição se compromete antecipadamente a cessar e a corrigir atos que possam ter configurado descumprimento das regras previstas na autorregulação.

Carta de Recomendação Antecipada

A apuração gerou uma carta de recomendação, com orientação para correção dos problemas, que eram de fácil ajuste ou de baixo potencial de dano.

Essa instituição não tem nenhum termo de compromisso ou carta de recomendação registrado.

Multas

Utilizamos PAIs (Procedimento para Apuração de Irregularidades) e Processos para investigar descumprimentos dos nossos códigos de autorregulação e de ética. Essa apuração pode gerar termos de compromisso, cartas de recomendação ou julgamentos. Neste último caso, a instituição é julgada pelo Conselho de Regulação e Melhores Práticas.



São divulgadas as orientações e penalidades enviadas a partir de abril de 2016.

Essa instituição não tem nenhuma orientação e penalidade registrada.

Descumprimentos objetivos

Detalhes

As instituições devem seguir os procedimentos para envio de documentos e informações dentro dos prazos e formatos descritos em nossos códigos. Quando essas orientações são descumpridas, a instituição recebe uma carta de orientação. As multas são aplicadas quando há uma nova infração em período menor que 12 meses após o recebimento da carta.

Confira abaixo o consolidado de multas recebido pela instituição:

Essa instituição não tem nenhuma multa registrada.

- A ANBIMA
- Veja as vantagens de fazer parte
- Institucional
- Informar
- Representar
- Autorregular
- Educar

- SISTEMAS
- ANBIMA Data - Dados e Ferramentas de Investimentos
- Certificação
- Envio de Dados
- Guia de Publicidade
- SSM - Supervisão de Mercados

- MAIS
- Instagram
- Eventos
- Sala de Imprensa

Rio de Janeiro

Tel.: (21) 2104-9300

Praia de Botafogo, 501, bloco II, conj. 704 - Botafogo

Rio de Janeiro - RJ - CEP: 22250-911

[Como chegar](#)

São Paulo

Tel.: (11) 3471-4200 . Fax: (11) 3471-4230

Av. Doutora Ruth Cardoso, 8501,

21° andar conj. A - Pinheiros

São Paulo - SP - CEP: 05425-070

[Como chegar](#)

[Fale conosco](#)

[Regras de privacidade](#)

[Termos de uso](#)

[Proteção de dados](#)





► Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 3:

Resumos Profissionais

Gestor de Recursos de Terceiros (Pessoa Jurídica):

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES S.A.

Questionário preenchido por:

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES S.A.

Data:

Observações.:

- Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja pertinente ao profissional, este deve ser preenchido com "N/A".



Informações Gerais	
Nome	Vitor Hugo Falcão Marcondes Sodré
Email (opcional)	suget@caixa.gov.br
Data de Nascimento	06/07/1984
Experiência Profissional	
Instituição Atual	
Cargo	Superintendente Nacional da Superintendência Nacional de Gestão de Fundos Líquidos
Data em que assumiu cargo atual	14/10/2019
Data em que passou a fazer parte do atual departamento	25/01/2010
Data de entrada (mês/ano)	07/11/2005
Instituição 1	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 2	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 3	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 4	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 5	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Cargos ocupados em Entidades de Classe	
Entidade	ANBIMA - GESTÃO DE FUNDOS MÚTUOS
Cargo	Suplente
Período	Desde 05/11/2019
Entidade	
Cargo	
Período	
Formação	
Graduação	
Curso	Ciências Econômicas
Instituição	Mackenzie
Data da conclusão (mês/ano)	2008
Pós Graduação	
Curso	Finanças Corporativas e Investment Banking
Instituição	FIA - Fundação Instituto de Administração
Data da conclusão (mês/ano)	2010
Mestrado	
Curso	
Instituição	
Data da conclusão (mês/ano)	
Doutorado	
Curso	
Instituição	
Data da conclusão (mês/ano)	
Certificação profissional	
Título	CGA
Órgão Certificador	ANBIMA
Título	
Órgão Certificador	
Comentários adicionais	

Informações Gerais	
Nome	Mauricio Vendruscolo
Email (opcional)	gevar@caixa.gov.br
Data de Nascimento	27/07/1979
Experiência Profissional	
Instituição Atual	
Cargo	Gerente Nacional da Gerência Nacional Fundos de Renda Variável
Data em que assumiu cargo atual	02/02/2021
Data em que passou a fazer parte do atual departamento	02/02/2021
Data de entrada (mês/ano)	07/03/2005
Instituição 1	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 2	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 3	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 4	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 5	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Cargos ocupados em Entidades de Classe	
Entidade	
Cargo	
Período	
Entidade	
Cargo	
Período	
Formação	
Graduação	
Curso	Ciências Econômicas
Instituição	Universidade Presbiteriana Mackenzie
Data da conclusão (mês/ano)	dez/01
Pós Graduação	
Curso	Finanças Corporativas
Instituição	Universidade Presbiteriana Mackenzie
Data da conclusão (mês/ano)	dez/03
Pós Graduação	
Curso	Financial Economics
Instituição	Fundação Getúlio Vargas
Data da conclusão (mês/ano)	dez/09
Mestrado	
Curso	
Instituição	
Data da conclusão (mês/ano)	
Doutorado	
Curso	
Instituição	
Data da conclusão (mês/ano)	
Certificação profissional	
Título	CFA
Órgão Certificador	CFA Institute
Título	CGA
Órgão Certificador	ANBIMA
Comentários adicionais	

Informações Gerais	
Nome	CARLOS EDUARDO BITELI
Email (opcional)	gefix@caixa.gov.br
Data de Nascimento	27/05/1980
Experiência Profissional	
Instituição Atual	
Cargo	Gerente Nacional da Gerência Nacional de Fundos de Renda Fixa
Data em que assumiu cargo atual	02/02/2021
Data em que passou a fazer parte do atual departamento	02/03/2011
Data de entrada (mês/ano)	09/05/2005
Instituição 1	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 2	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 3	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 4	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 5	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Cargos ocupados em Entidades de Classe	
Entidade	ANBIMA
Cargo	Titular da Comissão Permanente de Precificação da ANBIMA
Período	desde fev/2021
Entidade	
Cargo	
Período	
Formação	
Graduação	
Curso	Engenharia de Materiais
Instituição	Escola Politécnica da USP
Data da conclusão (mês/ano)	dez/03
Pós Graduação	
Curso	Controladoria e Finanças
Instituição	ESAB
Data da conclusão (mês/ano)	dez/11
Mestrado	
Curso	
Instituição	
Data da conclusão (mês/ano)	
Doutorado	
Curso	
Instituição	
Data da conclusão (mês/ano)	
Certificação profissional	
Título	CGA - CERTIFICAÇÃO DE GESTORES
Órgão Certificador	ANBIMA
Título	
Órgão Certificador	
Comentários adicionais	

Informações Gerais	
Nome	Alvaro Cunha Matos Lessa de Oliveira
Email (opcional)	alvaro.m.oliveira@caixa.gov.br
Data de Nascimento	17/01/1984
Experiência Profissional	
Instituição Atual	
Cargo	Gerente Nacional da Gerencia Nacional de Fundos Estruturados
Data em que assumiu cargo atual	17/11/2020
Data em que passou a fazer parte do atual departamento	18/08/2008
Data de entrada (mês/ano)	09/02/2004
Instituição 1	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 2	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 3	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 4	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Instituição 5	
Nome	
Cargo	
Data de entrada (mês/ano)	
Data de saída (mês/ano)	
Cargos ocupados em Entidades de Classe	
Entidade	
Cargo	
Período	
Entidade	
Cargo	
Período	
Formação	
Graduação	
Curso	Administração de Empresas
Instituição	Univ Presbiteriana Mackenzie
Data da conclusão (mês/ano)	jun/07
Pós Graduação	
Curso	MBA em Gestão de Ativos Financeiros
Instituição	FGV/SP
Data da conclusão (mês/ano)	dez/10
Mestrado	
Curso	
Instituição	
Data da conclusão (mês/ano)	
Doutorado	
Curso	
Instituição	
Data da conclusão (mês/ano)	
Certificação profissional	
Título	CGA - Certificação Gestores ANBIMA
Órgão Certificador	ANBIMA
Título	Administrador de Carteiras
Órgão Certificador	CVM
Comentários adicionais	
Aprovação Level 1 do CFA Institute	

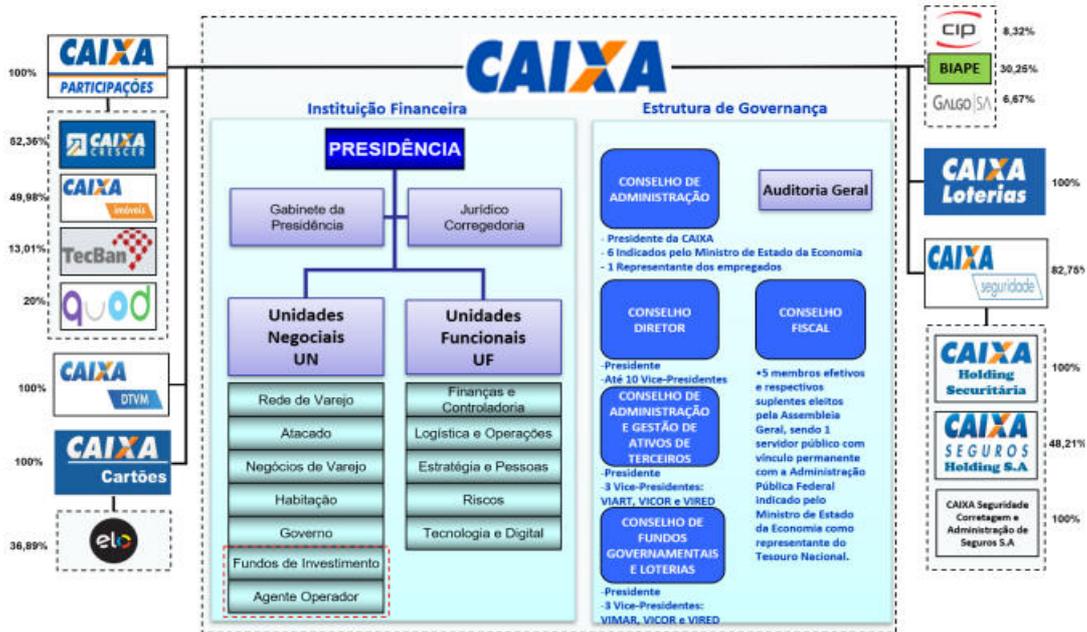
1. Informações cadastrais

1.1	Razão social	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES S.A.
1.2	Nome fantasia	CAIXA DTVM.
1.3	É instituição financeira ou instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil (“BCB”)?	A CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. (CAIXA DTVM) é subsidiária integral da Caixa Econômica Federal, instituição financeira constituída pelo Decreto-Lei nº 759, de 12 de agosto de 1969 e autorizada a funcionar pelo BCB conforme item 1.4.
1.4	Quais são as autoridades regulatórias em que a gestora possui registro? Fornecer detalhe sobre os registros, tais como nome, data e nº de registro da atividade.	CVM - Ato Declaratório CVM nº 19.043, de 31 de agosto de 2021. Banco Central do Brasil – BACEN, conforme decisão publicada no Diário Oficial da União de 27 de setembro de 2021.
1.5	Membro de associações de classe e/ou autorreguladoras? Quais?	Sim. A CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. (CAIXA DTVM) é membro da ANBIMA – Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiros e de Capitais.
1.6	É instituição nacional ou estrangeira?	Nacional.
1.7	Possui filial? Em caso positivo, quantas e onde estão localizadas?	N/A.
1.8	Endereço	Av. Paulista, 2300, 11º andar, Conjuntos 112 e 114, Bela Vista, São Paulo, SP, CEP 01310300.
1.9	CNPJ	42.040.639/0001-40.
1.10	Data de Constituição	14 de abril de 2021.
1.11	Telefones	(11)3572-4600
1.12	Website	https://www.caixa.gov.br/caixadtvm/
1.13	Nome e cargo do responsável pelo preenchimento do questionário	GERDI
1.14	Telefone para contato	(11)3572-4600
1.15	E-mail para contato	gerdi@caixa.gov.br

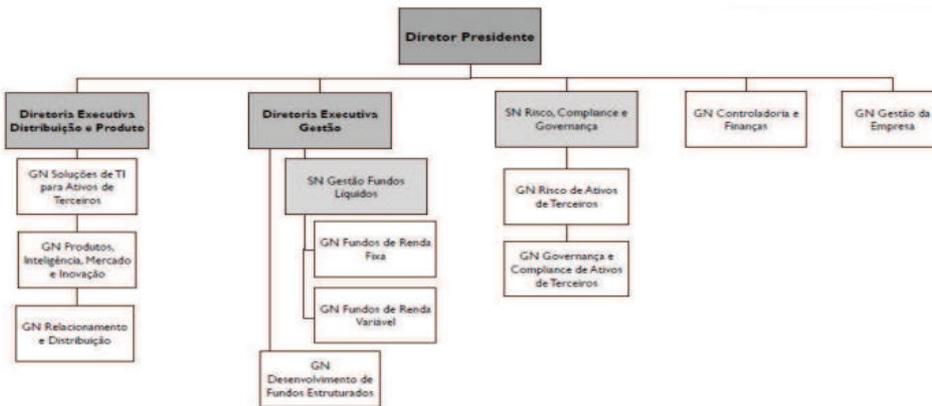
2. Informações institucionais

2.1	Informar o quadro societário da gestora, incluindo os nomes dos principais sócios e respectivas participações (informar no mínimo, os sócios que possuem percentual de participação acima de 5%).	A CAIXA DTVM é subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL. A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL é uma empresa 100% pública, controlada pelo Governo Federal.
------------	---	--

2.2 Qual a estrutura empresarial do conglomerado ou grupo econômico? (Quando aplicável).



2.3 Fornecer o organograma da gestora (anexar resumo profissional dos principais executivos).



2.4 A gestora é signatária dos Códigos de Regulação e Melhores Práticas da ANBIMA? Em caso afirmativo, citar o(s) Código(s).

Sim. A CAIXA DTVM é signatária dos seguintes Códigos da ANBIMA:
 Código ABVCAP/ANBIMA FIP e FIEE;
 Código de Administração de Recursos de Terceiros;
 Código de Ética;
 Código dos Processos da Regulação e Melhores Práticas;
 Código para o Programa de Certificação Continuada.

2.5 A gestora é signatária do Código de Ética da ANBIMA?

Sim.

2.6 A gestora é signatária do PRI – Principles for Responsible Investment?

N/A.

2.7	A gestora é signatária de outros Códigos ou assemelhados? Caso seja, citar as instituições.
N/A.	
2.8	Os principais executivos, conforme o item 2.3, detêm participação em outros negócios no mercado financeiro e de capitais ou atividades relacionadas à gestora? (Exceto no caso de participação em empresas ligadas). Em caso positivo, informar: I. CNPJ da empresa; II. percentual detido pelo executivo na empresa; e III. qual a atividade por ele desempenhada. III. qual a atividade por ele desempenhada.
N/A.	
2.9	Informar se o conglomerado ou grupo econômico da gestora presta serviços de administração fiduciária, distribuição, consultoria, controladoria e custódia. Em caso positivo, descrever: I. a estrutura funcional de segregação e II. o relacionamento com a gestora.
<p>Os serviços de administração fiduciária, distribuição de fundos de investimento e custódia e controladoria são exercidos dentro da estrutura da controladora, CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, conforme abaixo:</p> <p>ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA E CUSTÓDIA E CONTROLADORIA: A VIART (VP Fundos de Investimento) é responsável pelos serviços de administração fiduciária e de custódia e controladoria. Trata-se de uma Vice-presidência inserida na estrutura organizacional da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, que é segregada das demais e que não integra o Conselho Diretor, conforme artigo 13, § 4º e artigo 28 do Estatuto da CAIXA. Dentro da Vice-presidência, as duas atividades são segregadas por Gerências Nacionais, sendo a atividade de Administração Fiduciária exercida pela GN Administração Fiduciária (GEAFI) e as atividades de custódia e controladoria exercidas pela GN Serviços Qualificados (GESEQ).</p> <p>DISTRIBUIÇÃO: A distribuição de fundos de investimento é realizada pela controladora, por meio da sua rede de agências e conta com áreas especializadas no relacionamento e atendimento para nichos específicos.</p>	
2.10	Outras informações institucionais que a gestora julgue relevante (opcional).
N/A	

3. Receitas e dados financeiros

3.1	<p>Preencha a tabela abaixo com os valores correspondentes aos números da gestora. Informar os últimos 5 (cinco) anos. (OBS.: A CAIXA DTVM foi constituída em 14/04/2021 e se tornou operacional após aprovação do BCB em 27/09/2021. Os procedimentos de migração dos serviços de gestão de recursos dos veículos de investimento [fundos de investimento e carteiras administradas] de mercado foram iniciados. Os dados abaixo se referem à época em que os serviços desses veículos de investimento eram geridos no âmbito da controladora (CAIXA/VIART).</p> <p>* Foram considerados apenas os fundos migrados da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL para a CAIXA DTVM.</p> <p>** Valores com database de 30/11/2021</p>			
	Ano	Patrimônio sob gestão (posição em MM)**	Número de pessoas que trabalham na gestora	Número de portfólios sob gestão
	2021*	328.454.314.703,07	187	264
	Ano	Patrimônio sob gestão (posição em 31/Dez MM)	Número de pessoas que trabalham na gestora	Número de portfólios sob gestão
	2020	412.100,49	237	301
	2019	374.738,64	187	303
	2018	334.368,52	224	301
	2017	273.545,86	188	300
	2016	232.267,73	185	323
3.2	Tipologia dos portfólios sob gestão (sem dupla contagem – excluir estrutura Master Feeder).			
	Fundos	Nº	% Carteira	
	Domicílio local	355	100	
	Domicílio em outro país	N/A	N/A	
	Clubes de Investimento	Nº	% Carteira	
		N/A	N/A	
	Carteiras	Nº	% Carteira	
	Domicílio Local	12	100	
	Carteira de Investidor Não Residente	N/A	N/A	
3.3	Como os ativos sob gestão estão divididos conforme as seguintes categorias de fundos de investimento:			
	Tipo	Nº	Exclusivos/Reservados	% Total
	Renda Fixa	222	137	60,49%
	Multimercado	86	64	23,43%
	Cambial	2	1	0,54%
	Ações	39	3	10,63%
	FIDC	2	0	0,54%
	FIP	1	1	0,27%
	FIEE	0	0	0,00%
	FII	2	0	0,54%
	Fundo de Índice (ETF)	1	0	0,27%
Outras categorias	12	12	3,27%	
3.4	Atualmente, qual é o percentual do montante sob gestão que são originados especificamente de aplicações da própria gestora (incluindo controladores, coligadas, subsidiárias, seus sócios e principais executivos)?			
	N/A			

4. Recursos humanos

4.1	Quais são as regras de remuneração ou comissionamento dos profissionais e associados?
<p>Os funcionários recebem além da remuneração fixa, participação nos lucros e premiação em clubes de compras. A estrutura de remuneração fixa na CAIXA DTVM é baseada na designação de Função Gratificada, de forma que o funcionário no exercício do cargo faz jus ao recebimento de comissão efetiva. Caso o desempenho não seja satisfatório poderá ocorrer à dispensa do Cargo Comissionado retroagindo ao salário padrão.</p>	
4.2	Quais são os mecanismos de retenção de talentos usados pela gestora?
<p>O atual modelo de gestão de pessoas tem como objetivo consolidar uma cultura organizacional baseada na gestão proativa de talentos e por competência. A ideia é dar ênfase à meritocracia, à inovação, à alta eficiência e à melhoria contínua, promovendo identificação dos empregados com os valores e a missão da CAIXA DTVM, engajamento das lideranças e excelência no relacionamento com clientes e sociedade. Além dos diversos programas voltados à saúde e à segurança dos empregados, a Instituição busca integrar a educação corporativa à gestão do desempenho e das competências e à gestão do conhecimento, por meio de incentivos à capacitação, de criação e manutenção de sistemas e processos de disseminação do conhecimento e desenvolvimento de habilidades. Outro benefício que a Instituição oferece aos empregados é a possibilidade de complementar sua renda, após a aposentadoria, por meio de patrocínio a planos de benefício de previdência complementar, administrados pela Fundação dos Economistas Federais – FUNCEF. Por ser subsidiária da CAIXA, a CAIXA DTVM oferece estabilidade de emprego aos funcionários e um plano de carreira para cada função de interesse, com funções intermediárias que satisfaçam os funcionários em múltiplos níveis. Para algumas funções é oferecida a jornada de trabalho de 30 horas semanais de forma a respeitar e permitir o equilíbrio entre vida e trabalho. Atuando em todo território nacional e em diferenciados segmentos a CAIXA disponibiliza facilidades de transferência de funcionários entre departamentos e regiões.</p>	
4.3	Existe programa para treinamento, desenvolvimento e certificação profissional dos profissionais/associados? Descreva, de forma sucinta, inclusive, com relação ao controle e monitoramento dos profissionais certificados.
<p>Sim. No processo de formação de carreiras, a empresa oferece Universidade Corporativa com diversos cursos de aperfeiçoamento pessoal e corporativo, exige certificação qualificada, e disponibiliza verbas para cursos de atualização e aperfeiçoamento (Graduação, Pós-Graduação, Mestrado e Cursos de Idiomas).</p>	

4.4	De que forma o desempenho dos gestores é avaliado?
<p>Os gestores são avaliados essencialmente sob dois aspectos:</p> <p>(i) Desempenho absoluto dos fundos sob sua gestão – refere-se à comparação com seus respectivos benchmarks e rentabilidades alvo; e</p> <p>(ii) Desempenho relativo dos fundos sob sua gestão – refere-se à comparação com amostras de fundos concorrentes.</p> <p>Adicionalmente, devido à segmentação da gestão por células especialistas em cada mercado, individualmente os gestores possuem ainda objetivos financeiros para geração de alfa em seus mercados de atuação.</p>	
4.5	A instituição adota treinamento dos colaboradores e empregados em Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Financiamento ao Terrorismo (“PLDFT”)? Em caso positivo, descreva a metodologia e periodicidade aplicadas.
<p>Sim. Por meio de treinamento fornecido pela Universidade Corporativa com revalidação anual e acompanhamento pela área de Compliance da CAIXA DTVM.</p>	
4.6	Descreva os treinamentos elaborados junto aos colaboradores para prevenção e detecção de práticas ilícitas de trading (ex: front running, insider trading, spoofing etc.).
<p>A área de Compliance elabora e divulga regularmente materiais de orientação para os empregados acerca de temas relacionados a ética e conduta profissional.</p>	

5. Informações gerais

5.1	Existem planos de expansão ou mudança de estratégia? Descreva.
<p>A CAIXA DTVM pretende expandir sua estrutura para prestação dos serviços de gestão de ativos de terceiros. Os objetivos principais são sofisticar o portfólio de produtos, aperfeiçoar as decisões estratégicas, otimizar os processos internos através da implementação de novas tecnologias. Também consta a adoção de processos de melhorias na comunicação institucional e no desempenho dos produtos, de forma gerar mais valor à experiência dos clientes em relação aos fundos de investimentos.</p>	
5.2	Qual o limite para o crescimento dos ativos sob gestão suportado pela atual estrutura da gestora (instalações, profissionais hardware e software).
<p>Levando em consideração a atual estrutura, a expectativa é a de que o PL sob gestão de fundos seja de aproximadamente R\$ 730 bi em 2025.</p>	
5.3	A gestora é objeto de avaliação por agência de rating? Qual a nota atribuída? (Anexar relatório mais recente).
<p>A CAIXA DTVM foi constituída em 14/04/2021 e se tornou operacional após aprovação do BCB em 27/09/2021. Os procedimentos de migração dos serviços de gestão de recursos dos veículos de investimento (fundos de investimento e carteiras administradas) de mercado foram iniciados. Os dados abaixo se referem à época em que os serviços desses veículos de investimento eram geridos no âmbito da controladora (CAIXA/VIART). Nesse sentido o rating atualmente atribuído para a CAIXA/VIART será sucedido pela CAIXA DTVM.</p> <p>Fitch Ratings - Excelente.</p>	

5.4

Com base nos últimos 05 (cinco) anos, a gestora já recebeu alguma premiação por publicações ou entidades no que tange à qualidade e ao histórico de gestão? Quais?

Guia Exame 2010 - Melhor gestor de fundos de varejo e melhor gestor de fundos de renda fixa ativa.
Guia Exame 2011 - 2º melhor gestor de fundos de varejo e 3º melhor gestor de fundos de renda fixa ativa.
Star Ranking Valor Econômico 2013 – 22 fundos premiados, sendo o principal critério de avaliação a relação risco x retorno.
Revista Investidor Institucional - Os Melhores Fundos para Institucionais – Nov./2013– A CAIXA conquistou o topo do ranking com o maior número de fundos excelentes.
Star Ranking Valor Econômico 2014 – 22 fundos premiados, sendo o principal critério de avaliação a relação risco x retorno.
Revista Investidor Institucional – Top Asset – Mar./2014 – Presente no Ranking Top Asset em 18 categorias do ranking
Exame - Onde Investir em 2015 - Os Melhores Gestores – Nov./2014 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa
Revista Investidor Institucional – Top Asset – Mar./2015 – Presente no Ranking Top Asset em 20 categorias
Fundo FI CAIXA Brasil IDKA IPCA 2A RF LP destinado aos RPPS foi eleito pelo jornal Valor Econômico em matéria de 21/01/2015 como o melhor fundo de renda fixa em 2015.
Exame - Onde Investir em 2016 - Os Melhores Gestores – Dez./2015 - 2º Melhor Gestor de Fundos de Renda Fixa
Revista Investidor Institucional - Os Melhores Fundos para Institucionais – Abr./2016– A CAIXA conquistou o topo do ranking com oito fundos classificados como excelentes.
Premiada pelo Guia EXAME –Investimentos Pessoais – por 13 anos consecutivos (2004 – 2016) também, foi eleita uma das maiores gestoras de fundos de investimento do mercado pelo ranking Top Asset – AGO 17, realizado pela revista Investidor Institucional.
Conquistou a posição de maior gestora em duas categorias:

- Maior Gestor de FIPs;
- Maior Gestor de RPPS;

Prêmio MBI Melhor Banco para Investir – Melhor Gestor de Renda Fixa e Melhor Gestor de Ações – Fev./2018
Guia de Previdência Valor/Fundação Getúlio Vargas - 2º Melhor Gestor Geral e Melhor Gestor em Fundos Balanceados até 15 - edição 2018 do Guia de Previdência Valor/FGV;
Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional - Março/2018) - 5 Fundos Classificados como excelentes;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional - Agosto/2018) - 4 Fundos Classificados como excelentes;

Ranking Exame – Onde Investir 2019 - 2º Melhor Gestor de Varejo;

Prêmio MBI/FGV – Melhor Banco para Investir - 2ª melhor gestor em Fundos Money Market e 2ª melhor gestor de fundos multimercados FEV/19;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 312 – Março/2019) –9 Fundos classificados como excelentes;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 317 –Agosto/2019) – CAIXA no 2º lugar no Ranking de Gestores com 22 Fundos classificados como excelentes;

Guia de Previdência Valor/Fundação Getúlio Vargas – CAIXA como Gestora Destaque em Fundos Balanceados até 15 - Edição 2019

Ranking Exame – Onde Investir 2020 – 3º Melhor Gestor de Renda Fixa, 3º Melhor Gestor de Fundos DI e Curto Prazo e 3º Melhor Gestor de Fundos de Varejo;

Prêmio MBI/FGV – Melhor Banco para Investir - 1ª melhor gestor de fundos multimercados, 1ª melhor gestor de fundos de ações, 2ª melhor gestor em Fundos Money Market e 2ª melhor gestor em Fundos de Renda Fixa FEV/20;

Os Melhores Fundos para Institucionais (Revista Investidor Institucional – Edição 323 – Março/2020) – 10 Fundos classificados como excelentes.

Valor Investe – Julho/2020 -

A CAIXA teve 3 fundos de renda fixa listados pelo Valor Investe dentre os melhores do semestre. No grupo “Renda Fixa Ativa”: CAIXA FIC Brasil Gestão Estratégica RF e o CAIXA FIC Objetivo Prefixado RF LP. No grupo “Juro Real”: CAIXA FIC Foco Índice de Preços RF LP

Ratings Morningstar - Agosto/2020

CAIXA Alocação Macro FIC FIM LP considerado 5 estrelas no ranking

Premiação Valor – Agosto/Setembro/2020

Fundos CAIXA listados no Ranking do Guia de Fundos Valor entre os 10 fundos com melhor retorno do mercado: CAIXA FIC Alocação Macro Multimercado LP, CAIXA FIC Pré Objetivo RF LP, CAIXA FI Fidelidade RF LP, CAIXA FI Ações BDR nível I e CAIXA FI FIDELIDADE II Crédito Privado LP

Os Melhores Fundos Para Institucionais - Ranking – Revista Investidor Institucional – Agosto/Setembro

A CAIXA teve 16 fundos premiados como EXCELENTES pelo ranking “Os Melhores Fundos para Institucionais”, da revista Investidor Institucional em agosto/20.

Além do destaque positivo no Ranking Os Melhores Fundos Para Institucionais, a edição de setembro da publicação consolida a liderança CAIXA no segmento RPPS, através do Ranking TOP Asset.

6. Análise econômica, de pesquisa e de crédito

6.1	Descreva a estrutura de análise econômica, de pesquisa e de crédito da gestora, conforme segmento, quando aplicável (anexar resumo profissional).
<p>A CAIXA DTVM possui unidade exclusivamente dedicada à pesquisa econômica, setorial e quantitativa, diretamente ligada à Diretoria Gestão Fundos de Investimento (DITER), contando atualmente com uma equipe que totaliza 19 integrantes, sendo esta responsável pelo atendimento dos times de gestão, distribuição e risco.</p>	
6.2	A estrutura de análise econômica e de pesquisa inclui pesquisa de temas ASG – ambientais, sociais e de governança corporativa? Como estas questões são consideradas durante o processo de decisão de investimento? Descreva.
<p>Atualmente, a estrutura de análise econômica e pesquisa está em processo de integração dos fatores ASG aos modelos e processos utilizados na análise econômico-financeira de empresas (valuation). Encontra-se também em processo de estudo o desenvolvimento de estratégias sistemáticas levando em consideração os fatores ASG.</p>	
6.3	Descreva as principais mudanças na equipe de análise nos últimos 05 (cinco) anos.
<p>A equipe de análise e pesquisa passou por duas reestruturações nos anos de 2019, 2020 e 2021. Em 2019 a equipe teve aumento no número de integrantes, passando de 7 para 10 profissionais. Em 2020 foram recebidos três novos colaboradores, passando para 13. Em 2021, tivemos o último movimento de adequação do quadro de colaboradores, com o recebimento de 6 colaboradores, totalizando 19.</p>	
6.4	Utiliza research próprio ou de terceiros? Em que proporções?
<p>A unidade de pesquisa desenvolve o Research próprio, mas também temos acesso a Research externo. Toda a pesquisa relacionada à economia e ativos domésticos é feita internamente, embora, também tenhamos acesso à relatórios de terceiros.</p>	
6.5	Caso utilize research próprio, quais ferramentas de análise são utilizadas no processo decisório? Esta equipe trabalha exclusivamente para o <i>buy side</i> ou também produz relatórios e informações para outros (<i>sell side</i>)?
<p>No Research próprio, são desenvolvidas pesquisas e análises no âmbito macro, micro/setorial e quantitativo. Como ferramentas de análise são utilizados modelos de projeção de indicadores macroeconômicos para a fundamentação da análise da conjuntura doméstica e internacional, modelos financeiros e estatísticos utilizados para identificar oportunidades de mercado, seja no âmbito tático ou no estratégico, e modelos de análise econômico-financeira de empresas com o objetivo de balizar a expectativa de valor intrínseco. Estas atividades estão diretamente ligadas ao processo de investimento da gestão de fundos líquidos. A equipe tem dedicação exclusiva à CAIXA DTVM, sendo estritamente um Research de <i>buy side</i>.</p>	
6.6	Que serviços ou sistemas são contratados para apoio na análise?
<p>Para apoio a análise são contratados sistemas de monitoramento de mercados, acompanhamento de notícias em alta frequência, bancos de dados e consultoria. Dentre estes, destacamos: - Bloomberg, Broadcast, Valor Pro, Economática, FGV Dados e Monitor da Inflação da FGV.</p>	

7. Gestão de recursos

7.1 Descreva as principais mudanças na equipe de gestão nos últimos 05 (cinco) anos.

As principais mudanças na equipe de gestão foram: Foi designado como Diretor Executivo da Diretoria de Gestão de Fundos de Investimento (DITER), o Sr. Jorge Louzada Kozlovsky; Foi designado como Superintendente da Superintendência Nacional de Gestão de Fundos Líquidos (SUGET) o Sr. Vitor Hugo Falcao Marcondes Sodre; Foi designado como Gerente Nacional da Gerência Nacional Fundos de Renda Variável (GEVAR), o Sr. Mauricio Vendruscolo; Foi designado como Gerente Nacional da Gerência Nacional Fundos de Renda Fixa (GEFIX), o Sr. Carlos Eduardo Biteli.

7.2 Descreva procedimentos e/ou políticas formais de seleção e acompanhamento de fornecedores e/ou prestadores de serviço relacionados à atividade de gestão de recursos/distribuição, incluindo as corretoras.

Operações em Mercados de Bolsa

O processo de seleção é dividido em dois grupos: para corretoras que atuam nos Mercados BOVESPA e para corretoras que atuam nos Mercados BM&F. A cada semestre civil são selecionadas doze instituições para realizar operações nos Mercados BOVESPA e doze instituições realizar operações nos Mercados BM&F. As etapas do processo de seleção são as mesmas para ambos os grupos e destinadas respectivamente à verificação das informações cadastrais, análise de Gerenciamento de Risco, preenchimento do QDD ANBIMA Serviços Qualificados e Corretoras, análise qualitativa do departamento técnico e de pesquisa das corretoras/distribuidoras e avaliação interna da qualidade operacional dos serviços prestados no quadrimestre analisado.

Observação: para participar da seleção para operações nos Mercados BM&F, é obrigatório que as corretoras/distribuidoras possuam o selo Execution Broker B3 e ser associado ANBIMA ou ter aderido ao Código de Melhores Práticas e ao Código de Negociação de instrumentos Financeiros.

Operações em Mercado de Balcão

Estão habilitadas a realizar operações via Mercado de Balcão exclusivamente Instituições Intermediadoras que sejam membros da ANBIMA e corretoras/distribuidoras que possuam o selo Execution Broker e ser associado ANBIMA ou ter aderido ao Código de Melhores Práticas e ao Código de Negociação de instrumentos Financeiros e com adesão ao nosso contrato de Intermediação.

7.3 Descreva o processo de investimento.

O processo de investimento é dividido nas seguintes etapas:

- 1)Grandes Temas: apresentação do cenário macroeconômico pela Pesquisa ao time de Gestão, bem como das teses de investimento decorrentes do cenário prospectivo previsto. Contempla ainda a apresentação de temas relevantes e atualização do cenário para as empresas e setores acompanhados pelo time de pesquisa microeconômica.
- 2)Impacto nos Ativos: os times de Pesquisa e Gestão, conjuntamente e com base nas discussões dos Grandes Temas, discutem e definem os impactos esperados nos preços das diversas classes de ativos (câmbio, juros, bolsa etc.)
- 3)Proposição de estratégias: os gestores de portfólio e suas equipes elaboram estratégias propositivas para cada um dos mercados acompanhados (Juros e Inflação, Crédito Privado, Câmbio e Commodities, Equities), que serão submetidas ao Comitê de Investimento.
- 4)Comitê de Investimento: formado pelos membros mais seniores do time de Gestão, discute e aprova as estratégias propostas.
- 5)Execução das estratégias: os gestores de portfólio e suas equipes executam as estratégias aprovadas pelo Comitê de Investimento.
- 6)Acompanhamento de Resultados: os resultados dos fundos, decorrentes das estratégias implementadas, são avaliados em reuniões mensais de desempenho entre os gestores de portfólio e os heads dos times de Gestão.

7.4	Como é controlado o prazo médio dos títulos de fundos de longo prazo, para fins de sua classificação tributária?
<p>O prazo médio para fins de enquadramento e classificação tributária é controlado diariamente em sistema proprietário ou através de sites de bancos custodiantes. As operações para fins de ajuste de prazo médio são realizadas conforme necessário.</p>	
7.5	Descreva os critérios adotados para distribuição do envio de ordens entre as corretoras aprovadas, incluindo o limite de concentração de volume de operações por corretora, se houver.
<p>Nos mercados de Bovespa e BM&F, os volumes são divididos conforme classificação de nota da avaliação. Na divisão dos percentuais, sendo as 6 primeiras Research e as próximas 6 Discount:</p> <ul style="list-style-type: none">•10% do Limite para as cada uma 4 primeiras – 40% total;•8,25% do Limite para as próximas 4 – 33% total;•6,75% do limite para as outras 4 – 27% total; <p>O processo de seleção é semestral e a cada avaliação e são substituídas 2 corretoras Research e 2 corretoras Discount. No mercado de balcão, existe um limite máximo de 25% do total da corretagem paga no semestre.</p> <p>Uma vez que uma ordem é executada, é feito um primeiro batimento dos parâmetros da ordem com a contraparte de execução. Confirmados os parâmetros, um empregado realiza o registro dessa operação nos sistemas de custódia e um segundo empregado confere o registro e confirma o boletamento da operação (sistema de dupla conferência). No dia seguinte, é feita a conciliação entre a posição em carteira de cada fundo esperada pelo sistema de gerenciamento de ordens do Gestor (conforme operações realizadas no dia anterior) e o demonstrativo de patrimônio informado pelo custodiante. Caso sejam verificadas diferenças, são apuradas as causas e realizadas as correções, quando cabíveis.</p>	
7.6	Como são avaliados ativos no exterior, quando aplicável? Descrever como é realizado o controle e o processo de acompanhamento.
<p>Não são realizadas estratégias que envolvam aquisição de ativos no exterior.</p>	

8. Distribuição

8.1	<p>A gestora realiza distribuição dos fundos sob sua responsabilidade? Se sim, descreva os procedimentos adotados referentes aos processos de:</p> <ol style="list-style-type: none"> I. verificação dos produtos ao perfil do cliente (Suitability); II. conheça seu cliente (KYC); III. PLDFT; e IV. cadastro de cliente.
<p>Os fundos de investimento geridos pela CAIXA DTVM são distribuídos pelas Unidades de Negócio da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, representadas pelas Agências, Postos de Atendimento (PA) e Postos de Atendimento Eletrônicos (PAE), todas vinculadas diretamente às vice-presidências de Rede de Varejo, Atacado e Governo.</p> <p>A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL possui Política Institucional de relacionamento com clientes e usuários dos produtos e serviços fornecidos pela Instituição. Nessa política são estabelecidos princípios e diretrizes que norteiam o relacionamento com o cliente desde o seu primeiro atendimento na Caixa. O 9º PRINCÍPIO da política mencionada versa sobre a adequação de produtos, serviços e canais ao perfil do cliente e usuário. Abaixo segue o descritivo: Os produtos e serviços comercializados pela Caixa, assim como a sua estrutura de canais, guardam aderência com o perfil de seus clientes e usuários.</p> <p>DIRETRIZES:</p> <p>A CAIXA, no lançamento e manutenção do portfólio de produtos e serviços, considera:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Estratégias alinhadas ao perfil dos clientes e usuários; •Estratégias direcionadas aos parceiros comerciais e aos parceiros institucionais; •Os canais adequados; •Simplicidade nos processos de atendimento, pós-venda e reclamação; •Feedback dos clientes e usuários sobre os produtos e serviços. <p>A Caixa faz uso de instrumentos que auxiliam na identificação do perfil do cliente de modo a ofertar os produtos e serviços mais adequados às suas expectativas e necessidades.</p> <p>Na criação e comercialização dos produtos que integram seu portfólio, a Caixa atua com legítimo interesse na satisfação de seus clientes e alcance dos seus resultados estratégicos.</p> <p>A Caixa valoriza a experiência do cliente em todas as suas interações com a personalização nos relacionamentos.</p> <p>A política completa está disponível para consulta em: https://www.caixa.gov.br/Downloads/caixa-governanca/Politica_Relacionamento_Clientes_Usuarios_Produtos_Servicos_Caixa.pdf</p>	
<p>A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL também possui Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento do Terrorismo. Esta Política contempla os procedimentos de PLDFT no Relacionamento com o Cliente, conforme abaixo:</p> <ul style="list-style-type: none"> •A CAIXA adota procedimentos de "Conheça seu Cliente" desde a solicitação de início de relacionamento e durante todo o seu ciclo para evitar constituição ou manutenção de vínculos com pessoas com provável envolvimento em práticas de LDFT - Lavagem de Dinheiro e Financiamento ao Terrorismo. •Os procedimentos incluem a coleta, verificação, validação e atualização de informações cadastrais. •As informações relativas aos dados cadastrais de clientes são atualizadas com periodicidade definida a partir da análise da legislação vigente e de critérios de riscos estabelecidos pela Avaliação Interna de Risco. •A CAIXA classifica seus clientes em níveis de risco, considerando aspectos de PLDFT - Prevenção à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento do Terrorismo e adota tratamento diferenciado na condução dos negócios, conforme o risco relacionado. •Os dados relativos à capacidade financeira do cliente são coletados e validados de acordo com o perfil de risco do cliente e com a natureza da relação e da evolução dos negócios mantidos com a CAIXA. •A CAIXA não realiza negócios com Shell Banks (banco constituído em uma jurisdição sem qualquer presença física e que não se encontra integrado em um grupo financeiro regulamentado) e com pessoas relacionadas nas listas restritivas internacionais referentes à LDFT. •A CAIXA não admite a movimentação de recursos por meio de conta corrente anônima ou vinculada a titular(es) fictício(s). •A CAIXA realiza monitoramento das transações financeiras dos clientes de modo a capturar situações que possam apresentar indícios de LDFT e a comunicá-las ao órgão regulador, em conformidade com as regulações vigentes. •São adotadas medidas de caráter restritivo para o início e para manutenção de relacionamento com clientes em situações de possível envolvimento em práticas de LDFT. •A CAIXA adota procedimentos de especial atenção no monitoramento de clientes classificados como entes públicos, PEP - Pessoas Expostas Politicamente e em situações de impossibilidade de verificação do Beneficiário Final. <p>A política completa está disponível para consulta em: https://www.caixa.gov.br/Downloads/caixa-governanca/Politica-Prevencao-Lavagem-Dinheiro-e-Financiamento-Terrorismo.pdf</p>	

8.2	A gestora terceiriza alguma atividade relacionada à distribuição? Se sim, descreva as atividades, bem como o nome e o CNPJ do(s) terceiro(s) contratado(s).
N/A	
8.3	Como é feita a prospecção de clientes/distribuição de fundos? Detalhar o processo de captação realizado pela instituição. Exemplos: Indicação de clientes, prospecção. Qual o perfil dos clientes? (segmento e categoria do investidor). Exemplo: Varejo, Corporate, PJ, Investidor profissional, Qualificado?
A prospecção de clientes/distribuição de fundos é realizada pelas unidades de negócio pertencentes à estrutura organizacional da Instituição nos segmentos Varejo, Atacado e Governo e em consonância com as normas vigentes de regulação e autorregulação para Distribuidores de Fundos de Investimento.	
8.4	Descreva a estrutura operacional da gestora, voltada para a atividade de distribuição, incluindo sistemas de controle de movimentação (aplicação e resgate), critérios para execução das ordens e registro das solicitações, bem como o seu arquivamento e forma de proteção.
A GERDI - Gerência Nacional Relacionamento e Distribuição é a unidade responsável, dentro da estrutura operacional CAIXA DTVM, pelo suporte técnico às áreas negociais sobre fundos de investimento. As movimentações em fundos de investimentos (aplicações e resgates) são preponderantemente realizadas pelas unidades vinculadas às Redes de Varejo, Atacado e Governo da Instituição em sistemas informatizados e específicos para tal finalidade e aderentes às disposições da ICVM 555/14. Os arquivamentos seguem o disposto no Art.205 da Lei nº 10.406/2002	

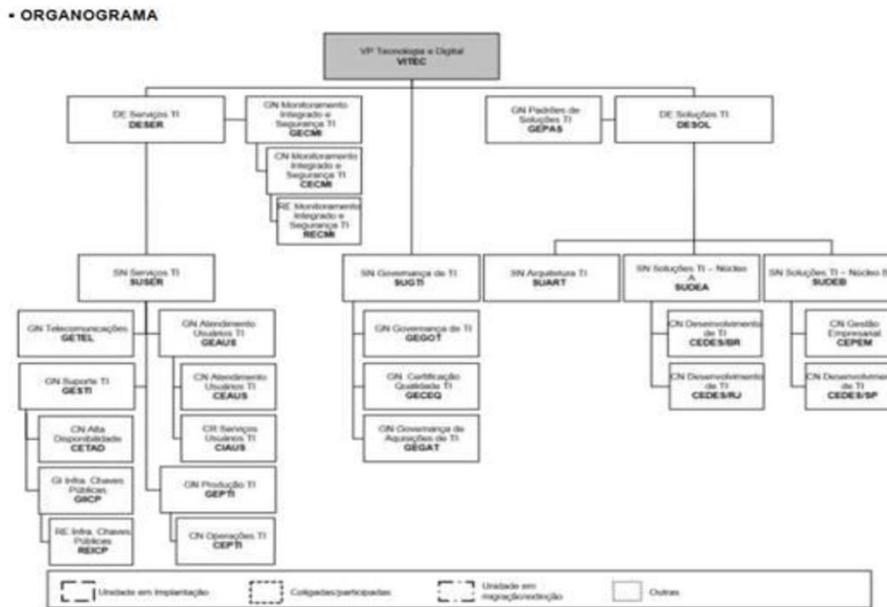
9. Risco

9.1	Descreva as principais mudanças na equipe de risco nos últimos 05 (cinco) anos.
<p>A unidade de riscos foi redimensionada em 2020, com integração de novos empregados com atuação dedicada, fortalecendo e aprimorando o gerenciamento de riscos para os ativos de terceiros na CAIXA DTVM.</p>	
9.2	Quais são os relatórios de riscos, com que frequência são gerados e o que contêm estes relatórios?
<p>Diariamente são elaborados e disponibilizados às áreas envolvidas relatórios de Risco de Mercado, Crédito e Liquidez com informações de nível de exposição aos riscos e comprometimento de limites de exposição para os Fundos de Investimento sob gestão da CAIXA DTVM. Mensalmente é apresentado nas instancias de governança e para a Alta Administração relatório consolidado do monitoramento realizado pela unidade de riscos para o Risco de crédito, mercado e liquidez.</p>	
9.3	Descreva como cada operação de crédito é analisada, aprovada e monitorada? Descreva a segregação entre as atividades.
<p>A análise de risco de crédito é realizada pela unidade de riscos de ativos de terceiros que, por estar segregada das unidades de negócios, possui independência e autonomia para o exercício de suas atividades, em observância ao regime de responsabilidades da Resolução CVM nº 21/21 e a estruturação de linhas de defesa da CAIXA DTVM. A equipe técnica responsável pela análise de risco de crédito, realiza a avaliação do emissor e/ou emissão e atribui nota de risco, utilizando-se de modelos internos para a mensuração do risco de crédito. O rating atribuído é homologado em decisão colegiada por equipe técnica e em níveis de alçada, conforme volume e/ou maior grau de risco. Todas as avaliações de risco de crédito de Emissor e de Emissão possuem prazo de validade, que visam promover a integridade dos resultados gerados pelos modelos e análises de risco de crédito e mitigação de riscos. O risco de crédito é reavaliado periodicamente em observância às normas estabelecidas pelos órgãos reguladores, contemplando a natureza, nível de risco, prazo, situação do contrato e relevância da operação.</p>	
9.4	Como são analisadas as garantias das operações e quais os critérios utilizados (análise de formalização, execução, etc)? Há reavaliação periódica da qualidade do crédito e de suas garantias? Qual sua periodicidade?
<p>A periodicidade da reavaliação de operações, e conseqüentemente as garantias e covenants que estão vinculadas a elas, segue orientação da CVM e obedece a diretrizes atreladas e proporcionais à qualidade de crédito e ocorre também quando do recebimento de informações que possam ser relevantes para a operação. A unidade de riscos monitora periodicamente as garantias e covenants da operação, e verifica se os controles realizados são adequados e eficazes, e caso sejam identificadas deficiências ou vulnerabilidades, são feitas recomendações para aperfeiçoamento dos mecanismos e ferramentas de controle das garantias.</p>	
9.5	As questões e riscos ASG – ambientais, sociais e de governança corporativa – são considerados na análise de risco de crédito? (Exemplos: perda de licença ambiental, corrupção, envolvimento em casos de trabalho escravo ou infantil, etc.).
<p>Sim, as questões de ASG são consideradas no processo de análise de risco de crédito realizada pela unidade de riscos.</p>	
9.6	A gestora, independentemente do critério de apreçamento, possui algum procedimento ou estratégia no caso da iminência ou ocorrência de eventos de inadimplência? Descreva.
<p>Sim, a unidade de riscos possui autonomia para suspender limites de alocação em ativos privados quando identificado aumento potencial do seu risco de crédito.</p>	

9.7

A instituição possui área de tecnologia da informação própria? Caso afirmativo, detalhar as atividades atuais, organograma e a qualificação dos profissionais.

A CAIXA DTVM utiliza a estrutura de tecnologia da informação da controladora, CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, conforme organograma abaixo:



As atividades atuais contemplam construção e manutenção de soluções de TI; arquitetura e padrões tecnológicos; soluções digitais para negócios; inovação tecnológica; arquitetura de projetos de TI; projetos de desenvolvimento e/ou aquisição de software; planejamento e gestão da capacidade das esteiras de desenvolvimento das soluções tecnológicas no âmbito de seu núcleo de atuação; relacionamento com as áreas para alinhamento de diretrizes e prioridades estratégicas, estruturação das necessidades em soluções tecnológicas e direcionamento do atendimento da TI; desenvolvimento e manutenção de soluções tecnológicas e digitais; desenvolvimento para as jornadas digitais desenhadas pelo negócio com foco na experiência dos clientes; desenvolvimento de aplicativos móveis e API. A qualificação dos profissionais determina nível elevado de conhecimento em atendimento as definições das áreas gestoras e as exigências consideram o perfil desejado (competências) e a função a ser exercida, contemplando desde cursos superiores a especialização com pós-graduação concluída em área de conhecimento aplicável na área de atuação.

9.8

Descreva os procedimentos de verificação de ordens executadas e de checagem das posições das carteiras.

Uma vez que uma ordem é executada, é feito um primeiro batimento dos parâmetros da ordem com a contraparte de execução. Confirmados os parâmetros, um empregado realiza o registro dessa operação nos sistemas de custódia e um segundo empregado confere o registro e confirma o boletamento da operação (sistema de dupla conferência). No dia seguinte, é feita a conciliação entre a posição em carteira de cada fundo esperada pelo sistema de gerenciamento de ordens do Gestor (conforme operações realizadas no dia anterior) e o demonstrativo de patrimônio informado pelo custodiante. Caso sejam verificadas diferenças, são apuradas as causas e realizadas as correções, quando cabíveis.

Cabe destacar ainda que o sistema de Front Office da Caixa DTVM, utilizado pelos gestores e operadores, é o sistema AIM (Asset and Investment Manager), fornecido pela Bloomberg. Este sistema tem como principal funcionalidade o módulo de gerenciamento de ordens (OMS - Ordem Management System) que permite o registro e a evolução da ordem desde a sua elaboração pela gestão até sua liquidação pelas custódias, passando pelo roteamento da ordem para contrapartes, acompanhamento de quantidades e preços de execução e distribuição conforme parâmetros preestabelecidos, com todas as informações de cada um destes processos registradas e passíveis de recuperação por função de trilha de auditoria. O sistema também conta com módulo de gerenciamento de posições, onde é feita a gestão dos portfólios, elaboração e acompanhamento de estratégias e simulação de cenários considerando operações e movimentos de mercado.

9.9 Existe sistema de gravação de ligações telefônicas? Em caso positivo, qual a política de escuta das gravações?

Sim, todos os operadores de mesa têm seus ramais telefônicos gravados. A escuta das gravações é realizada sempre que houver dúvida sobre o entendimento de conversas realizadas. O acesso às gravações é autorizado somente a gestores e pela área de Compliance.

9.10 Descreva os procedimentos de back-up e redundância de informações, desktops e servidores (para back-up, cite especificamente a periodicidade, local e prazo de armazenamento).

A Gestora conta com equipe destinada exclusivamente para a realização de back-up, com periodicidade diária de todos os documentos produzidos e inseridos no servidor da gestora. Esses documentos são armazenados em servidor alternativo por um período de 15 dias. As Informações e documentos imprescindíveis à realização das atividades são disponibilizadas também em servidor de contingência.

9.11 Descreva a política de controle de acesso ao Data Center (físico e lógico)

O acesso físico e lógico do Data Center da instituição é realizado apenas por empregados e colaboradores credenciados e autorizados, que atuam na área de Tecnologia da empresa.

9.12 Descreva o parque tecnológico atual da instituição. Citar no-breaks, capacidade dos servidores, links de internet e telefonia etc.

A capacidade de processamento e armazenamento do Parque Tecnológico da CAIXA é de:

- 8 mainframes (2 do modelo Z14 e 6 do modelo Z15)
- 390.612 MIPS (milhões de instruções por Segundo) no ambiente mainframe;
- 20.115 Terabytes de Armazenamento OPEN;
- 2.240 Terabytes de Armazenamento Mainframe;
- 811 servidores físicos de plataforma baixa;
- 17.358 servidores lógicos de plataforma baixa;
- 23 Servidores físicos de plataforma intermediária;
- 06 Silos Robóticos;
- 07 Virtual Storage Manager (VSM);
- 4.969 Roteadores;
- 638 Switches (Centralizado).
- 4 circuitos de internet de 10Gbps com dupla abordagem

9.13 A gestora possui filtro de e-mail, firewall e sistemas de antivírus?

Sim.

9.14 São realizados testes periódicos para verificação de segurança e integridade de sistemas? Com que frequência?

Sim, a frequência de realização dos testes para verificação de segurança e integridade de sistemas é de no mínimo de 02 (duas) vezes ao ano, com a participação das áreas envolvidas executando as atividades críticas da unidade e documentando os testes realizados.

10. Compliance e controles internos

10.1	A gestora adota procedimentos de monitoramento contínuo das regulamentações e autorregulamentação aplicáveis ao seu segmento de atuação com execução de ações preventivas e corretivas? Em caso positivo, descreva os procedimentos adotados.
<p>Sim. Diariamente a área de Compliance acessa diversas fontes de informação e sites de reguladores e autorreguladores (CVM, BACEN, ANBIMA, DOU, PREVIC, entre outras) e realiza buscas por novas normas e divulgações além de consultas a palavras-chave relacionadas aos mandatos exercidos pelas unidades, divulgando oportunamente para cada unidade. Além disso, o Compliance acompanha as ações de aprimoramento e/ou ajustes nas atividades, processos e formalização dos procedimentos em normas internas. Caso seja constatada ausência de aplicação de norma por determinada unidade o Compliance fará o enforcement e orientará abertura de plano de ação a ser monitorado até sua conclusão.</p>	
10.2	Descreva os procedimentos adotados pela gestora para controlar a faixa de preços dos ativos e valores mobiliários negociados para os fundos de investimento sob sua gestão.
<p>O Compliance monitora, semanalmente, as operações realizadas pelos fundos de investimento e carteiras administradas, realizadas pelo Gestor através de sistema de front-office utilizando os respectivos registros das operações nos Custodiantes, no qual é verificado se as taxas e os preços negociados correspondem ao praticado no mercado.</p> <p>Em caso de negociações efetuadas fora do túnel de preços, o gestor é questionado sobre a ocorrência e deve encaminhar esclarecimento sobre o apontamento.</p>	
10.3	Descreva o processo para adesão ao Código de Ética e Conduta, bem como suas atualizações, pelas profissionais que trabalham na gestora.
<p>O processo de assinatura e adesão aos Códigos de Ética e de Conduta da CAIXA DTVM são feitos por meio de plataforma SAP, com controle de validade das assinaturas (necessária renovação anual). Além disso todos os novos empregados da gestora são alertados sobre os procedimentos a serem adotados e as regras de Compliance para todos os empregados.</p>	
10.4	Descreva como é realizado o monitoramento da política de investimentos pessoais.
<p>As Diretrizes de Investimento Pessoal são parte integrante do Código de Conduta dos empregados da CAIXA DTVM. Trimestralmente a unidade de Compliance monitora a aderência de tais diretrizes. A identificação de descumprimentos às Diretrizes pode ensejar a aplicação de medidas disciplinares, sem prejuízo das sanções administrativas ou criminais que, no caso, também possam decorrer das atitudes de descumprimento.</p>	
10.5	Existe fundo ou outro instrumento de investimento exclusivo para sócios e executivos da gestora?
<p>Não.</p>	

10.6 Descreva os procedimentos de monitoramento implementados para prevenção e detecção de práticas ilícitas de trading (ex: front running, insider trading, spoofing etc.).

O processo de investimento e negociação de ativos seguem o Regulamento ou mandatos dos produtos de investimento e as estratégias de alocação a serem adotadas são aprovadas em instâncias de governança internas que contam com a participação ativa da unidade de Compliance, seja pela emissão de Pareceres prévios à reunião ou pela manifestação durante as reuniões. As rotinas de monitoramento e acompanhamento das operações com regularidade, objetiva identificar possíveis ilícitos de trading, além de monitorar e acompanhar o limite de alçadas estabelecido por operador. Além disso as ações de aculturação e disseminação do Código de Conduta visam reforçar que não serão aceitas ou toleradas quaisquer operações que deturpem a livre formação dos preços ou provoquem, em benefício próprio ou alheio, um comportamento artificial das cotações. Os empregados e dirigentes não deverão se valer, em proveito próprio ou de terceiros, de informação privilegiada ou antecipada, ainda que após seu desligamento do cargo ou função.

10.7 Descreva os procedimentos adotados para PLDFT no processo de seleção e alocação e monitoramento na negociação de ativos.

Realiza diligência de identificação das contrapartes e emissores envolvidos em negociações de ativos financeiros com os fundos sob gestão. Adoção de procedimentos “Conheça o Histórico do Preço” quando da realização de investimento, com o objetivo de controlar e monitorar a faixa de preços dos ativos e valores mobiliários negociados para os fundos, de modo que eventuais operações fora dos padrões praticados pelo mercado sejam identificadas.

Para operações de Crédito Privado nos mercados primário e secundário realiza são analisadas informações com relação aos negócios realizados, tais quais: emissor do ativo, (coobrigados (se houver), garantias (se houver), fluxo e probabilidade de default (PDD) ou equivalência do rating interno do gestor com os ratings das agências classificadoras de risco de crédito, rating do ativo ou do emissor fornecido por agência classificadora de risco (se houver), classificação de risco interna do gestor; taxa negociada; solicitação e análise das informações produzidas pelo gestor que fundamentam a operação; documentos integrantes da operação ou a ela acessórios e, nas operações com garantia real ou fidejussória, à descrição das condições aplicáveis ao seu acesso e execução.

Caso sejam identificadas operações ou propostas que contenham indícios de práticas de ilícitos ou que apresentem atipicidade, conforme situações citadas, deverá comunicar o Compliance e a unidade de PLD da controladora.

10.8	Caso a gestora desenvolva outras atividades, descreva sua política de chinese wall, informando como se dá a proteção de informações entre departamentos e os potenciais conflitos de interesse advindos das diferentes atividades.
A CAIXA DTVM presta atualmente somente os serviços de gestão de Fundos de Investimento.	
10.9	Descreva as regras e procedimentos de monitoramento das operações realizadas fora de plataformas eletrônicas de negociação, enfatizando estabelecimento de preços e fontes de referência utilizadas.
<p>São considerados pelos gestores para precificação de operações realizadas em mercados de balcão minimamente os seguintes aspectos:</p> <ol style="list-style-type: none">1.preços de marcação e intervalo indicativo do fechamento do dia anterior para o ativo em questão ou ativos com maturidade próxima;2.existência de spreads para o ativo em questão, ou ativos com maturidade próxima, em outros bancos, corretoras ou plataformas de negociação;3.existência de spreads em ativos ou derivativos de referência, como contratos futuros de juros, que possam balizar a escolha de preço para as ordens de títulos públicos a serem emitidas.4.ratings emitidos internamente ou por agências de risco para títulos de crédito privado;5.nível de taxa de emissão primária por parte das instituições financeiras;6.nível de taxa de emissão primária e mercado secundário para títulos de empresas não financeiras. <p>Por fim, as operações realizadas por fundos em mercados de balcão são verificadas diariamente pela área de Compliance, que compara os preços negociados com o túnel de preços da ANBIMA</p>	
10.10	Como é verificado a adesão dos limites de risco, limites legais ou regulamentares das posições dos fundos sob gestão da gestora? A gestora utiliza algum agente externo? (Ex.: consultoria)
<p>A equipe de Compliance monitora os limites legais e regulamentares pela plataforma de front-office e acompanha desenquadramentos e respectivos planos de ação. A CAIXA DTVM possui uma área de risco que tem como principal atividade o controle, monitoramento e gerenciamento dos riscos dos fundos de investimento sob sua administração. Os parâmetros para cálculo do risco de mercado, crédito e liquidez, bem como os procedimentos a serem adotados no processo de gerenciamento de risco são submetidos para aprovação pelo Comitê de Risco. A política de risco é compreendida pelos princípios gerais, e diretrizes específicas de ações relativas ao risco. Também determina os processos operacionais mais importantes, limites, objetivos de performance baseados no risco e os procedimentos para o gerenciamento de risco. Quaisquer extrapolações dos limites definidos geram alertas os quais são reportados e avaliados pelo Comitê de Risco que conta com a participação de representante do Compliance.</p>	

10.11 Descreva como são tratados os conflitos de interesse resultantes da participação ou atuação dos sócios ou executivos em

A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL - controladora integral da CAIXA DTVM - é uma instituição financeira sob a forma de empresa pública, que exerce um papel fundamental no desenvolvimento urbano e da justiça social do país, vez que prioriza setores como habitação, saneamento básico, infraestrutura e principal operador dos programas sociais do governo federal como Seguro Desemprego e Bolsa Família, contribuindo significativamente para melhorar a vida das pessoas, principalmente as de baixa renda.

A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL apoia inúmeras atividades artísticas culturais, educacionais e desportiva e oferece uma extensa gama de serviços bancários e financeiros: depósito e captações de recursos, poupança, cartões, crédito e financiamento habitacional, seguros, previdência privada, penhor, financiamento estudantil, capitalização, consórcio, serviços para o poder judiciário, crédito rural, conectividade social, FGTS, comércio exterior dentre outros.

Dentro da estrutura organizacional da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL há ainda, uma vice-presidência (VP Fundos de Investimento/VIART) segregada das demais e que não integra o Conselho Diretor, conforme artigo 13, § 4º e artigo 28 do Estatuto da CAIXA. A VIART é responsável pelos serviços de administração fiduciária, inclusive para os fundos geridos pela CAIXA DTVM e pela gestão de carteiras em fundos de investimento e carteiras administradas exclusivamente com recursos do FGTS. O estatuto da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL prevê a existência do Conselho de Administração e Gestão de Ativos de Terceiros, órgão colegiado deliberativo, responsável pela gestão e representação da CAIXA quanto às atividades VIART.

Dessa forma, eventuais situações de conflito de interesse relacionadas às demais atividades desempenhadas pela instituição são mitigadas por meio de segregação física, tecnológica e organização das companhias, bem como pelas estruturas de governança que contam com comitês segregados, assegurando que a tomada de decisão ocorra de forma colegiada e independente. Não obstante a CAIXA DTVM possui igualmente estrutura de governança apartada e órgãos estatutários próprios – Conselho de Administração, Conselho Fiscal e Comitê de Riscos e Capital dedicados unicamente às atividades da companhia – além de estrutura de comitês internos próprios e que não são compartilhadas com a CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, sua controladora.

Por fim, a Política de Controle Interno, Compliance e Integridade, a Política de Relacionamento com Clientes e Usuários de Produtos e Serviços e Código de Ética, Código de Conduta de Empregados e Dirigentes da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, além do Conduta dos Empregados da CAIXA DTVM dispõem sobre situações de potenciais conflitos de interesse.

10.12 A gestora recebe comissões/remuneração (rebate) pela alocação em ativos e valores financeiros? Quais as regras?

Não.

11. Jurídico

11.1 Descreva como são tratadas as questões jurídicas e legais da gestora (departamento jurídico próprio ou consultoria de terceiros).

As questões jurídicas e legais da empresa são tratadas por um departamento jurídico compartilhado com Controladora e especialmente dedicado às questões da(s) subsidiária(s).

12. Anexos ou endereço eletrônico

		Anexo ou link
12.1	Resumo profissional dos responsáveis pelas áreas e equipe de gestão	Link de acesso
12.2	Manual de apreçamento	Link de acesso
12.3	Código de ética e conduta	Link de acesso
12.4	Manual/Política de Exercício de Direito de Voto (Proxy Voting)	Link de acesso
12.5	Relatório de Rating	Link de acesso
12.6	Manual/Política de Liquidez	Link de acesso
12.7	Manual/Política de Suitability (caso a gestora realize distribuição de cotas dos fundos geridos)	N/A
12.8	Formulário de referência	Link de acesso
12.9	Manual/Política de controles internos e compliance	Link de acesso
12.10	Manual/Política de gestão de risco	Link de acesso
12.11	Manual/Política de investimentos pessoais	Link de acesso
12.12	Manual/Política de rateio e divisão de ordens entre as carteiras de valores mobiliários	Link de acesso
12.13	Manual/Política de segurança de informação	Link de acesso
12.14	Manual/Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro	Link de acesso
12.15	Manual/Política de KYC	N/A
12.16	Manual/Política que tratem da troca de informações entre a atividade de distribuição realizada pela gestora e os administradores fiduciários	N/A
12.17	Manual/Política de Responsabilidade Socioambiental	Link de acesso
12.18	Manual/Política de seleção e contratação de terceiros	N/A
12.19	Lista das corretoras aprovadas (se houver)	N/A

[ASSINATURA DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O
QUESTIONÁRIO]

[NOME DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O QUESTIONÁRIO]

[CARGO]

[TELEFONE]

[E-MAIL CORPORATIVO]

[ASSINATURA DO(S) REPRESENTANTE(S) LEGAL(IS) DA
INSTITUIÇÃO]

[NOME DO(S) REPRESENTANTE(S) LEGAL(IS) DA INSTITUIÇÃO]

[CARGO]

[TELEFONE]

[E-MAIL CORPORATIVO]

29 JUL 2022

Fitch Afirma Rating de Qualidade de Gestão de Investimentos 'Excelente' da Caixa DTVM

Fitch Ratings - São Paulo - 29 Jul 2022: A Fitch Ratings afirmou, hoje, o Rating de Qualidade de Gestão de Investimentos 'Excelente' da Caixa Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (Caixa DTVM). A Perspectiva do rating é Estável.

A Caixa DTVM é uma recém-formada subsidiária integral da Caixa Econômica Federal (Caixa, IDRs – Issuer Default Ratings – Ratings de Inadimplência do Emissor – de Longo Prazo BB-, Perspectiva Estável e Rating Nacional de Longo Prazo AA(bra), Perspectiva Estável). Em setembro de 2021, o banco transferiu à nova gestora 73% dos ativos sob gestão (AUM) da Vice-Presidência de Fundos de Investimento (Viart), o equivalente a BRL437 bilhões. A Viart manteve os recursos pertencentes ao Fundo de Garantia do Tempo de Serviço (FGTS), que somam BRL161 bilhões. Por lei, os ativos do FGTS devem ser gerido diretamente pela Caixa. A reorganização também incluiu transferência da maioria dos funcionários da Viart para a nova subsidiária, bem como todos seus sistemas, políticas e procedimentos.

O rating da Caixa DTVM considera apenas as atividades da gestora no mercado local, excluindo os recursos do FGTS, que continuam sob gestão da Viart, um departamento da Caixa. O rating também não considera os fundos de investimento em direitos creditórios (FIDCs) e os fundos de investimento em participações (FIPs), que têm processos e políticas próprios e são segregados da gestão de fundos tradicionais.

PRINCIPAIS FUNDAMENTOS DO RATING

O rating 'Excelente' da Caixa DTVM reflete a opinião da Fitch de que a gestora tem capacidade de investimento e características operacionais muito fortes em relação às suas estratégias de investimento, que consistem amplamente em estratégias conservadoras de renda fixa.

O rating também considera o bem disciplinado processo de investimento, a estrutura organizacional bem segmentada e robusta, a equipe experiente e qualificada, além de sólidos recursos tecnológicos. Também incorpora o fato de que a gestora integra o conglomerado financeiro Caixa, terceiro maior conglomerado financeiro brasileiro por ativos, caracterizado por forte franquia, significativa presença de mercado e ampla base de clientes, além das sólidas estruturas de gestão de riscos da gestora e do grupo.

Excluindo os recursos do FGTS, o AUM aumentou 7,4% em 2021 e 7,0% em 2020, menos que o da indústria (14% e 11%, respectivamente). O crescimento ocorreu principalmente em entidades públicas, fundos de pensão abertos e segmento de middle market.

Os principais desafios da gestora são manter o desenvolvimento e a diversificação em estratégias de maior valor agregado ao mesmo tempo em que desenvolve proporcionalmente as capacidades de sua equipe de investimento, além de ampliar a cobertura do universo de investimentos pela área de pesquisa.

O rating 'Excelente' baseia-se nas seguintes avaliações:

Processo de Investimento: Excelente

Recursos de Investimento: Excelente

Gestão de Risco: Excelente

Desempenho dos Investimentos: Consistente

Companhia & Atendimento a Clientes: Excelente

Processo de Investimento

O processo de investimentos é bem estabelecido e disciplinado, sem alterações no processo desenvolvido na Viart. É baseado em comitês e abordagem top-down para as estratégias de renda fixa, que são complementadas por análises abrangentes de empresas para os fundos de crédito privado e de renda variável, apesar do relativamente baixo número de instituições analisadas. A gestora tem ampla experiência de gestão em diferentes estratégias e carteiras e possui um robusto conjunto de controles, mas concentra suas operações em fundos money market e de renda fixa. Conta com relatórios de atribuição de desempenho e de risco que permitem aos gestores avaliar se as carteiras estão em conformidade com as políticas de investimento, aprender com os erros e ajustar o processo de investimento.

Recursos de Investimentos

A Caixa DTVM tem uma estrutura organizacional bem robusta e segregada, com transparência nas responsabilidades e nos controles, e forte segmentação entre as áreas do grupo. A estrutura organizacional da Viart foi fortalecida em 2020 para a criação da Caixa DTVM, atingindo 256 profissionais em junho de 2020, de 215 em 2019. A estrutura da Caixa DTVM recebeu cerca de 180 profissionais, sem alterações na equipe de investimento de fundos tradicionais, que manteve aproximadamente 40 funcionários. A equipe de gestão é experiente e se beneficia da estabilidade de seus profissionais, a maioria dos quais com mais de 15 anos na empresa. Desde 2019, a rotatividade tem aumentado, já que várias mudanças ocorreram em posições elevadas, incluindo as de CEO (duas vezes), CIO e CRO, mas a maioria das substituições foi feita com profissionais do grupo, sem impacto nas atividades e na estratégia da gestora. As áreas de risco e compliance são segregadas e reportam-se ao CEO da gestora. As áreas de auditoria interna e o departamento jurídico são corporativos e se reportam ao CEO e ao comitê executivo do grupo.

O sistema de front-office foi finalizado para os fundos de renda variável em 2019 e, para os demais, no primeiro semestre de 2020. O sistema, um dos melhores do mercado local, é bem completo,

automatizado e integrado e tem resultado em melhores controles e eficiência. A gestora utiliza bases de dados, infraestrutura e plataformas robustas e dispõe de grande volume de dados, sendo beneficiada por fazer parte de um grande conglomerado. As áreas de middle e back office reconciliam todo o processo operacional, com procedimentos padronizados e integrados.

Gestão de Risco

A gestora é supervisionada por diversas entidades externas, como os reguladores brasileiros. Além disso, as áreas de risco e de compliance possuem fortes controles e se reportam ao CEO da gestora e indiretamente às áreas de risco e compliance da Caixa. Possui uma estrutura completa de políticas, comitês e controles com estruturas independentes. Sua cultura de risco é conservadora, com limites de risco de mercado, crédito e de liquidez bem estabelecidos e estreita supervisão dos principais executivos. A liquidez dos fundos tem sido ampla, visto que a maioria do AUM é investida em títulos soberanos, que são os instrumentos mais líquidos do país. As violações dos limites têm sido baixas e prontamente solucionadas.

Desempenho dos Investimentos

O desempenho ajustado ao risco dos fundos foi consistente e alinhado a seus objetivos e aos pares relevantes no período de 36 meses encerrado em dezembro de 2021. Todos os fundos, excluindo os recursos do FGTS, foram transferidos para a Caixa DTVM, mantendo o histórico.

Companhia e Atendimento a Clientes

A Caixa DTVM era a quarta maior gestora no Brasil, com cerca de 6,8% de participação no mercado local e BRL469 bilhões de AUM em março de 2022, segundo a Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais (Anbima). Estabelecida em 1861, a Caixa era o terceiro maior banco do Brasil em termos de ativos em dezembro de 2021. No mesmo período, apresentava ativos de BRL1,45 trilhão e lucro de BRL17,3 bilhões. A Caixa é inteiramente controlada pelo governo brasileiro e seus ratings refletem a alta probabilidade de suporte do controlador, se necessário.

Considerando o histórico do grupo, a gestora demonstra resultados financeiros fortes e consistentes. Tem respondido por 5% a 10% do resultado da Caixa, o que a torna uma importante unidade de negócios. Em março de 2022, o AUM era constituído por fundos de renda fixa (71%), previdência (20%, basicamente renda fixa), multimercados (3%), renda variável (3%) e outros (3%). Tem experiência em diferentes tipos de mandatos, mas seus principais investidores são clientes de varejo (24% do AUM em março de 2022), previdência aberta (24%), entidades públicas (23%) e fundos de previdência de estados e municípios (Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS, 16%). Investidores corporates respondiam por 5%, empresas médias, por 4%, e outros, por 4%.

SENSIBILIDADE DOS RATINGS

Fatores Que Podem, Individual ou Coletivamente, Levar a Uma Ação de Rating Negativa/Rebaixamento:

-- O rating da Caixa DTVM é sensível a alterações adversas significativas em quaisquer dos fundamentos de rating mencionados acima, principalmente em caso de enfraquecimento de seu perfil

financeiro, alta rotatividade profissional ou deterioração de processos e políticas. Um desvio relevante das diretrizes da Fitch em relação a qualquer fundamento poderá levar ao rebaixamento da classificação. Além disso, uma expansão para estratégias mais sofisticadas, sem melhorias proporcionais nos processos ou nos recursos de investimento, pode resultar em rebaixamento.

Fatores Que Podem, Individual ou Coletivamente, Levar a Uma Ação de Rating Positiva/Elevação:

-- O rating e os scores da gestora não podem ser elevados, pois já estão na escala mais alta da Fitch.

FONTES DE INFORMAÇÃO

As principais fontes de informação utilizadas na análise estão descritas nas Metodologias Aplicadas listadas abaixo.

INFORMAÇÕES REGULATÓRIAS:

A Fitch Ratings foi paga para determinar cada rating de crédito listado neste relatório de classificação de risco de crédito pelo devedor ou emissor classificado, por uma parte relacionada que não seja o devedor ou o emissor classificado, pelo patrocinador ("sponsor"), subscritor ("underwriter"), ou o depositante do instrumento, título ou valor mobiliário que está sendo avaliado.

Metodologia Aplicada e Pesquisa Relacionada:

-- Ratings de Qualidade de Gestão de Investimentos (22 de fevereiro de 2021).

Informações adicionais estão disponíveis em 'www.fitchratings.com' e em 'www.fitchratings.com/brasil'.

Fitch Ratings Analysts

Pedro Gomes

Director

Analista primário

+55 11 4504 2604

Fitch Ratings Brasil Ltda. Alameda Santos, nº 700 – 7º andar Edifício Trianon Corporate - Cerqueira César São Paulo, SP SP Cep 01.418-100

Felipe Baquero Riveros

Associate Director

Analista secundário

+57 601 241 3219

Davie Rodriguez, CFA

Senior Director

Presidente do Comitê

+1 212 908 0386

Media Contacts

responsabilidade: <https://fitchratings.com/understandingcreditratings>. Além disso, as definições de cada escala e categoria de rating, incluindo definições referentes à inadimplência, podem ser acessadas em <https://www.fitchratings.com/pt/region/brazil>, em definições de ratings, na seção de exigências regulatórias. A ESMA e a FCA são obrigadas a publicar as taxas de inadimplência históricas em um repositório central, em conformidade com os artigos 11 (2) do Regulamento (EC) n.º 1060/2009 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 16 de setembro de 2009, bem como de acordo com os termos do Regulamento das Agências de Rating de Crédito (Alterações etc.) (saída da UE), de 2019, respectivamente.

Os ratings públicos, critérios e metodologias publicados estão permanentemente disponíveis neste site. O código de conduta da Fitch e as políticas de confidencialidade, conflitos de interesse; segurança da informação (firewall) de afiliadas, compliance e outras políticas e procedimentos relevantes também estão disponíveis neste site, na seção "código de conduta". Os interesses relevantes de diretores e acionistas estão disponíveis em <https://www.fitchratings.com/site/regulatory>. A Fitch pode ter fornecido outro serviço autorizado ou complementar à entidade classificada ou a partes relacionadas. Detalhes sobre serviço autorizado, para o qual o analista principal está baseado em uma empresa da Fitch Ratings (ou uma afiliada a esta) registrada na ESMA ou na FCA, ou serviços complementares podem ser encontrados na página do sumário do emissor, no site da Fitch. Ao atribuir e manter ratings e ao fazer outros relatórios (incluindo informações sobre projeções), a Fitch conta com informações factuais que recebe de emissores e underwriters e de outras fontes que a agência considera confiáveis. A Fitch realiza uma apuração adequada das informações factuais de que dispõe, de acordo com suas metodologias de rating, e obtém razoável verificação destas informações de fontes independentes, à medida que estas fontes estejam disponíveis com determinado patamar de segurança, ou em determinada jurisdição. A forma como é conduzida a investigação factual da Fitch e o escopo da verificação de terceiros que a agência obtém poderão variar, dependendo da natureza do título analisado e do seu emissor, das exigências e práticas na jurisdição em que o título analisado é oferecido e vendido e/ou em que o emissor esteja localizado, da disponibilidade e natureza da informação pública envolvida, do acesso à administração do emissor e seus consultores, da disponibilidade de verificações pré-existentes de terceiros, como relatórios de auditoria, cartas de procedimentos acordadas, avaliações, relatórios atuariais, relatórios de engenharia, pareceres legais e outros relatórios fornecidos por terceiros, disponibilidade de fontes independentes e competentes de verificação, com respeito ao título em particular, ou na jurisdição do emissor, em especial, e a diversos outros fatores. Os usuários dos ratings e relatórios da Fitch devem estar cientes de que nem uma investigação factual aprofundada, nem qualquer verificação de terceiros poderá assegurar que todas as informações de que a Fitch dispõe com respeito a um rating ou relatório serão precisas e completas. Em última instância, o emissor e seus consultores são responsáveis pela precisão das informações fornecidas à Fitch e ao mercado ao disponibilizar documentos e outros relatórios. Ao emitir ratings e relatórios, a Fitch é obrigada a confiar no trabalho de especialistas, incluindo auditores independentes, com respeito às demonstrações financeiras, e advogados, com referência a assuntos legais e tributários. Além disso, os ratings e as projeções financeiras e outras informações são naturalmente prospectivos e incorporam hipóteses e premissas sobre eventos futuros que, por sua natureza, não podem ser confirmados como fatos. Como resultado, apesar de qualquer verificação sobre fatos atuais, os ratings e as projeções podem ser afetados por condições ou eventos futuros não previstos na ocasião em que um rating foi emitido ou afirmado.

As informações neste relatório são fornecidas "tais como se apresentam", sem que ofereçam qualquer tipo de garantia, e a Fitch não garante ou atesta que um relatório ou seu conteúdo atenderá qualquer requisito de quem o recebe. Um rating da Fitch constitui opinião sobre o perfil de crédito de um título. Esta opinião e os relatórios se apoiam em critérios e metodologias existentes, que são constantemente avaliados e atualizados pela Fitch. Os ratings e relatórios são, portanto, resultado de um trabalho de equipe na Fitch, e nenhum indivíduo, ou grupo de indivíduos, é responsável isoladamente por um rating ou relatório. O rating não cobre o risco de perdas em função de outros riscos que não sejam o de crédito, a menos que tal risco esteja especificamente mencionado. A Fitch não participa da oferta ou venda de qualquer título. Todos os relatórios da Fitch são de autoria compartilhada. Os profissionais identificados em um relatório da Fitch participaram de sua elaboração, mas não são isoladamente responsáveis pelas opiniões expressas no texto. Os nomes são divulgados apenas para fins de contato. Um relatório que contenha um rating atribuído pela Fitch não constitui um prospecto, nem substitui as informações reunidas, verificadas e apresentadas aos investidores pelo emissor e seus agentes com respeito à venda dos títulos. Os ratings podem ser alterados ou retirados a qualquer tempo, por qualquer razão, a critério exclusivo da Fitch. A agência não oferece aconselhamento de investimentos de qualquer espécie. Os ratings não constituem recomendação de compra, venda ou retenção de qualquer título. Os ratings não comentam a correção dos preços de mercado, a adequação de qualquer título a determinado investidor ou a natureza de isenção de impostos ou taxaço sobre pagamentos efetuados com respeito a qualquer título. A Fitch recebe pagamentos de emissores, seguradores, garantidores, outros coobrigados e underwriters para avaliar o rating dos títulos. Estes preços geralmente variam entre USD1.000 e USD750.000 (ou o equivalente em moeda local aplicável) por emissão. Em certos casos, a Fitch analisará todas ou determinado número de emissões efetuadas por um emissor em particular ou seguradas ou garantidas por determinada seguradora ou garantidor, mediante um único pagamento anual. Tais valores podem variar de USD10.000 a USD1.500.000 (ou o equivalente em moeda local aplicável). A atribuição, publicação ou disseminação de um rating pela Fitch não implicará consentimento da Fitch para a utilização de seu nome como especialista, com respeito a qualquer declaração de registro submetida mediante a legislação referente a títulos em vigor nos Estados Unidos da América, a Lei de Serviços Financeiros e Mercados, de 2000, da Grã-Bretanha ou a legislação referente a títulos de qualquer outra jurisdição, em particular. Devido à relativa eficiência da publicação e distribuição por meios eletrônicos, o relatório da Fitch poderá ser disponibilizado para os assinantes eletrônicos até três dias antes do acesso para os assinantes dos impressos.

Para Austrália, Nova Zelândia, Taiwan e Coreia do Sul apenas: A Fitch Austrália Pty Ltd detém uma licença australiana de serviços financeiros (licença AFS nº337123), a qual autoriza o fornecimento de ratings de crédito apenas a clientes de atacado. As informações sobre ratings de crédito publicadas pela Fitch não se destinam a ser utilizadas por pessoas que sejam clientes de varejo, nos termos da Lei de Sociedades (Corporations Act 2001).

A Fitch Ratings, Inc. está registrada na Securities and Exchange Commission dos EUA como uma "Nationally Recognized Statistical Rating Organization (NRSRO – Organização de Rating Estatístico Reconhecida Nacionalmente). Algumas subsidiárias de rating de crédito da NRSROs são listadas no Item 3 do NRSRO Form e, portanto, podem atribuir ratings de crédito em nome da NRSRO (veja <https://www.fitchratings.com/site/regulatory>), mas outras subsidiárias de rating de crédito não estão listadas no NRSRO Form (as "não-NRSROs"). Logo, ratings de crédito destas subsidiárias não são

atribuídos em nome da NRSRO. Porém, funcionários da não-NRSRO podem participar da atribuição de ratings de crédito da NRSRO ou atribuídos em nome dela.

Copyright © 2022 da Fitch, Inc., Fitch Ratings Ltd. e suas subsidiárias. 33 Whitehall St, NY, NY 10004. Telefone: 1-800-753-4824 (para chamadas efetuadas nos Estados Unidos), ou (001212) 908-0500 (chamadas fora dos Estados Unidos). Fax: (212) 480-4435. Proibida a reprodução ou retransmissão, integral ou parcial, exceto quando autorizada. Todos os direitos reservados.

Endorsement policy

Os ratings de crédito internacionais da Fitch produzidos fora da União Europeia (UE) ou do Reino Unido, conforme o caso, são endossados para uso por entidades reguladas na UE ou no Reino Unido, respectivamente, para fins regulatórios, de acordo com os termos do Regulamento das Agências de Rating de Crédito da UE ou do Reino Unido (Alterações etc.) (saída da UE), de 2019 (EU CRA Regulation or the UK Credit Rating Agencies (Amendment etc.) (EU Exit) Regulations 2019), conforme o caso. A abordagem da Fitch para endosso na UE e no Reino Unido pode ser encontrada na página de [Regulatory Affairs \(Assuntos Regulatórios\)](#) da Fitch, no site da agência. O status de endosso dos ratings de crédito internacionais é fornecido na página de sumário da entidade, para cada entidade classificada, e nas páginas de detalhes das transações, para transações de finanças estruturadas, no site da Fitch. Estas divulgações são atualizadas diariamente.

Sistemas

VALORES MOBILIÁRIOS



DADOS CADASTRAIS DE PREST. SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO DE CARTEIRAS

ALVARO CUNHA MATOS LESSA DE OLIVEIRA

CPF : 326.638.608-67

Data de Registro : 26/10/2020

Situação : EM FUNCIONAMENTO NORMAL

Website :

Categoria : Gestor de Carteira

[Formulário de Referência](#)

Prest. Serviços de Administração de Carteiras na qual ele é Diretor

[CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.](#)

[Fale com a CVM](#)