

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 Compliance
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 (R\$)
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.

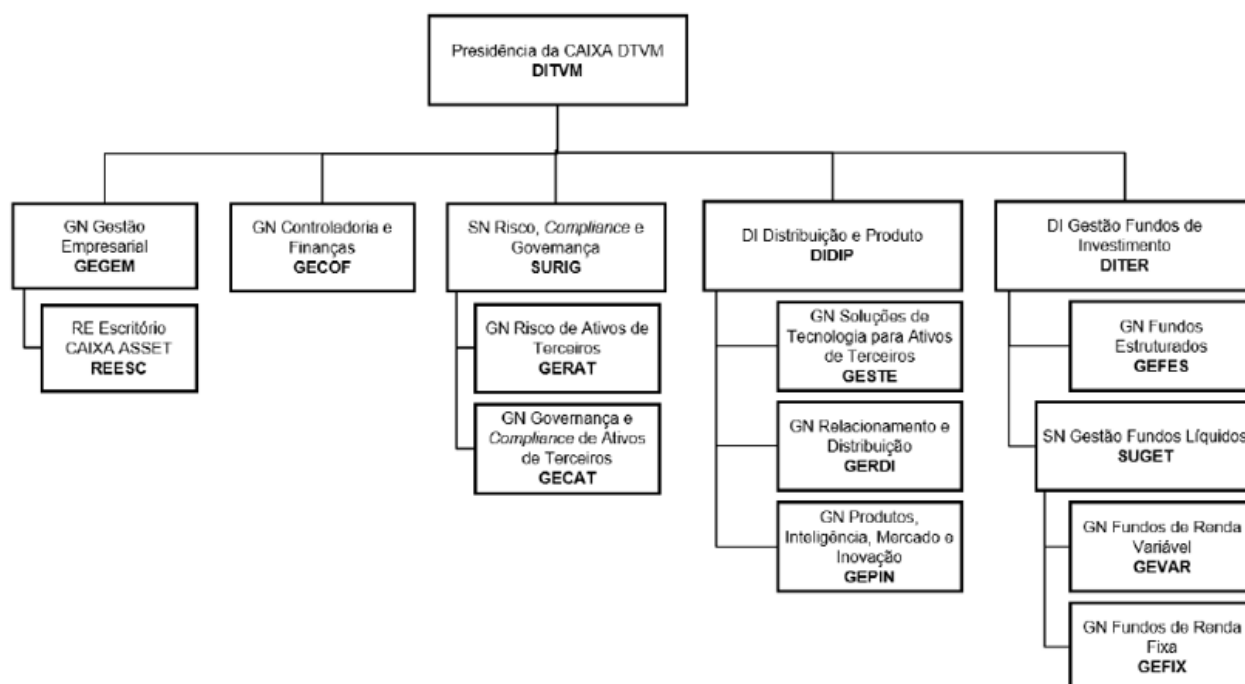
SEGREGAÇÃO DE ATIVIDADES E RESPONSABILIDADES DE DIRIGENTES ESTATUTÁRIOS

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 Compliaset - 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, doação 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.