



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 35.185.577/0001-08

Nome do Administrador de Carteira: ASSET1 INVESTIMENTOS S/A

Ano de competência: 2023

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A ASSET1 é uma gestora de recursos independentes constituída em 08 de outubro de 2019 pela união de executivos do mercado financeiro, com foco na gestão de fundos de investimentos multimercado, regulados pela Instrução CMV n.º 555, de 17 de dezembro de 2014, conforme alterada ("Instrução CVM n.º 555"), tais fundos terão como objetivos os investimentos em ativos com riscos diversos, tais como: títulos públicos, títulos privados, ações, derivativos, além de cotas de fundos de investimento de renda fixa, ações e multimercado. Os ativos podem ser locais e/ou internacionais e negociados no Brasil ou exterior.

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

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

A ASSET1 exerce a atividade de gestão de fundos de investimentos e durante 2022 foram incorporados novos sócios para atender a expansão e escalabilidade dos seus negócios.

Em 22/07/21 foi realizado a 8ª alteração do contrato social para transformação de Sociedade Empresária Ltda em Sociedade por Ações (S.A). Todas as alterações do contrato social realizadas anteriores ao evento de transformação da sociedade, foram necessárias para a inclusão e/ou exclusão de Sócios.

Com a transformação da sociedade de Ltda para S.A em 2021, as alterações de inclusão e exclusão de sócios são registradas no livro de Registro de Ações conforme lei 6.404 das S.A.

Alterações em 2022: admissão do Banco Itaú Unibanco S.A. em 07/01/2022.

b. Escopo das atividades

A ASSET1 exerce a atividade de gestão de fundos de investimento.

c. Recursos humanos e computacionais

A Asset 1 possui um corpo de Associados e Colaboradores num total de 19 pessoas, voltadas para as atividades de Gestão, Research, Risco, Compliance, Operações, Administrativo e Financeiro.

Todos possuem equipamentos da empresa para exercer suas atividades e recursos de sistemas e ferramentas de suporte necessária para suas atividades.

d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos

A ASSET1 possui políticas implementadas para gestão dos ambientes de negócios e operacionais, sendo que as principais políticas e procedimentos exigidos pelos reguladores, estão divulgadas no Site (www.asset1.com.br) conforme a seguir:

- Manual de Regras, Procedimentos e Controles Internos;
- Políticas de Rateio e Divisão de Ordens
- Políticas de Gestão de Riscos e Liquidez
- Política de Votos
- Política de Ética
- Política de Investimentos Pessoais
- Políticas de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Financiamento ao Terrorismo
- Manual de LGPD

Outras políticas e procedimentos, não limitados aos acima expostas, estão disponíveis aos Sócios e Colaboradores na Intranet da Asset 1.

3. Recursos Humanos



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

a. Número de sócios:

15

b. Número de empregados:

4

c. Número de terceirizados:

2

CPF	Nome
257.997.488-16	MARCELLO SINISCALCHI

4. Auditores

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

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

Nome empresarial	Data da contratação	Descrição
KPMG Assurance Services Ltda	13/12/2023	Execução de serviços de auditoria, com a finalidade de emitir relatório de auditoria de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria, contemplando o balanço patrimonial e as correspondentes demonstrações do resultado, do resultado abrangente, das mutações do patrimônio líquido e dos fluxos de caixa da Asset1 Investimentos S.A ("Companhia") para o exercício a findar-se em 31 de dezembro de 2023, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicável as pequenas e médias empresa (BR GAAP - CPC PME).

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

Sim

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

Demonstração Financeira: 20240326091011c16b75f49adf4454a328e54e61932744.pdf

Relatório: Não se aplica

6. Escopo das Atividades

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

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

A ASSET1 exerce a atividade de Gestão de Recursos de Terceiros através de fundos de investimentos.

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.)

Os produtos geridos pela ASSET1 são relacionados aos fundos de investimentos constituídos primordialmente como fundos de investimento multimercado, regulados pela Instrução CVM n.º 555 e RCVM n.º 175.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Os fundos de investimentos sob gestão da ASSET1 investem em diversas classes de ativos, tais como: títulos públicos, títulos privados, ações, derivativos, além de cotas de fundos de investimento de renda fixa, ações e multimercado. Os ativos podem ser locais e/ou internacionais e negociados no Brasil ou exterior.

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

Não

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

a. Os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades

Não aplicável, tendo em vista que a ASSET1 não realiza outras atividades além da gestão de fundos de investimentos, razão pela qual não há potenciais conflitos de interesse a serem apontados.

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

Não há sociedades controladoras, controladas, coligadas e sob controle comum

**COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

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

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

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

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
a. Número de investidores	15	629	644

b. Número de investidores, dividido por:	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	0	0	0
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	0	0	0
iii. Instituições Financeiras	1		1
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	1		1
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	1		1
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	0	0	0
vii. Seguradoras	0		0
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	0		0
ix. Clubes de Investimento	0	0	0
x. Fundos de Investimento	12		12
xi. Investidores não Residentes	0		0

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Investidores por conta e ordem	0	629	629

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	15	629	644

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 941.500.000,00	R\$ 0,00	R\$ 1.002.500.000,00

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

R\$ 117.400.000,00



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

Valor	Nome
R\$ 812.373.802,79	
R\$ 43.671.599,99	
R\$ 28.646.660,03	
R\$ 17.104.464,32	
R\$ 15.462.034,92	
R\$ 14.185.934,91	
R\$ 13.475.642,08	
R\$ 7.307.730,98	
R\$ 5.344.761,25	
R\$ 4.671.163,62	

f. Recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
iii. Instituições Financeiras	R\$ 812.400.000,00		R\$ 812.400.000,00
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 18.500.000,00		R\$ 18.500.000,00
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	R\$ 2.800.000,00		R\$ 2.800.000,00
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
vii. Seguradoras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	R\$ 0,00		R\$ 0,00
ix. Clubes de Investimento	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
x. Fundos de Investimento	R\$ 107.800.000,00		R\$ 107.800.000,00
xi. Investidores não Residentes	R\$ 0,00		R\$ 0,00

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Por conta e Ordem	R\$ 0,00	R\$ 61.000.000,00	R\$ 61.000.000,00

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 941.500.000,00	R\$ 0,00	R\$ 1.002.500.000,00

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

a. Ações	R\$ 41.800.000,00
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R\$ 0,00
c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R\$ 0,00
d. Cotas de fundos de investimento em ações	R\$ 0,00
e. Cotas de fundos de investimento em participações	R\$ 0,00
f. Cotas de fundos de investimento imobiliário	R\$ 0,00
g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R\$ 0,00
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 0,00
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 124.000.000,00
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 6.246.000.000,00
k. Outros valores mobiliários	R\$ 24.100.000,00
l. Títulos públicos	R\$ 733.100.000,00
m. Outros ativos	R\$ 113.100.000,00
Total	R\$ 7.282.100.000,00

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

MARCELLO SINISCALCHI - CIO

Iniciou a carreira em 1997 na Asset do Banco BBA como trader de Renda Fixa. Após a compra do BBA pelo Itaú, assumiu a área de Hedge Funds da Itaú Asset em 2005 criando e gerindo o produto flagship Itaú Hedge Plus. Em 2013 tornou-se CIO da Itaú Asset, incorporando a responsabilidade por ativos de crédito e ações, além dos Hedge Funds. No final de 2018 foi convidado para se tornar o Head da Itaú Asset, cargo que ocupou até junho de 2019 quando se desligou para fundar a Asset1. Graduado em Engenharia Civil pela Poli-USP com Pós-Graduação em Administração de Empresas e Mestrado em Modelagem Matemática pela FEA/USP.

BRUNO SILVA CARVALHO - Gestão/Renda Fixa

Iniciou a carreira em 2002 na Fidúcia Asset Management, onde permaneceu até 2005. Em seguida trabalhou na Direcional Administradora de Recursos como sócio responsável pela gestão de renda fixa e câmbio até 2007. Entre 2007 e 2010 foi gestor de renda fixa e câmbio da Itaú Asset. Em 2010 mudou para a Gávea Investimentos como gestor de renda fixa e câmbio até 2012, quando foi convidado para integrar a tesouraria do Itaú BBA como gestor de renda fixa, onde permaneceu até o início de 2019. Em 2019 juntou-se ao time da Absolute Investimentos como gestor de renda fixa. Em fevereiro de 2020 juntou-se à Asset1 como sócio fundador e membro do comitê executivo. Graduado em Engenharia de Produção e de Telecomunicações pela PUC-Rio e possui mestrado em Economia pela FGV-EPGE.

FELIPE DE FREITAS PEREIRA LEITÃO - Gestão Juros e Moedas LATAM

Iniciou a carreira em 1997 como estagiário no Opportunity Fund no Rio de Janeiro com breve passagem pelo Fleming Graphus entre 1998 e 1999. Em janeiro de 2000 se transferiu para São Paulo para integrar a mesa de Reais do HSBC Brasil, onde ocupou o cargo de Head de Rates trading local até 2007. Em meados de 2007 foi transferido para mesa de câmbio, em NY, para ser trader de BRL offshore e em 2009 foi promovido a Managing Director e Head de FX Latam, onde ficou até 2016. Entre 2017 e 2021 integrou a mesa da BGC Financial-BRL NDF. Passou brevemente por um fundo de criptomoedas chamado Bit5ive Fund e em fevereiro de 2023 se juntou a Asset 1 para ser Portfolio Manager com foco em Moedas e Rates de LATAM.

PEDRO CARNEIRO - Direcional Bolsas e Moedas

Iniciou sua carreira no Banco Pactual em 1988 onde permaneceu até 1992. Em 1996 foi fundador e sócio gestora Ático Administração de Recursos. Como pioneiro da indústria de Gestoras independentes fundou em 2001 a Direcional Administração de Recursos, aonde foi CIO e head do fundo Multimercado. Passou também por instituições como Opus, Ibiúna e Trafalgar sempre como gestor macro. Em novembro de 2021 juntou-se a Asset 1 como gestor, com foco em Renda Variável Top Down e Câmbio. Formado em Administração de empresas pela Faculdade Candido Mendes, possui mestrado em finanças pelo IBMEC-RJ.

NORBERTO ALVES - Gestão de Renda Fixa

Iniciou a carreira em 2017 na área de Trading Support na Garde Asset Management. Posteriormente, atuou como Trader de FX no banco Goldman Sachs até início de 2021, quando saiu para se juntar ao time da Asset 1. Graduado em Engenharia Eletrônica pelo Instituto Tecnológico de Aeronáutica (ITA-SP).

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

N/A

7. Grupo Econômico

7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
34.280.231/0001-18	Asset1 Participações Ltda
60.701.190/0001-04	Itaú Unibanco S A

b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
-	Não Informado



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

c. Participações da empresa em sociedade do grupo

CNPJ	Nome
-	Não Informado

d. Participações de sociedades do grupo na empresa

CNPJ	Nome
34.280.231/0001-18	Asset 1 Participações Ltda

e. Sociedades sob controle comum

CNPJ	Nome
-	Não Informado

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

Nenhum arquivo selecionado.

8. Estrutura Operacional e Administrativa

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

a. Atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Comitê de Investimentos: Discussão e orientações de temas de investimentos; efetua revisão periódica dos investimentos, utilizando-se diferentes métricas para a definição de concentração, diversificação e posição dos fundos de investimento sob gestão.

Comitê de Controles Internos: Aborda questões previstas no Manual de Regras, Procedimentos e Controles Internos: (i) análise de situações sobre as atividades e rotinas de compliance; (ii) revisão e atualização de políticas; (iii) análise de infringência das regras descritas no Manual, na regulamentação em vigor e/ou eventos sobre as sanções a serem aplicadas; assuntos de Cyber Security, treinamentos, controle de investimento pessoal dos Colaboradores e Matriz de Riscos.

Comitê de Riscos e Liquidez:

Aborda questões previstas no Manual de Riscos, define a governança de risco de mercado e liquidez e assegura o seu cumprimento. Suas principais atribuições são: aprovação de produtos e métricas de risco, definição de limites, discussão de incidentes relacionados a risco de mercado e liquidez e apresenta os resultados das métricas de risco e performance por Traders e Produtos.

Comitê de Clientes:

Define as estratégias de atuação para captação de Investidores junto aos canais de distribuição no mercado financeiro; define as metas de captação (budget); Analisa os segmentos de Investidores; Analisa os resultados versus o budget e concorrência, traçar rumos para alinhar as expectativas.

Comitê de Corretoras:

Avaliar todos os serviços prestados pelas corretoras, pré e pós contratação. O Comitê estabelece ação de consequência para as Corretoras que não prestaram serviços com a acurácia e qualidade e critérios para a contratação de novos prestadores de serviço.

Área de Compliance:

Monitorar e garantir a aplicabilidade de todos os preceitos estabelecidos pelos reguladores; autorreguladores e de controles internos da Gestora; Monitorar atividades de Cyber Security; estabelecer, desenvolver e executar programas de treinamentos; atender os Reguladores, Auditoria e outros Players de mercado.

Área de Risco:

Define limites e elabora diariamente relatórios de exposição a riscos para cada fundo de investimento, monitora os enquadramentos constantes dos regulamentos dos fundos de investimento e acompanhamento através de métricas de risco para assegurar a adesão aos limites de risco previamente estabelecidos.

Área de Operações:

Efetua todos os controles do ambiente operacional (On e Offshore), execução do pós-trade; controle de caixa; controle de margens; controle dos desenquadramentos; controle do P&L, prazo médio dos fundos, reconciliação de todas as posições dos fundos e validação das cotas.

Área de Research:

Encarregado pelo monitoramento da economia e dos mercados, bem como de dar suporte à gestão de ativos, a partir da captação e análise de dados temporais do mercado com relatórios próprios e de terceiros, confecção e análise de modelos e indicadores diversos, relatórios e acompanhamento da rentabilidade das carteiras e ativos no mercado, utilizando planilhas Excel, LOTE45 e informações como o Bloomberg, Broadcast, Valorpro, dentre outros.

Área de Relação com Investidores:

Manter os canais de comunicação abertos com os distribuidores e alocadores com rotinas de reuniões, envio documentos conforme solicitações e atualização de todas as estratégias dos fundos; define os materiais de mídias e eventos, atende as requisições dos meios de comunicação, coordena entrevistas e divulgações ao mercado e manutenção do site da ASSET1.

Área de Gestão / Trading:

Efetua a gestão das carteiras dos fundos; define as estratégias de atuação dos fundos e mantém alinhadas às definições e determinações das políticas de investimentos, reuniões diárias de caixa para discutir todos os cenários, mercados de atuação e posições do dia com suporte do Research e do mercado, toma decisões de investimentos e executa os trades junto as Corretoras, mantém o acompanhamento do PnL e Riscos e controla desvio dos limi

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Comitê de Investimentos:

O Comitê é composto pelo Diretor de Gestão, Diretor de Compliance, Risco e PLD e pelos demais membros da equipe de gestão de recursos da ASSET1 ("Equipe de Gestão"). As reuniões serão realizadas semanalmente ou sempre que convocadas pelo Diretor de Gestão. Suas deliberações são realizadas via conferência telefônica, consignadas em atas e/ou registradas por e-mail.

Comitê de Controles Internos:

O Comitê é composto pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD, pelo Diretor de Gestão, e por outros membros das áreas de Operações, Compliance, Riscos e Administração & Finanças. As reuniões serão realizadas mensalmente ou sempre que convocadas pelo representante da área de Compliance e suas deliberações são consignadas em atas e/ou registradas por e-mail.

Comitê de Riscos e Liquidez:

O Comitê é composto pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD, pelo Diretor de Gestão, e por membros das áreas de Riscos, Compliance e Operações. As reuniões são realizadas mensalmente ou sempre que convocadas pelo representante da área de Risco e suas deliberações serão consignadas em atas e/ou registradas por e-mail.

Comitê de Corretora:

O Comitê é composto pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD, pelo Diretor de Gestão, Representantes das áreas de Gestão, Compliance, Riscos e Operações. As reuniões são realizadas semestralmente ou sempre que convocadas pela área de Compliance e suas deliberações serão consignadas em atas e/ou registradas por e-mail.

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

Além das atribuições e poderes individuais para fins regulatórios do Diretor de Gestão e do Diretor de Compliance, Risco e PLD, nos termos do Contrato Social da ASSET1, esta poderá ser representada ativa e passivamente, judicial e extrajudicialmente, por estes, agindo em conjunto.

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

Nenhum arquivo selecionado

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

CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos
257.997.488-16	Marcello Siniscalchi	48	Engenheiro	Diretor de Gestão	08/10/2019	Indeterminado	Membro do Comitê de Investimentos e de Controles Internos e Riscos e Liquidez
846.016.711-91	Bruno Silva Carvalho	43	Engenheiro	Diretor de Renda Fixa	13/04/2020	Indeterminado	Membro do Comitê de Investimentos e de Controles Internos e Riscos e Liquidez
149.230.778-59	Marcelo de Lima Fatio	51	Administrador	Diretor de Compliance, Gestão de Risco e PLD	08/10/2019	Indeterminado	Membro do Comitê de Investimentos e de Controles Internos e Riscos e Liquidez

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	257.997.488-16	Marcello Siniscalchi	48	Engenheiro	Diretor de Gestão	11/03/2020	indeterminado	Membro do Comitê de Investimentos e de Controles Internos e Riscos e Liquidez	Graduação: Engenharia Civil, 1997 - Escola Politécnica da Universidade de São Paulo Pós-Graduação: Administração de Empresas com Ênfase em Banking, 2001 - FGV/SP Mestrado: Modelagem Matemática para Finanças, 2004 - Faculdade de Economia e Administração - FEA USP	Aprovado no exame CGA em 20 de julho de 2009



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

8.5 (COMPLI ANCE)	149.230.7 78-59	Marcelo de Lima Fatio	51	Administra dor	Diretor de Compliance, Gestão de Risco e PLD	11/03/202 0	Indetermi nado	Membro do Comitê de Investimen tos e de Controles Internos e Riscos e Liquidez	Risk and Investmen t Management Program: Yale School of Management (2016). Programa de Educação Executiva : Fundação Dom Cabral (2015) Global Strategic Leadershi p: Wharton School (2012). Mestrado: Economia , Fundação Getúlio Vargas (FGV), 2006. Graduaçã o: Administra ção, Fundação Armando Álvares Penteado (FAAP), 1995.	Aprovado no exame CPA-20 em 25 de maio de 2003.
-------------------------	--------------------	-----------------------------	----	-------------------	--	----------------	-------------------	--	---	--

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída
257.997.488-16	Marcello Siniscalchi	Itaú Asset Management	Cargo: Diretor de Gestão Funções: Gestão de recursos de terceiros	Gestora de recursos de terceiros	01/07/2003	30/07/2019
149.230.778-59	Marcelo de Lima Fatio	Itaú Asset Management	Cargo: COO Funções: Responsável pelas áreas ex-investimentos, englobando operações, riscos, produtos e vendas, além das unidades internacionais.	Gestora de Recursos	01/10/1998	30/07/2019

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

a. Quantidade de profissionais

6

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A equipe de gestão de recursos é responsável pela análise e avaliação dos investimentos, bem como alocação entre os diferentes ativos e posições das carteiras sob gestão. Em última instância, o Diretor de Gestão é responsável pela definição das estratégias e pela tomada de decisões de investimento. Por seu turno, os analistas estão encarregados do monitoramento dos mercados, bem como de dar suporte à gestão de ativos, a partir da captação e análise de dados temporais do mercado, utilizando relatórios de terceiros, confecção e análise de relatórios proprietários e acompanhamento da rentabilidade e nível de risco das carteiras e ativos no mercado.

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

Sistemas: Sistema LOTE45 e Bloomberg

Rotina e Procedimentos: Conforme descrito na Política de Decisão de Investimentos, Seleção e Alocação de Ativos da ASSET1, de forma geral, a rotina da equipe de gestão de recursos compreende discussões constantes sobre os cenários macro e microeconômicos no âmbito do Comitê de Investimentos, as quais tomam por base a análise contínua de notícias, estudos proprietários desenvolvidos pelo time de pesquisa, além de relatórios de terceiros. O Diretor de Gestão e os membros da Equipe de Gestão avaliam diferentes métricas para a definição de concentração, diversificação e posição dos fundos de investimento, bem como as informações relacionadas à economia que venham a ter alguma influência no mercado-alvo dos investimentos sob gestão.

A decisão de investimento em ativos financeiros é originada a partir de tais discussões. Uma vez tomada a decisão, é então definida a proporção da posição a ser adquirida ou vendida, conforme o caso, cuja execução será realizada pelos membros da Equipe de Gestão de Recursos, de acordo com os manuais e políticas adotados pela ASSET1.

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

a. Quantidade de profissionais

2

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Dentro das principais atividades desenvolvidas pela Área de Compliance da ASSET1 são consideradas as práticas estabelecidas na Política de Contratação de Terceiros, elaborada com base nas melhores práticas de mercado e de acordo com a regulamentação e autorregulação em vigor, notadamente o Código ANBIMA de Melhores Práticas para Administração de Recursos de Terceiros da Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiros e de Capitais ("ANBIMA").

O Diretor de Compliance, Risco e PLD é o principal responsável pelo cumprimento da Política de Contratação de Terceiro e conta com o suporte da Área de Compliance.

Os critérios para a fiscalização dos serviços prestados, segundo a política, devem levar em consideração a avaliação da Contratada através da resposta ao questionário estabelecido pela Anbima para esses fins (QDD Anbima).

A área de Compliance é responsável pela aplicação e posterior análise dos dados reportados e pela recomendação ao Diretor de Compliance, Risco e PLD para a sua contratação.

A área de Compliance é responsável pelo monitoramento das atividades do contratado utilizando métricas estabelecidas na política relativa a Abordagem Baseada em Risco (ABR) para a Contratação de Terceiros, onde é estabelecido o nível de risco da Contratada (Alto, Médio e Baixo). Esse processo de avaliação deverá atender os requisitos estabelecidos na política de no mínimo anual dependendo do nível de classificação de cada contratado.

Caso se identifique algum problema de atendimento aos critérios definidos pela Política de Contratação de Terceiros, a área de Compliance efetua comunicação ao Diretor de Compliance, Risco e PLD do evento para que seja tomada decisões sobre consequências cabíveis.

Todos os eventos identificados no decorrer do processo de monitoramento dos Terceiros contratados são levados ao conhecimento dos membros do Comitê de Corretora para ciência das ações tomadas.

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

Sistemas: Lote 45, modelos ou planilhas proprietárias desenvolvidas em Excel / Python e a formalização de documentos e políticas desenvolvidas em processador de texto Word.

Rotinas e Procedimentos: As atividades da Área de Compliance envolvem rotinas diárias, semanais e mensais de verificação da conformidade das transações realizadas conforme as normas em vigor, regulamentos dos fundos de investimento sob gestão da ASSET1 bem como, com aspectos relevantes do Manual de Controles Internos e demais políticas, conforme atividades descritas no item acima.

A Asset 1 possui uma Intranet para divulgar todas as políticas internas possibilitando que todos os Sócios e Colaboradores tenham acesso tempestivo as informações Regulatórias, Autorregulatórias e de Controles Internos.

Também, na Intranet temos um programa de treinamento das políticas internas dirigidas aos Colaboradores com a utilização da ferramenta Click Compliance que monitora os cursos aplicados e emite certificado individuais de completude dos treinamentos.

Outro processo importante é o monitoramento dos eventos de Investimentos Pessoais de todos os Sócios, Colaboradores e seus dependentes diretos através do sistema InfoDefense da B3.

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

O Diretor de Compliance, Risco e PLD não tem participação em decisões de investimento (exceto nas decisões envolvendo temas específicos de riscos e compliance). Dentro da governança, o Diretor de Compliance, Risco e PLD possui total autonomia no exercício de suas atividades.

A decisão das ações a serem tomadas, no caso de suspeita, indício ou efetivo descumprimento de quaisquer das regras estabelecidas no Manual de Controles Internos ou das demais normas aplicáveis às atividades da ASSET1, cabe aos membros do Comitê de Controles Internos.

Caso haja suspeita, indício ou descumprimento que recaia sobre qualquer dos membros do Comitê de Controles Internos, esta pessoa será excluída do Comitê até que a questão seja resolvida.

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

a. Quantidade de profissionais *

3

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

As atividades desenvolvidas pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD e da Área de Risco constam expressamente da Política de Gestão de Riscos da ASSET1, e têm por objetivo monitorar a exposição das carteiras e fundos de investimento sob sua gestão aos fatores de risco inerentes aos investimentos realizados, analisando as informações diárias dos fundos e carteiras, seus limites, liquidez e a volatilidade dos ativos em relação à exposição aos mercados, considerando a relação dos mesmos com os cenários prospectivos, buscando identificar os potenciais eventos e riscos que possam vir a afetar os resultados da ASSET1.

O Diretor de Compliance, Risco e PLD e a Área de Risco atuam de forma preventiva e constante para alertar, informar e solicitar providências aos gestores frente a eventuais desenquadramentos de limites normativos e aqueles estabelecidos internamente.

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

Sistemas: A ASSET1 utiliza-se de modelos e planilhas proprietárias e do sistema Lote 45 para monitorar riscos de mercado, liquidez e limites de alocação conforme a regulamentação em vigor, o regulamento dos fundos de investimento e demais documentos, bem como na sua Política de Gestão de Risco.

Rotina e Procedimentos: As rotinas e procedimentos do Diretor de Compliance, Risco e PLD e da Área de Risco, especificamente em relação às atividades de gestão de riscos, constam expressamente da Política de Gestão de Risco da ASSET1, e poderão variar de acordo com o tipo de risco envolvido, considerando a operação objeto do controle.

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

Conforme indicado no item 8.9(d) acima, o Diretor de Compliance, Risco e PLD não tem participação em decisões de investimento (exceto nas decisões envolvendo temas específicos de riscos e compliance). Dentro da governança, o Diretor de Compliance, Risco e PLD possui total autonomia no exercício de suas atividades, visto que, em conjunto com a Área de Risco, fazem parte da maioria votante no Comitê de Riscos e Liquidez.

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

a. Quantidade de profissionais

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

N/A

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

N/A

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

a. Quantidade de profissionais

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

N/A

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

N/A

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

N/A



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

N/A

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

N/A

9. Remuneração da Empresa

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

A ASSET1 cobra taxa de administração sobre o patrimônio líquido gerido e taxa de performance para se remunerar. Neste sentido, a ASSET1 apresenta abaixo os percentuais que cobra a título de remuneração pela prestação dos seus serviços: (i) uma taxa de administração, expressa em percentual sobre o valor dos recursos sob gestão; e (ii) uma taxa de performance, expressa em percentual com métrica que leva em consideração o retorno dos investimentos.

Buscando sempre apresentar uma proposta competitiva ao mercado para o desenvolvimento de suas atividades, a ASSET1 cobra pelos seus serviços uma taxa de administração equivalente a até 2,10% a.a., sendo certo que os valores de remuneração poderão ser impactados de acordo com os produtos a serem geridos pela ASSET1, considerando fatores como complexidade da estrutura, condições de mercado, foco dos investimentos da carteira e modelo de gestão. Quanto à taxa de performance, a ASSET1 cobra 20% da rentabilidade excedente sobre indicadores específicos.

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

a. Taxa com bases fixas (%):

95,21

b. Taxa de performance (%):

4,79

c. Taxa de ingresso (%):

0,00

d. Taxa de saída (%):

0,00

e. Outras taxas (%):

0,00

Total (%):

100,00

9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:

N/A

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

A Política de Seleção e Contratação de Terceiros tem como objetivo definir o processo de contratação e supervisão do terceiro a serem adotados pela ASSET1, em nome dos fundos de investimento sob sua gestão.

No âmbito da sua atividade de gestão de recursos e em nome das carteiras de valores mobiliários sob sua gestão, a ASSET1 identificou que os únicos prestadores de serviços objeto da Política são as Corretoras de Títulos e Valores Mobiliários, razão pela qual considera-se, para fins da Política, como "Terceiro" tais prestadores de serviços.

A seleção e contratação de Terceiros é um processo conduzido de forma conjunta pelo Diretor de Gestão, responsável pela seleção e indicação dos potenciais contratados, do Diretor de Compliance, Risco e PLD e da Área de Compliance que é responsável pela condução do processo de due diligence prévio à contratação.

O Diretor de Compliance, Risco e PLD e/ou área de Compliance exigirão, no que couber, a documentação comprobatória das informações prestadas. Caso não seja possível aferir a veracidade da informação por meio de documentos comprobatórios, o Diretor de Compliance, Risco e PLD e/ou área de Compliance envidarão melhores esforços para conferir tais informações.

O início das atividades do Terceiro deve ser vinculado à formalização da contratação, e nenhum tipo de pagamento poderá ser efetuado antes da celebração do contrato. As tratativas acerca do vínculo contratual serão conduzidas pela Área de Compliance.

Após a contratação do Terceiro, a ASSET1 realizará o monitoramento contínuo das atividades exercidas pelos Terceiros contratados, até o término do prazo da contratação. O monitoramento será de responsabilidade da Área de Compliance com a supervisão do Diretor de Compliance, Risco e PLD, conforme processo descrito no capítulo 8.9 item b.

A partir dos elementos supracitados, a área de Compliance confeccionará, em periodicidade mínima anual, um relatório a ser enviado por e-mail - com confirmação de recebimento - aos demais diretores e sócios do ASSET1, para fins de ciência.

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

A ASSET1 realiza um acompanhamento diário de todos os custos de transações com valores mobiliários. Diariamente a planilha com os custos e respectivas corretoras é disponibilizada ao Diretor de Gestão. De forma a minimizar os custos, a ASSET1 atua com poucos parceiros por tipo de estratégia, para assim ter um maior volume com cada um deles e consequentemente taxas de devoluções maiores, beneficiando seus cotistas.

Semestralmente, é feito um monitoramento dos custos por Corretora para avaliar a necessidade de adequação das taxas de rebates vis à vis os volumes de transação processadas. Esses custos são apresentados no Comitê Semestral de Corretoras onde são avaliados os quesitos de distribuição e qualidade dos serviços prestados.

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

Em termos gerais, Soft Dollar pode ser definido como sendo o benefício econômico, de natureza não pecuniária, eventualmente concedido às entidades gestoras de recursos por corretoras de títulos e valores mobiliários ou outros fornecedores, em contraprestação ao direcionamento de transações dos fundos de investimento e carteiras geridos pelas entidades gestoras de recursos, para fins de auxílio no processo de tomada de decisões de investimento em relação aos respectivos fundos e carteiras.

A ASSET1, por meio de seus representantes, deverá observar determinados princípios e regras de conduta ao firmar acordos de Soft Dollar, conforme consta do seu Manual de Controles Internos, disponível em sua página na internet e Intranet.

Os acordos de Soft Dollar devem ser transparentes e mantidos por documento escrito. A ASSET1 deverá manter registros dos benefícios recebidos, identificando, se possível, a capacidade de contribuir diretamente para o processo de tomada de decisões de investimento, visando comprovar o racional que levou a firmar tais acordos de Soft Dollar.

Quaisquer benefícios não relacionados ao processo de tomada de decisão de investimentos, tais como pagamento de despesas de escritório, viagens, entretenimento, entre outros, não devem ser objeto de Soft Dollar.

No Comitê Semestral de Corretoras esse tema é pautado para que possamos garantir que os preceitos relativos ao processo de Soft Dollar sejam aplicados.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

O Plano de Contingência e Continuidade dos Negócios ("Plano de Contingência") prevê ações que durem até o retorno à situação normal de funcionamento da ASSET1 dentro do contexto de seu negócio, identificando duas variáveis para o funcionamento adequado da empresa: infraestrutura e processos.

De forma geral, o Plano de Contingência será acionado quando for identificada qualquer ocorrência ou situação que dificulte ou impeça a rotina diária da operação, o que pode causar impactos financeiros, legais/regulatórios e de imagem, entre outros, aos clientes da ASSET1 e à ASSET1 propriamente dita.

Neste cenário, considera-se basicamente a impossibilidade ou dificuldade de manter o funcionamento normal da ASSET1 devido a problemas de ordem técnica (hardware), física (acesso ao escritório), pessoal (ausência significativa de funcionários) e de infraestrutura (falta de energia).

Nessa situação, o Diretor de Compliance, Risco e PLD deverá acionar o Plano de Contingência, em caráter imediato, e iniciar também imediatamente a avaliação das causas que geraram a contingência para providenciar sua solução o mais rapidamente possível, bem como dar início ao efetivo cumprimento dos procedimentos descritos abaixo: (a) Comunicar imediatamente o ocorrido à toda a equipe interna, via ligação celular, grupo corporativo da empresa em aplicativo de mensagens ou qualquer outro meio à sua disposição, indicando nessa oportunidade qual o procedimento a ser adotado por cada colaborador de acordo com a contingência ocorrida; e (b) Caso seja verificada a necessidade de sair do escritório da ASSET1, os colaboradores poderão continuar a desempenhar suas atividades através de Home Office, uma vez que todos os arquivos podem ser acessados pela nuvem, conforme descrito no Plano de Contingência. A continuidade das operações da ASSET1 deverá ser assegurada no próprio dia útil da ocorrência da contingência no escritório físico, de modo que as atividades diárias não sejam interrompidas ou gravemente impactadas.

O Diretor de Compliance, Risco e PLD deverá acompanhar todo o processo acima descrito até o retorno à situação normal de funcionamento dentro do contexto das atividades desempenhadas pela ASSET1 e reportar eventuais alterações e atualizações da contingência aos demais colaboradores.

Para maiores informações, as versões atualizadas do Plano de Contingência estão disponíveis na sede da ASSET1 e no site www.asset1.com.br

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

O Risco de Liquidez é observado a partir da possibilidade de o fundo de investimento não ser capaz de honrar eficientemente suas obrigações esperadas e inesperadas, correntes e futuras, inclusive as decorrentes de vinculação de garantias, sem afetar suas operações diárias e sem incorrer em perdas significativas, bem como é a possibilidade de o fundo de investimento não conseguir negociar a preço de mercado uma posição, devido ao seu tamanho elevado em relação ao volume normalmente transacionado ou em razão de alguma descontinuidade no mercado.

O gerenciamento de liquidez é realizado diariamente, com base em tamanho de posições, limites de exposição setoriais e determinados grupos de risco.

Como forma de controle, será estabelecido valor máximo de resgate esperado para cada carteira com base na matriz de liquidez da Anbima. O percentual do patrimônio líquido que pode ser liquidado até a respectiva data de cotização, com base no número de dias necessários para a liquidação de cada posição, deve ser superior a esse limite. O valor de liquidação dos ativos deve ser calculado com base no volume médio de negociação, conforme definido pelo Diretor de Risco. O controle da liquidez dos ativos inseridos nas carteiras dos fundos é realizado com base na análise comparativa entre o volume histórico de negociação dos ativos numa janela móvel em dias úteis definida pelo Comitê de Risco, e é feita respeitando as particularidades e premissas adotadas para cada tipo de ativo. De acordo com suas características, os fundos devem operar com montante suficiente da posição diária em caixa ou ativos extremamente líquidos. Para se estimar o percentual executável pela ASSET1, utiliza-se uma visão conservadora, levando em conta o volume médio negociado em um período e o giro histórico. O tratamento dos ativos utilizados como margem, ajustes e garantias deve considerar os seguintes aspectos: liquidez dos ativos, participação de cada ativo na carteira dos fundos e expectativa da ASSET1 em relação à manutenção dos ativos em carteira. Ativos em margem são considerados ilíquidos por um período definido pela área de risco, após esse período a análise de liquidez desses ativos segue a mesma metodologia dos demais. São criados cenários de stress diariamente, diminuindo a porcentagem do volume médio de giro utilizada na análise de liquidez, aumentando o tempo em que os ativos em margem permanecem ilíquidos e multiplicando as projeções de passivos por fatores agravantes.

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

Não aplicável, tendo em vista que a ASSET1 não atuará na distribuição de cotas dos fundos sob sua gestão.

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

WWW.ASSET1.COM.BR



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

11. Contingências

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

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

a. Principais fatos *

N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas.

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

a. Principais fatos

N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas

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

N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas

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

a. Principais fatos

N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas

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

N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas

b. Valores, bens ou direitos envolvidos



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas

12. Declarações

Declaração do administrador, atestando:

Que reviu o formulário de referência

Marcado

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

Marcado

Declarações adicionais do administrador, informando sobre

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

Nada a declarar

Marcado

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

Nada a declarar

Marcado

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

Nada a declarar

Marcado

Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

Nada a declarar

Marcado

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

Nada a declarar

Marcado



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Títulos contra si levados a protesto

Nada a declarar

Mercado

Data de envio: 26/03/2024 - 10:29:00

Data de impressão: 26/03/2024

Hora de impressão: 10:31:15