



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: 45.356.564/0001-08

Nome do Administrador de Carteira: BMA CAPITAL GESTAO DE RECURSOS LTDA.

Ano de competência: 2023

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A Sociedade foi constituída em fevereiro de 2022 com o objetivo de prestar serviços de gestão profissional de recursos de terceiros focado para Fundos de Investimento em Direitos Creditórios. Obteve o seu credenciamento perante a CVM em agosto de 2022.

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

Em fevereiro de 2022, por meio da 1ª Alteração Contratual, parte do capital social foi adquirido pelo Sr. Bruno Moysés Assumpção, mediante a venda de cotas pela Sra. Camila Carvalho Assumpção.

b. Escopo das atividades

A Sociedade alterou em fevereiro de 2022, por meio da 1ª Alteração Contratual, o seu objeto social, passando sua atividade exclusiva ser a prestação de serviços de gestão de carteiras de títulos e valores mobiliários de terceiros, nos termos da regulamentação da Comissão de Valores Mobiliários - CVM.

c. Recursos humanos e computacionais

Recursos Humanos:

A Sociedade conta com uma equipe formada por 43 (quarenta e três) colaboradores divididos da forma a seguir descrita.

O departamento de gestão é formado por 03 (três) integrantes:

- Bruno Moysés Assumpção (Diretor de Gestão);
- Ana Paula Tavares (Analista de investimentos);
- Fabiana de Souza Moreira (Analista de Investimentos).

Ademais, o Diretor de Gestão e a Equipe de Análise contam com suporte das seguintes áreas auxiliares:

- Equipe de Crédito: 6 (seis) colaboradores;
- Equipe de Cobrança: 7 (sete) colaboradores;
- Equipe Operacional: 5 (cinco) colaboradores;
- Equipe Financeiro: 4 (quatro) colaboradores.

O departamento de Risco, Compliance e PLD é formado por 2 (dois) integrantes:

- Priscilla Cardoso Campos (Diretora de Risco, Compliance e PLD); e
- Andreia Costa (Analista de Risco, Compliance e PLD).

Ademais, a Diretora e a Analista de Risco, Compliance e PLD contam com suporte das seguintes áreas auxiliares:

- Equipe de Checagem/Enquadramento: 15 (quinze) colaboradores;
- Equipe de TI: 1 (uma) colaboradora.

Recursos Computacionais:

Não houve alterações relevantes nos recursos computacionais da Sociedade, os quais encontram-se em constante atualização.

d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Atualizações realizadas nos Manuais e Políticas, de modo que hoje a Sociedade conta com:

- Código de Ética e Conduta;
- Manual de Compliance;
- Política de Gestão de Riscos;
- Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Financiamento do Terrorismo;
- Política de Investimentos Próprios;
- Política de Segurança da Informação, Segurança Cibernética e Proteção de Dados;
- Plano de Continuidade de Negócios;
- Política de Seleção, Contratação e Monitoramento de Prestadores de Serviço;
- Política de Decisão de Investimentos, Seleção e Alocação de Ativos;
- Política de Voto;
- Política de Certificação e Manutenção da Base de Dados;
- Declaração de Inaplicabilidade da Política de Rateio e Divisão de Ordens.

Tais políticas são revisadas sempre que modificados os seus controles internos para fins de adaptação das exigências das normas da regulação e autorregulação e revisadas dentro da periodicidade determinada internamente, não ultrapassando o prazo máximo de 02 (dois) anos, salvo se estabelecido um prazo inferior pela legislação em vigor.

3. Recursos Humanos

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

a. Número de sócios:

2

b. Número de empregados:

43

c. Número de terceirizados:

0

CPF	Nome
011.818.286-27	BRUNO MOYSÉS ASSUMPÇÃO

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
------------------	---------------------	-----------

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



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

Sim

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

Sim

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

Demonstração Financeira: Não se aplica

Relatório: Não se aplica

6. Escopo das Atividades

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

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

Gestão Discricionária.

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

Fundos de investimento em direitos creditórios.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Direitos creditórios, ativos de crédito privado, títulos públicos e cotas de fundos.

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

A sociedade tem por objeto social exclusivo a prestação de serviços gestão de carteira de títulos e valores mobiliários de terceiros, nos termos da regulamentação da Comissão de Valores Mobiliários - CVM.

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

N/A. A Sociedade não se insere em um grupo econômico.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
a. Número de investidores	3	0	3

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)	2	0	2
iii. Instituições Financeiras	1		1
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0		0
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	0		0
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	0		0
xi. Investidores não Residentes	0		0

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

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	3	0	3

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 519.260.958,00	R\$ 0,00	R\$ 519.260.958,00

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

R\$ 0,00

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

**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

Valor	Nome
R\$ 365.076.728,58	
R\$ 86.886.438,48	
R\$ 67.297.790,94	

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\$ 154.184.229,42	R\$ 0,00	R\$ 154.184.229,42
iii. Instituições Financeiras	R\$ 365.076.728,58		R\$ 365.076.728,58
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
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\$ 0,00		R\$ 0,00
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
	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 519.260.958,00	R\$ 0,00	R\$ 519.260.958,00

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\$ 0,00
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R\$ 4.476.040,66
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\$ 89.473.079,13
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 0,00
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 0,00
k. Outros valores mobiliários	R\$ 0,00
l. Títulos públicos	R\$ 3.287.057,93
m. Outros ativos	R\$ 422.024.780,28
Total	R\$ 519.260.958,00

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

N/A, posto que a Sociedade atua exclusivamente como gestora de recursos.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não há mais informações que a Sociedade julgue importante.

7. Grupo Econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
00.001.200/5196-63	CAMILA CARVALHO ASSUMPÇÃO

b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
-	Não Informado

c. Participações da empresa em sociedade do grupo

CNPJ	Nome
-	Não Informado

d. Participações de sociedades do grupo na empresa

CNPJ	Nome
-	Não Informado

e. Sociedades sob controle comum



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

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

Departamento de Risco, Compliance e PLD/FTP: adoção, avaliação e monitoramento dos controles internos, bem como coordenação dos procedimentos relacionados à prevenção à lavagem de dinheiro, ao financiamento ao terrorismo e ao financiamento da proliferação de armas de destruição em massa. Formalização da metodologia de monitoramento dos riscos das carteiras sob gestão da Sociedade, bem como dos riscos operacionais relacionados às suas atividades.

Equipe de Checagem/Enquadramento: responsável pelo acompanhamento das operações diárias; elaboração de relatórios de modo a mitigar riscos/problemas com atrasos na entrega e pré-faturamento, promovendo qualidade desejada à carteira e visando adequação da relação de risco x sacado; consulta aos sistemas sobre o sacado com objetivo de validação dos dados internos; acompanhamento das alterações de risco; e elaboração de relatórios da checagem de modo a subsidiar o trabalho da área de gestão de riscos.

Departamento de Gestão: responsável pela gestão profissional de recursos de terceiros, análise e seleção de ativos.

Equipe de Crédito: responsável por realizar análises de operações de antecipações de recebíveis; realizações de recompras; acompanhamento de carteiras; conferência de lastro; realização de estudo do crédito e partes envolvidas, analisando os dados para liberação do recurso; verificação de Serasa e sites de proteção do crédito.

Equipe de Cobrança: responsável por analisar operações de cobrança, acompanhar o processo de liquidação, localizar pagamentos efetuados, providenciar baixa no sistema e identificação de pendências.

Equipe Operacional: responsável pelo acompanhamento da carteira dos fundos e verificação do enquadramento das estratégias e política de investimento; acompanhamento diário das operações de desconto de recebíveis, analisando a qualidade das garantias propostas e prevenindo contra fraudes, associado ao controle de concentrações, prazos, liquidez e resultado da carteira; análise e controle da documentação para cadastro e emissão de contratos.

Equipe Financeiro: responsável por acompanhar as operações e seus vencimentos.

Equipe de TI: responsável pelo acompanhamento da performance e garantia do bom e correto funcionamento dos sistemas de gestão e controles. Gestão dos prestadores de serviços externos relacionados à área de TI e atendimento a usuários dos equipamentos de TI instalados na empresa.

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

A Sociedade não adota comitês em sua estrutura interna, em função do seu porte e ramo de atuação. A tomada de decisão de investimentos e desinvestimentos será realizada discricionariamente pelo Diretor de Gestão, sendo a documentação pertinente arquivada na Sociedade de forma eletrônica.

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



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

BRUNO MOYSÉS ASSUMPÇÃO: responsabilidade pela atividade de gestão de carteiras, na qualidade de Diretor de Gestão.

PRISCILLA CARDOSO CAMPOS: responsabilidade pela atividade de gestão de risco, pelas atividades atinentes à adoção, manutenção e cumprimento dos controles internos e das normas de prevenção à lavagem de dinheiro, ao financiamento do terrorismo e ao financiamento da proliferação de armas de destruição em massa, na qualidade de Diretora de Risco, Compliance e PLD/FTP.

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
-----	------	-------	-----------	-------	---------------	------------------	---------------

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	00.001.181/8286-27	BRUNO MOYSÉS ASSUMPTÃO	43	ECONOMISTA	DIRETOR DE GESTÃO	01/08/2022	SEM PRAZO DEFINIDO		- Graduação em Economia pela UFMG (2002); - MBA Finanças Avançadas pela FGV (2004).	- CFG (ANBIMA); - CGA (ANBIMA); - CGE (ANBIMA)
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	00.007.962/5596-24	PRISCILLA CARDOSO CAMPOS	35	ATUÁRIA	DIRETORA DE RISCO	01/08/2022	SEM PRAZO DEFINIDO		- Ciências Atuariais - Pontifícia Universidade Católica de Minas Gerais - PUC-MG; - Curso ANBIMA Compliance Legal, Ética e Análise do Perfil do Investidor; - Curso ANBIMA Trilha Gestão do Risco de Mercado; - Curso ANBIMA Gestão de Riscos e Performance.	CPA-20



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 (COMPLIANCE)	00.007.962/5596-24	PRISCILLA CARDOSO CAMPOS	35	ATUÁRIA	DIRETORA DE COMPLIANCE	01/08/2022	SEM PRAZO DEFINIDO		- Ciências Atuariais - Pontifícia Universidade Católica de Minas Gerais - PUC-MG; - Curso ANBIMA Compliance Legal, Ética e Análise do Perfil do Investidor; - Curso ANBIMA Trilha Gestão do Risco de Mercado; - Curso ANBIMA Gestão de Riscos e Performance.	CPA-20
---------------------	--------------------	--------------------------	----	---------	------------------------	------------	--------------------	--	--	--------

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

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída
00.001.181/8286-27	BRUNO MOYSÉS ASSUMPÇÃO	BMA Soluções de Crédito Ltda	Sócio e CEO	Consultoria especializada não regulada	29/11/2005	
00.001.181/8286-27	BRUNO MOYSÉS ASSUMPÇÃO	BMA Capital Gestão de Recursos Ltda	Diretor de Gestão	Gestão de Recursos	24/03/2022	
00.007.962/5596-24	PRISCILLA CARDOSO CAMPOS	BMA Capital Gestão de Recursos Ltda	Diretora de Risco, Compliance e PLD	Gestão de Recursos	24/03/2022	
00.007.962/5596-24	PRISCILLA CARDOSO CAMPOS	BMA Soluções de Crédito Ltda	Diretora Operacional	Consultoria especializada não regulada	02/07/2007	18/10/2022

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

a. Quantidade de profissionais



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. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Monitoramento e análise de oportunidades de investimentos em direitos creditórios e ativos de crédito para os fundos de investimento sob gestão, bem como acompanhamento do desempenho dos investimentos que venham a ser realizados pelos fundos sob gestão.

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

Dado o foco na gestão de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios, os principais sistemas de informação utilizados para avaliar o crédito dos emissores são o Vadu, o Assertiva e o AML Risco Reputacional, para varredura em bancos de dados públicos, a fim de avaliar informações que possam influenciar no risco dos emissores, e da ferramenta RGBsys para auxílio na gestão de recebíveis. De forma a complementar essas ferramentas, pesquisas em bases de dados acessíveis na web também são regularmente utilizadas (sites de tribunais, cartórios, receita federal, estadual e municipal etc.).

Os procedimentos e rotinas envolvidos encontram-se descritos de forma detalhada na Política de Decisão de Investimentos, Seleção e Alocação de ativos da Sociedade.

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

18

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Elaboração, implementação e monitoramento do efetivo cumprimento das rotinas e procedimentos internos visando a mitigação dos riscos inerentes à atividade desenvolvida pela Sociedade, bem como o integral atendimento às normas regulamentares desta atividade. Nesse sentido, as rotinas adotadas pelo Departamento de Compliance e PLD/FTP são respaldadas pelo Manual de Compliance adotado pela Sociedade, competindo à Diretora de Risco, Compliance e PLD/FTP apresentar os manuais e políticas internas aos colaboradores; adequar as diretrizes internas às normas e instruções dos órgãos reguladores e autorreguladores; monitorar o cumprimento da política de segurança da informação; elaborar, implementar e garantir a manutenção anual do plano de treinamento aos colaboradores; conduzir os casos de descumprimento dos controles internos, dentre outras rotinas.

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

São utilizadas planilhas proprietárias para o controle e registro do resultado das rotinas de fiscalização e monitoramento mantidos pelo Departamento de Risco, Compliance e PLD, além do sistema AML Risco Reputacional para fins de PLD/FTP. Desse modo, uma vez verificada a inobservância das normas de conduta e políticas estabelecidas pela Sociedade, a Diretora de Risco, Compliance e PLD analisará o caso, podendo aplicar a título de enforcement as sanções previstas nos manuais internos.

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

A Diretora de Compliance, Risco e PLD dedica-se com exclusividade a estas atividades e, por isso, possui total independência e autonomia para o exercício das suas funções. Apesar de não ser sócia da Sociedade, a Diretora de Compliance possui todas as prerrogativas para o exercício das suas atividades de forma independente e autônoma, tendo total liberdade para fiscalizar as atividades desempenhadas pelos demais profissionais, a fim de verificar o cumprimento da regulação, autorregulação e procedimentos internos. Caso seja identificada irregularidade, o Compliance possui autonomia para aplicação das regras de enforcement definidas no Código de Ética e Conduta.

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

a. Quantidade de profissionais *

18

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

Monitoramento do enquadramento das operações efetuadas nos limites definidos na Política de Gestão de Riscos adotada internamente.

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

A Sociedade vale-se dos seguintes veículos de informação e sistemas para apoio gestão dos riscos das carteiras: Vadu, Assertiva e RGBsys.

Os controles utilizados permitem monitorar em curto espaço de tempo e com dados confiáveis o desempenho dos ativos adquiridos e a consistência entre os resultados planejados e realizados, bem como outras rotinas e procedimentos envolvidos que se encontram descritos nos manuais e políticas adotados internamente, em especial na Política de Gestão de Riscos da Sociedade.

Os referidos sistemas são essenciais para acompanhamento das operações diárias e elaboração de relatórios de modo a mitigar riscos/problemas com atrasos na entrega e pré-faturamento, promovendo qualidade desejada à carteira e visando adequação da relação de risco x sacado; consulta aos sistemas sobre o sacado com objetivo de validação dos dados internos; acompanhamento das alterações de risco; e elaboração de relatórios da checagem de modo a subsidiar o trabalho da área de gestão de riscos. Tais atividades são desenvolvidas pela Equipe de Checagem e servem de subsídios para acompanhamento dos limites de risco pré-estabelecidos pela Equipe de Risco.

Mensalmente são consolidados os dados de monitoramento no relatório de risco mensal.

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

A Diretora de Compliance, Risco e PLD dedica-se com exclusividade a estas atividades e, por isso, possui total independência e autonomia para o exercício das suas funções.

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

a. Quantidade de profissionais

0

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

N/A, posto que a Sociedade não desempenha atividade de tesouraria, controle e processamento de ativos e escrituração de cotas.

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

N/A, posto que a Sociedade atua exclusivamente como gestora profissional de recursos de terceiros.

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

a. Quantidade de profissionais

0

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

N/A, posto que a Sociedade não desempenha a atividade de distribuição

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

N/A, posto que a Sociedade não desempenha a atividade de distribuição.



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

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

N/A, posto que a Sociedade não desempenha a atividade de distribuição

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

N/A, posto que a Sociedade não desempenha a atividade de distribuição

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

Não há outras informações relevantes

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:

Os produtos geridos são remunerados através de taxa de administração de 2,5% ao ano.

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 (%):

100,00

b. Taxa de performance (%):

0,00

c. Taxa de ingresso (%):

0,00

d. Taxa de saída (%):

0,00

e. Outras taxas (%):

0,00

Total (%):

100,00

9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:

Não há.

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 Sociedade adota um processo de diligência perante todo prestador de serviço que venha a ser contratado com o objetivo de avaliar a relação custo x qualidade da contratação e que se encontra registrado na Política adotada internamente. De forma resumida, o processo de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços consiste na avaliação do potencial do contratado em agregar valor às atividades da Sociedade, assim como na verificação da sua regularidade e idoneidade em seu serviço e preço, sendo realizada análise criteriosa através de um processo de seleção, diligência e coleta de documentação e, a supervisão e monitoramento dos mesmos consistem em uma metodologia de Supervisão Baseada em Risco.

Após a contratação, o Departamento de Compliance, Risco e PLD/FTP é responsável pelo monitoramento da prestação dos serviços contratados, indicando eventuais não-conformidades e ressalvas no processo de contratação e durante a prestação do serviço contratado.

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

Dado o foco na gestão de direitos creditórios e ativos de crédito, os custos de transação com valores mobiliários se resumem aos custos associados à gestão de caixa das carteiras através da compra e venda de títulos. Tais custos de transação buscam ser minimizados reduzindo-se o volume de transações e utilizando-se instrumentos alternativos com custo de transação menor ou inexistente (como fundos de liquidez e operações compromissadas).

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

É estritamente proibido o recebimento ou oferecimento de entretenimento, presentes, cursos, viagens ou demais benefícios de qualquer valor a/de funcionários públicos, pessoas ou organizações particulares ou públicas. Em caráter excepcional, nos casos de pessoas ou entidades que possuam relacionamento comercial com a Sociedade, é permitido o recebimento de presentes em valor de até R\$ 500,00 (quinhentos reais), conforme expressamente previsto no Código de Ética e Conduta adotado internamente.

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

A Sociedade conta com um Plano de Continuidade de Negócios, cuja ativação consiste no acesso aos dados e informações necessárias ao desempenho das respectivas atividades, através de local diverso da sede social. Dentre as soluções apresentadas estão: backup on time na nuvem e acesso remoto aos e-mails e arquivos, através da senha de acesso.

Ademais, para assegurar a manutenção da continuidade dos negócios, a Sociedade mantém de forma atualizada uma estrutura de tecnologia da informação e cibernética compatível com o volume e complexidade de suas operações, além de sistemas que assegurem a proteção integral contra adulterações e com redundância.

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

Em primeiro lugar, vale destacar que a Sociedade realiza a gestão apenas de fundos fechados dado a iliquidez intrínseca ao investimento em direitos creditórios e ativos de crédito. Dessa forma, o controle de liquidez se dá no momento da aquisição dos direitos creditórios e demais ativos para o que prazo de vencimento desses seja compatível (menor) que o prazo das amortizações programadas ou agendadas das carteiras.

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

N/A, posto que a Sociedade não desempenha a atividade de distribuição

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.bmaasset.com.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.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

a. Principais fatos *

A Sociedade não figura no polo passivo de nenhum processo judicial, administrativo ou arbitral, sob sigilo ou não, que sejam relevantes para os negócios da mesma.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Diante do exposto acima, não há valores, bens ou direitos envolvidos em processos judiciais, administrativos ou arbitrais, sob sigilo de justiça ou não.

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

O Diretor responsável pela atividade de administração de carteira de valores mobiliários não figura no polo passivo de processos judiciais, administrativos ou arbitrais, seja sob sigilo de justiça ou não, que afete a sua reputação como profissional.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Diante do exposto, não há valores, bens ou direitos envolvidos em demandas judiciais, administrativas ou arbitrais.

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

Não há outras informações relevantes ou contingências a declarar.

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

a. Principais fatos

Não houve condenação em processos judiciais, administrativos ou arbitrais para ocorrer o trânsito em julgado de qualquer decisão em processos em que a empresa tenha figurado no polo passivo.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não se aplica.

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 houve condenação judicial, administrativa ou arbitral transitada em julgado em processos que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo.

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

Não se aplica.

12. Declarações

Declaração do administrador, atestando:

Que reviu o formulário de referência

Mercado

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)

Mercado

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

Mercado

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

Mercado

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

Nada a declarar

Mercado

Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

Nada a declarar

Mercado

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

Nada a declarar

Mercado



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

Marcado

Data de envio: 14/03/2024 - 11:23:00

Data de impressão: 14/03/2024

Hora de impressão: 11:27:49