



OCCAM
BRASIL

Gestora

1 – O gestor do fundo está devidamente autorizado para exercer a função pela CVM?

Sim.

Autorização CVM para o exercício de administração de carteira de valores mobiliários, por meio do Ato Declaratório da CVM nº 15.821 de 11/08/2017, publicado no D.O. dia 14/08/2017.

2- Os profissionais da gestão que possuem alçada para decisão sobre aplicações, estão devidamente certificados, nos termos do código ANBIMA?

Sim. Somos signatários do Código para o Programa de Certificação Continuada da Anbima.

3- A gestora recebe rebate pela alocação em ativos financeiros, quais as regras?

Não. Todas as devoluções de corretagem são revertidas diretamente para os próprios fundos. As devoluções são negociadas levando-se em consideração a qualidade do serviço ofertado/prestado, objetivando sempre o melhor custo-benefício para o fundo e seus cotistas.

4- Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?

Não existe uma política de rebate única a todos os distribuidores, as regras vão variar de acordo com o montante alocado.

5- Na compra de um ativo como é feita a distribuição nos fundos da entidade?

Segue anexa nossa Política de Rateio de Ordens.

6- Existe pré-boletagem?

Sim, os gestores registram as operações ao longo do dia em um sistema interno.

7- Como funciona o chinês wall em caso de a gestora possuir outras atividades?

N/A

8- Toda a decisão de investimento passa pelo compliance?

A gestão obedece às políticas e manuais internos e à todas as regras regulatórias. O Compliance controla diariamente o enquadramento das operações para que estejam sempre em conformidade com os regulamentos e controles internos.

9- Caso haja uma posição contrária do compliance quem determina a efetivação da posição?

A área de Risco e Compliance é soberana a todas as decisões de investimento com relação as operações dos Fundos de investimento.

10- Como é verificado a adesão dos limites de risco, limites legais ou regulamentares das posições dos fundos sob gestão? Existe alguma consultoria que auxilia esse processo?

Os gestores registram as operações ao longo do dia em sistema desenvolvido internamente. De acordo com o risco, patrimônio líquido e as regras de compliance e enquadramento de cada fundo, as boletas são divididas e atualizam a carteira online (sistema proprietário desenvolvido internamente). Ao final do dia, o backoffice concilia as boletas geradas pelos gestores (ativo, preço e quantidade) com as respectivas corretoras e lhes informa por email a alocação de cada operação nos respectivos fundos. As

operações já alocadas pelas corretoras são conferidas novamente e lançadas nos sistemas dos administradores e clearings.

11- Se existe, como são tratados os conflitos de interesse resultantes da participação ou atuação dos sócios ou executivos em outros negócios?

Os colaboradores da Occam Brasil são incentivados a realizar investimentos de longo prazo, que não devem impactar de forma negativa no desempenho de suas atividades profissionais, e que devem ser totalmente segregados das operações realizadas em nome da Sociedade, para que inexistam situações que configurem conflito de interesse. Definimos como instrumentos financeiros passíveis de negociação para fins de investimentos pessoais, sem necessidade de aprovação e tempo de permanência mínimo: títulos ou valores mobiliários de renda fixa e cotas de fundos de investimentos regulados pela CVM. Operações com ativos/derivativos da BMFBovespa não são permitidos. Casos excepcionais são avaliados pelo Compliance. Todas as regras, responsabilidades, permissões, vedações, procedimentos de controle e penalidades quanto aos investimentos pessoais dos colaboradores estão dispostos na Política de Investimentos Próprios, de adesão obrigatória de todos. Na hipótese do Compliance ou de um signatário detectar alguma situação de conflito de interesse, real ou potencial, imediatamente o assunto é levado ao conhecimento da Diretoria e o colaborador se compromete a não realizar a operação ou a se desfazer de sua posição de investimento pessoal. Maiores detalhes em nosso Manual de Compliance e em nossa Política de Investimentos Próprios.

12- A gestora possui consultoria jurídica? Própria ou de terceiros?

A empresa não possui departamento jurídico próprio, utilizando, quando necessário, escritórios de advocacia externos.

13- Aonde fica o dinheiro da tesouraria da instituição?

O caixa da empresa é aplicado em fundos de investimento de renda fixa, com liquidez diária e baixo risco.

Fundos

14- O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo? Onde fica o servidor de armazenamento de informações? E existe redundância?

Sim, perda do histórico ANBIMA em 08/05/2012.

Todos os dados transmitidos pela Asset são armazenados em equipamentos específicos para este fim, com backups periódicos executados pela equipe de infraestrutura e com armazenamento das fitas em locais externos por, no mínimo, 5 anos.

A Asset utiliza hardwares redundantes em toda sua infraestrutura. Todos os dados de sistemas e de banco de dados são armazenados em servidores e storages próprios.

Todos os Data Centers da Asset são interconectados por links de alto desempenho com redundância de operadoras.

15- O fundo sofre ou já sofreu auditoria externa? quem?

Sim. Utilizamos o serviço da KPMG Auditores Independentes.

16- Como é feito o processo de decisão de investimento?

Os gestores possuem como filosofia de investimento rentabilidade com constante preocupação com preservação de capital. Alia-se análise fundamentalista à gestão ativa das posições e administração constante de risco.

Inicialmente os temas e cenários são discutidos em reuniões semanais entre gestores e analistas que realizam estudos macroeconômicos top down e análises micro bottom up. Além disso, o amplo network dos gestores/analistas também é usado como fonte de informações.

A partir dessa base de análise, os gestores escolhem ativos com melhor risco/retorno para compor a carteira e definem os parâmetros do investimento: exposição e stop loss.

Os parâmetros de risco são avaliados diariamente pelos gestores em reuniões antes da abertura dos mercados para serem ajustados caso haja necessidade. Ao longo do dia podem ocorrer novos ajustes caso exista convergência de preços ou ocorrência de stop-loss.

A volatilidade do mercado é pré-condição para exposição de ativos na carteira e será avaliada diariamente para rebalanceamento.

Adicionalmente existem os comitês relacionados abaixo que fazem parte do processo de decisão de investimento.

Comitê de Investimento Semanal – Presença de todos os gestores e economistas e organizada conforme abaixo. Objetivo de discussões de risco sistemático e não sistemático.

1) Apresentação do economista G10 sobre cenário macro-econômico e político atual e prospectivo.

2) Apresentação do economista Brasil sobre cenário macro-econômico e político atual e prospectivo.

3) A partir destes cenários discussões para potenciais rebalanceamento de posições existentes e/ou a partir de drivers relevantes de mudança dos preços dos ativos. Discussão sobre riscos para exposições atuais e retornos esperados.

4) A partir do cenário discutido é do portfólio existentes, discussões para novas exposições nos fundos e seus potenciais na mudança de composição por fatores de risco são iniciadas. Dúvidas de caráter fundamental podem ser endereçados para análise futura.

Comitê de Renda Variável Semanal: Participam os gestores e analistas de empresas. Sempre que julgar necessário, qualquer membro do Comitê de Renda Variável poderá convocar reunião extraordinária para deliberação sobre algum fato. As reuniões são registradas por atas salvas internamente.

Comitê Macroeconômico Semanal: Participam todos os economistas, gestores macro e analistas macro. Sempre que julgar necessário, qualquer membro do Comitê Macroeconômico poderá convocar reunião extraordinária para deliberação sobre algum fato relevante. As reuniões são registradas por atas salvas internamente.

Comitê de Risco Quinzenal: Participam Diretor de Risco, Diretor de Gestão, um representante da gestão e a equipe de risco. Sempre que julgar necessário, qualquer membro do Comitê de Risco poderá convocar reunião extraordinária para deliberação sobre algum fato relevante. As reuniões são registradas por atas salvas internamente.

Comitê Executivo Mensal: Participam os principais sócios da controladora da gestora. Sempre que julgar necessário, qualquer membro do Comitê Executivo poderá convocar reunião extraordinária para deliberação sobre algum fato. As reuniões são registradas por atas salvas internamente.

Comitê Comercial Semanal: Participam os principais sócios da controladora da gestora e equipe comercial. Sempre que julgar necessário, qualquer membro do Comitê Comercial poderá convocar reunião extraordinária para deliberação sobre algum fato. As reuniões são registradas por atas salvas internamente.

17- Quem são os profissionais envolvidos no processo de gestão do fundo?

Gestor Renda Variável: Carlos Eduardo Rocha;

Gestor Renda Fixa: Pedro Dreux

Gestor Câmbio e Internacional: Fernando Chibante;

Gestor Câmbio e Internacional: Rodrigo Campos;

Gestor Renda Fixa Brasil: Rodrigo Bertrand;

Economista Chefe: Paulo Val;

Economista: Luiz Freitas;

Estagiário de Análise Macro: Bruno Trocoli;

Analista Renda Fixa Brasil: Marcela Ribeiro;

Analistas de Renda Variável: Pedro Menezes, Flávio Machado, Camila Mota, Guilherme Moura, Lucas Maia, Eduardo Peixoto;



OCCAM
BRASIL

Estrategista de Renda Variável & Comercial: Isabel Ramos

Detalhes da experiência profissional estão em nosso site: <http://occambrazil.com.br/quem-somos/>

18 – Existe um limitador para a estratégia do fundo? Volume, quantidade de cotistas?

Acreditamos ser viável até R\$2.000.000.000,00 de AUM, dado nossa estratégia de gestão, liquidez desejada da carteira e casamento entre ativos e passivos.

19- Qual é o Turn-Over da carteira do fundo?

4,9%

20- O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?

N/A

21- Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?

As carteiras podem ser divulgadas semanalmente com a defasagem de 30 dias. Em casos especiais podem ser analisadas a divulgação das carteiras a cotistas em uma frequência maior e/ou defasagem menor.

Rio de Janeiro, 31 de Maio de 2019.

Leonardo de Favero Cruz
Diretor
CPF: 078.939.287-94

OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Rua Dias Ferreira, 190 – 401B
Leblon/RJ