QUESTIONÁRIO *DUE DILIGENCE*

Avaliação de Gestor de Recursos

INTRODUÇÃO

O Instituto de Previdência do Município de Jundiaí – IPREJUN encaminha o questionário *Due Diligence* com o objetivo de abordar aspectos considerados relevantes na avaliação de um Gestor.

Assim, solicitamos que as respostas aos questionamentos apresentados sejam dadas com o máximo detalhamento e, após o completo preenchimento, o retorno se dê através do e-mail diretoria@iprejun.sp.gov.br com, no mínimo, 48 (quarenta e oito) horas de antecedência da diligência presencial.

Quaisquer dúvidas podem ser dirimidas pelo telefone (11) 3109-0583 ou através do e-mail acima indicado.

Atenciosamente.

SEÇÃO I – DADOS CADASTRAIS

1. **Razão Social:** CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES S.A.
2. **Nome Fantasia:** CAIXA DTVM.
3. **Endereço da sede e filiais do Gestor:** Av. Paulista, 750, 7º e 8º andares, Bela Vista, São Paulo, SP, CEP 01310980
4. **CNPJ:** 42.040.639/0001-40
5. **Data de Constituição:** 14 de abril de 2021
6. **Forma de Constituição (estrutura jurídica):**
7. **Telefone:** (011)2220-4380
8. ***Website:*** *https://www.caixa.gov.br/caixa-asset/*

SEÇÃO II - INFORMAÇÕES INSTITUCIONAIS

9. **Quais são as autoridades regulatórias em que a Gestora possui registro? Apresentar detalhamento do registro, como nome, data e número.**

   - CVM - Ato Declaratório CVM nº 19.043, de 31 de agosto de 2021.
   - Banco Central do Brasil – BACEN, conforme decisão publicada no Diário Oficial da União de 27 de setembro de 2021.

10. **A Gestora é membro de Associação de Classe? Qual?**

    - Sim. A CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. (CAIXA DTVM) possui adesão aos códigos da ANBIMA – Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiros e de Capitais, por meio da sua controladora (CAIXA).

11. **O gestor do fundo está devidamente autorizado para exercer a função pela CVM?**
    - Sim.

12. **Quadro societário: nomear os principais sócios da Gestora e respectivas participações percentuais no capital total e votante. No caso de pessoas jurídicas na qualidade de acionistas, deverão ser preenchidas informações para cada acionista, até o nível de controle por pessoa(s) física(s).**

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

13. **Detalhar o currículo de cada sócio da Gestora, incluindo experiências na gestão de fundos e trabalhos anteriores.**
    - N/A

14. **Descrever as principais alterações (entrada e saída de sócios) no quadro societário da Gestora nos últimos 5 (cinco) anos, bem como explicar suas razões**.
    - N/A

15. **Quais são os principais executivos da Gestora? Quais são suas atribuições? Detalhar seu currículo, incluindo experiências na gestão de fundos e em trabalhos anteriores, bem como tempo de permanência em cada área/setor.**

Diretor-Presidente: Humberto José Teófilo Magalhães

É empregado CAIXA desde 1989, possuindo mais de 35 anos de experiência em diversas áreas como Administração Financeira, Open Market, Política e Gestão de Crédito, Recuperação de Ativos, Estratégia de Clientes, Agronegócio, Seguridade, Meios de Pagamento e Produtos de Varejo. Foi Diretor-Presidente da CAIXA Cartões Holding S/A no período de março de 2023 a dezembro de 2024 e exerceu cargos de diretor estatutário na CAIXA como a Diretoria Executiva de Cartões e Meios de Pagamento, Diretoria Executiva de Produtos de Varejo e Diretoria Executiva da CAIXA Seguridade.

Além dos cargos exercidos na CAIXA, atuou como Diretor-Presidente da empresa BRB Seguros S/A e exerceu cargos tais como: Presidente do Conselho de Administração da BRB Serviços; Conselheiro de Administração das empresas AMERICEL, TELET e TELEMIG; Diretor da ABECS – Associação Brasileira das Empresas de Cartões de Crédito e Serviços; membro de Conselhos e Comissões do SEBRAE Nacional e da FEBRABAN. Atualmente é membro do Conselho de Administração da Elo e Presidente do Conselho de Administração da Caixa Seguridade.

É graduado em Direito pela Universidade de Brasília e pós-graduado em Economia pela George Washington University – EUA; possui Certificação Profissional SUSEP e foi Administrador de Carteiras de Valores Mobiliários.

No dia 18 de dezembro de 2024, tomou posse como Diretor-Presidente da CAIXA ASSET.

Em 07 de julho de 2025, tomou posse em recondução como Diretor-Presidente da CAIXA ASSET.

Diretora Executiva - Érika Zamberlan (Interina)

Desde 2003 no mercado financeiro, é responsável atualmente pela Diretoria Executiva de Distribuição e Produto da CAIXA ASSET, com foco em criar estratégias que ressoem com o futuro do mercado de Asset Management.

Pós-graduada nas salas da FIPECAFI, MBA em Mercado de Capitais e possui conhecimentos em Planejamento Financeiro, certificados pela PLANEJAR (CFP – Certified Financial Planner), aperfeiçoados ao longo dos anos dedicados ao relacionamento com grandes investidores de fundos de investimento da CAIXA, com destaque para o relacionamento com clientes Institucionais e RPPS com carteira comercial superior a R$ 50 bilhões de AuM.

Assumiu em 2019 a estratégia de produto fundos de investimento líquidos e estruturados da CAIXA e em 2021 como head de estratégia de produto e inteligência de mercado da CAIXA ASSET.

No dia 13 de novembro de 2024, foi designada para responder interinamente como Diretora Executiva de Distribuição e Produto da CAIXA ASSET.

Diretor Executivo - Marcelo Sudá Maia

É empregado CAIXA desde 1989, possuindo mais de 35 anos de experiência em diversas áreas como Administração Financeira, Investimentos em Fundos de Ativos Mobiliários, Mercado de Câmbio, Open Market, Política e Gestão de Crédito, Recuperação de Ativos Habitacionais, Estratégia de Clientes, Microcrédito, Governança Corporativa, Assessoramento e Administração de Pessoal. Foi Diretor Executivo Financeiro e de Administração da CAIXA Crescer S/A e exerceu cargo de Consultor de Dirigente na CAIXA Participações S/A.

Atuou na CAIXA na concepção, desenvolvimento e implantação do FIES no lugar do CREDUC, do Cartão Virtual e Cartão Mesada da Área de Cartões da CAIXA, implantou o Primeiro Fundo Mobiliário da CAIXA, bem como implantou área de Câmbio da CAIXA (Área Internacional).

Além dos cargos exercidos na CAIXA, atuou como Gestor de Investimentos na FUNCEF e exerceu cargos como Conselheiro de Administração da empresa AMERICEL.

É graduado em Administração de Empresas pelo Centro de Ensino Universitário de Brasília – CEUB e possui MBA em Finanças pelo IBMEC.

Em 22 de abril de 2025, tomou posse como Diretor Executivo da Diretoria de Riscos, Governança, Integridade e Compliance da CAIXA ASSET.

16. **Os sócios ou os principais executivos da Gestora detêm participação em outros negócios? Em caso positivo, detalhar atividades. Há quanto tempo os sócios ou os principais executivos alocam para a Gestora?**
    - Não.

17. **Os sócios ou os principais executivos da Gestora exercem alguma atividade de representação ou governança (cargos em Conselhos, Diretorias, Comissões, Associações etc.) em outras Gestoras ou entidades? Se sim, quais?**
    - N/A

18. **A Gestora é ligada a outros grupos Gestoriais? Quais e de que forma?**
    - A CAIXA DTVM é subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL. A CAIXA ECONÔMICA FEDERAL é uma empresa 100% pública, controlada pelo Governo Federal.

19. **Descreva breve histórico da Gestora.**

    A CAIXA Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários ("CAIXA ASSET" ou "Companhia"), subsidiária integral da CAIXA ECONÔMICA FEDERAL ("CAIXA" ou "Controladora"), foi fundada em 14 de abril de 2021, com sede na cidade de São Paulo, com o objetivo de conferir maior agilidade e eficiência à gestão de recursos de terceiros da Controladora.

    A administração da Companhia é realizada por meio do Conselho de Administração, que conta com a participação de membros independentes, e da Diretoria Colegiada. A gestão da Companhia é fiscalizada por um Conselho Fiscal constituído de forma permanente, conforme exigido pela Lei 13.303/16. A Companhia utiliza ainda, via convênio de compartilhamento, a estrutura de Auditoria Interna da Controladora no monitoramento dos negócios, e as estruturas de ouvidoria e corregedoria.

    No Ranking de Gestão de Fundos de Investimento ANBIMA de dezembro de 2024, a CAIXA ASSET era a 4ª maior gestora de recursos, com R$ 502,16 bilhões em patrimônio líquido sob gestão, representando 5,49% da indústria de gestão de fundos.

    Em dezembro de 2021, a Fitch Ratings atribuiu o Rating de Qualidade de Gestão de Investimentos 'Excelente' à CAIXA ASSET, considerada a nota máxima atribuída pela agência. Em 2022, 2023 e agosto de 2024, a Fitch Ratings reafirmou o Rating de Qualidade de Gestão de Investimentos 'Excelente' da CAIXA ASSET.

    O rating 'Excelente' da CAIXA ASSET reflete a opinião da Fitch de que a gestora tem capacidade de investimento e características operacionais muito fortes em relação às estratégias de investimento, que consistem, sobretudo, em estratégias conservadoras de renda fixa. O rating ainda considera o bem disciplinado processo de investimento, a estrutura organizacional bem segmentada e robusta, a equipe experiente e qualificada, além de sólidos recursos tecnológicos. A classificação incorpora, ainda, o fato de a gestora pertencer à CAIXA, o terceiro maior conglomerado financeiro brasileiro por ativos, caracterizado por

forte franquia, significativa presença de mercado e ampla base de clientes, além das sólidas estruturas de gestão de riscos da gestora e do grupo.

Em março de 2023, a Moody´s Local - BR atribuiu a Avaliação de Qualidade de Gestor de Investimentos MQ1.br (Excelente) à CAIXA ASSET, considerada a nota máxima atribuída pela agência.

Em abril de 2024, a Moody´s Local - BR afirmou o Rating de Qualidade de Gestão de Investimentos MQ1.br (Excelente) da CAIXA ASSET.

A avaliação MQ1.br da CAIXA ASSET reflete a opinião da Moody's Local – BR de que a gestora de recursos tem características de gestão excelentes e é baseada principalmente em:

(i) processo disciplinado de gestão de investimentos da gestora;

(ii) forte cultura fiduciária e procedimentos de gestão de risco bem estruturados;

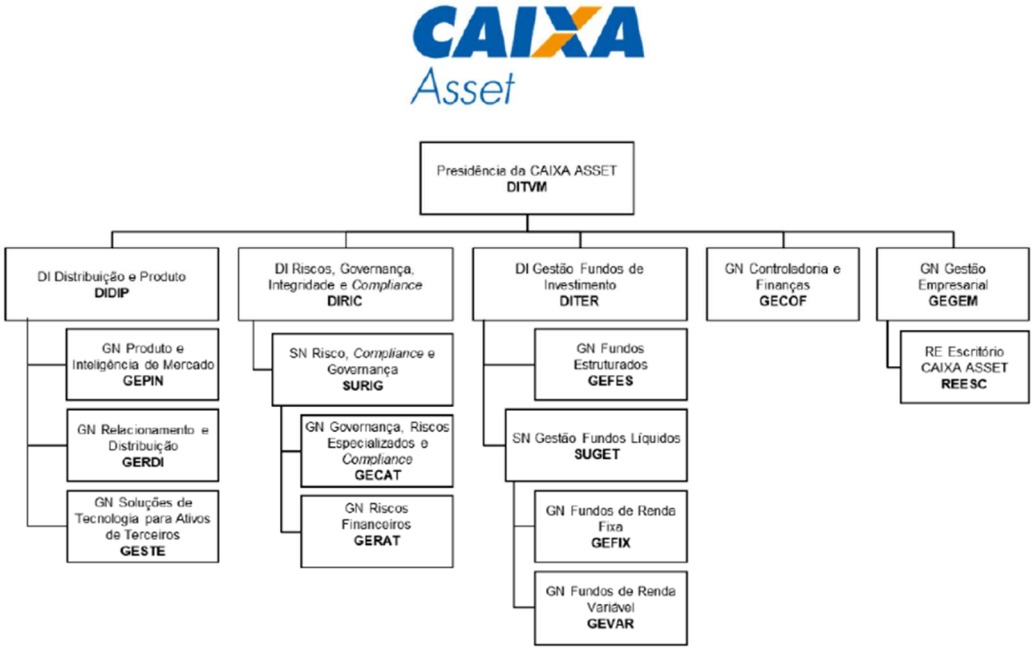
(iii) relevante posição de mercado, entre as maiores gestoras do país, com considerável diversificação de produtos e investidores; e

(iv) suporte e supervisão da sua controladora CAIXA. A Moody´s Local – BR considera que os maiores desafios à frente da CAIXA ASSET são:

(i) expandir seu total de ativos sob gestão em estratégias mais sofisticadas, como ações e
multimercado; e

(ii) melhora do desempenho ajustado ao risco relativo dos fundos de renda fixa, renda fixa curto prazo e previdência renda fixa.

20. **Forneça o organograma detalhado da Gestora.**



21. **Quem é o responsável (ou os responsáveis) pela Gestora perante a CVM?**
Igor Macedo Laino

22. **A Gestora é signatária do Código de autorregulação da ANBIMA?**
Sim. A CAIXA DTVM é signatária dos seguintes Códigos da ANBIMA:
Código ABVCAP/ANBIMA FIP e FIEE.
Código de Administração de Recursos de Terceiros.
Código de Ética;

Código dos Processos da Regulação e Melhores Práticas.
Código para o Programa de Certificação Continuada.

23. **A Gestora é signatária do Código de Ética da ANBIMA?**
Sim.

24. **Os profissionais da gestão que possuem alçada para decisão sobre aplicações estão devidamente certificados, nos termos do código ANBIMA?**
Sim.

25. **A Gestora é signatária de outros Códigos ou assemelhados? Caso seja, citar as instituições.**
N/A.

26. **A Gestora faz uso de algum tipo de seguro para sinistros relacionados à atividade de gestão ou outras? Detalhar.**
- N/A

27. **Houve ou há processos em andamento, de qualquer natureza, de órgãos reguladores do mercado de capitais ou associação contra a Gestora ou contra seus sócios e/ou executivos? Se sim, quais foram e qual era a natureza? Como está o andamento? No caso de processos encerrados, qual foi o desfecho?**
- Não.

SEÇÃO III - NÚMEROS DA GESTORA

28. Na tabela abaixo, informe os valores correspondentes aos números da Gestora nos últimos 5 (cinco) anos:

ANO	Patrimônio de Terceiros sob Gestão (posição final de período)	Número de pessoas que trabalham na Gestora	Número de portfólios sob gestão
2020	412.100,49	237	301
2021	453.030,63	187	383
2022	501.114,84	188	406
2023	522.349,24	189	436
2024	523.620,55	188	441

29. Tipologia dos portfólios sob gestão atual:

Tipo	Patrimônio Líquido	Exclusivos (PL)	% Total
Renda Fixa	~R$ 523.047.282,18	-	99,89%
Multimercado	~R$ 17.597.632,01	-	3,36%
Ações	~R$ 13.981.654,01	-	2,67%

Investimento Exterior	~R$ 104.724,00	-	0,02%
Private Equity	-	-	0,00%
Outras Categorias	~R$ 575.982,00	-	0,11%

30. Considerando o número total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos cinco maiores alocadores/cotistas?

Cliente	Patrimônio	Percentual
1	R$ 173.617.635.259,71	33,17%
2	R$ 7.545.410.210,46	1,44%
3	R$ 3.909.791.015,63	0,75%
4	R$ 3.488.723.375,83	0,67%
5	R$ 3.332.386.141,49	0.64%

SEÇÃO IV - RECURSOS HUMANOS

31. Qual o número total de pessoas que trabalham na equipe de gestão da Gestora? Qual foi a evolução desse número durante o histórico dos últimos 5 (cinco) anos?

a) **GESTÃO**

Movimentações	Admissões	Desligamentos	Saldo Final
2020	0	1	74
2021	1	1	73
2022	0	4	67
2023	5	12	60
2024	18	9	69

b) **RESEARCH**

Movimentações	Admissões	Desligamentos	Saldo Final
2020	2	2	5
2021	1	1	5
2022	0	0	5
2023	1	1	5
2024	1	1	5

32. Informar o grau de capacitação técnica de toda a equipe e sua multidisciplinaridade.

A equipe responsável pela gestão de recursos de terceiros é composta por profissionais altamente qualificados, com sólida formação acadêmica e ampla experiência no mercado financeiro. A capacitação técnica abrange diferentes níveis de formação, incluindo graduação, pós-graduação, mestrado e doutorado, em áreas como:

- Economia
- Administração
- Engenharia
- Direito
- Ciências Atuariais
- Ciências Contábeis
- Tecnologia da Informação
- Matemática
- Comunicação Social

Sendo:

Tipo de Certificação	Quantidade
Graduação	1
Pós-graduação	56
Mestrado	13
Doutorado	4

Além disso, todas as posições gerencias são ocupadas por profissionais nas mais diversas certificações, sendo CGA, CGE, CNPI, CFP®, FRM®.

Essa diversidade de formações contribui para uma abordagem multidisciplinar na análise e tomada de decisão, permitindo uma visão abrangente e integrada dos mercados e dos produtos sob gestão.

A área de Pesquisa Econômica, por exemplo, conta com profissionais com doutorado em Economia Aplicada, mestrado em Economia, Finanças e Engenharia Química, além de especializações em Direito Econômico e Data Science. Já as áreas de Renda Fixa, Renda Variável, Fundos Estruturados e Fundos de Fundos são compostas por especialistas com formações complementares e especializações em Finanças Corporativas, Mercado de Capitais, Controladoria, Estatística Aplicada, Gestão de Riscos, entre outras.

Essa composição multidisciplinar garante robustez técnica, capacidade analítica e visão estratégica na gestão dos recursos, alinhando-se às melhores práticas do mercado e aos requisitos regulatórios e fiduciários exigidos por instituições de previdência privada.

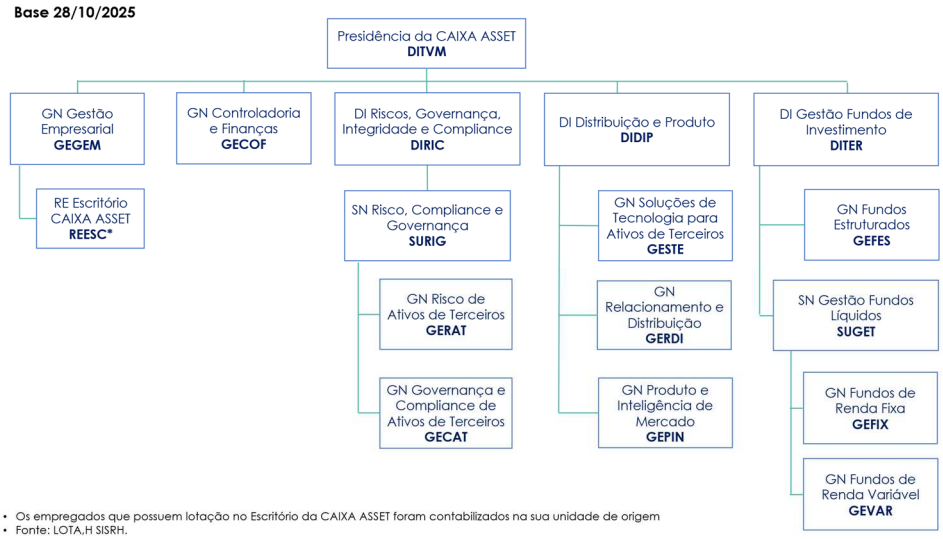
33. **Quais são os mecanismos de retenção de talentos utilizados pela Gestora? Detalhar.**

Como integrante do Conglomerado da CAIXA, a CAIXA Asset oferece um dos melhores pacotes de valor aos empregados entre os participantes do mercado, razão pela qual temos um turnover baixíssimo entre os colaboradores. São oferecidos benefícios legais ampliados (aqueles cujas vantagens previstas em lei são ampliadas); benefícios estabelecidos na Convenção Coletiva de Trabalho (CCT) e/ou Acordo Coletivo de Trabalho (ACT); e benefícios oferecidos por iniciativa exclusiva CAIXA, por decisão estratégica da empresa. Há aproximadamente mais de 60 benefícios, que incluem prorrogação de licenças maternidade/paternidade; ausências permitidas por interesse particular e acompanhamento de familiares; programas de incentivo a nutrição e atividade física, como o Gympass; programas de incentivo a educação; um dos melhores planos de saúde do país, previdência complementar com contribuição paritária, entre outros. Os empregados da CAIXA Asset continuam fazendo parte do quadro de empregados da CAIXA, e, portanto, há estabilidade de emprego e plano de funções gratificadas que viabilizam a progressão na carreira. Para algumas funções a jornada de trabalho é de 30 horas semanais de forma a respeitar e permitir ainda mais o equilíbrio entre vida e trabalho.

34. **Como é feito o pagamento do bônus da equipe de gestão e análise? Existe parcelamento? O bônus é semestral?**

- Pagamento de Bônus é eventualmente pago para todos os gestores anualmente.

35. A equipe está dividida por áreas? Quais áreas? Quais as funções dessas áreas? Quantas pessoas pertencem a cada uma e quem é o responsável?



- Quais as funções dessas áreas? Quantas pessoas pertencem a cada uma e quem é o responsável?

- Presidência da CAIXA ASSET - DITVM:
    - Finalidade: Conduzir e representar a CAIXA ASSET;
    - Responsável: Humberto José Teófilo Magalhães;
    - Quantidade de pessoas: 6.

- Gerência Nacional Controladoria e Finanças – GECOF:
    - Finalidade: Gerir os processos de controle econômico-financeiro, contábil, tributos, contratação, gestão formal de contratos e relacionamento com stakeholders da Companhia;
    - Responsável: Priscila Sumita Macedo;
    - Quantidade de pessoas: 14.

- Gerência Nacional Gestão Empresarial – GEGEM:
    - Finalidade: Gerir os processos de gestão de pessoas, infraestrutura, segurança e logística, modelo de gestão e planejamento estratégico da CAIXA ASSET;
    - Responsável: Felipe Gomes Marinoni;
    - Quantidade de pessoas: 11.

- Diretoria de Distribuição e Produto – DIDIP:
    - Finalidade: Conduzir a estratégia e distribuição de produtos de ativos de terceiros e as soluções de TIC;
    - Responsável: Ricardo Rios Araújo;
    - Quantidade de pessoas: 2;

- Gerência Nacional Produto e inteligência de Mercado – GEPIN:
    - Finalidade: Atuar no monitoramento do mercado para prospectar soluções, tendências e estratégias para o portfólio de produtos e serviços da CAIXA ASSET;
    - Responsável: Leonardo de Albuquerque Sampaio;
    - Quantidade de pessoas: 17.

- Gerência Nacional Relacionamento e Distribuição – GERDI:
    - Finalidade: Gerir ações integradas de marketing, comunicação e distribuição de produtos da CAIXA ASSET;
    - Responsável: Erika Zamberlan da Silva;
    - Quantidade de pessoas: 22.

- Gerência Nacional Soluções de Tecnologia para Ativos de Terceiros – GESTE:
    - Finalidade: Atuar no provimento de soluções tecnológicas para suportar as atividades da CAIXA ASSET;
    - Responsável: Lívia Barros Nascimento;
    - Quantidade de pessoas: 8.

- Diretoria Riscos, Governança, Integridade e Compliance – DIRIC:
    - Finalidade: Conduzir a governança, compliance, integridade e gerenciamento de riscos na CAIXA ASSET;
    - Responsável: Marcelo Suda Maia;
    - Quantidade de pessoas: 3.

- Superintendência Nacional Risco, Compliance e Governança – SURIG:
    - Finalidade: Coordenar os riscos, compliance e o modelo de governança corporativa da CAIXA ASSET;
    - Responsável: Anderson Luiz Pereira de Paula;
    - Quantidade de pessoas: 2.

- Gerência Nacional Governança, Riscos Especializados e Compliance – GECAT:
    - Finalidade: Gerir, como 2ª linha de defesa, o estado de compliance, riscos especializados e modelo de governança corporativa;
    - Responsável: Vitor Levatti Borges;
    - Quantidade de pessoas: 20.

- Gerência Nacional Riscos Financeiros – GERAT:
    - Finalidade: Gerir os riscos financeiros dos produtos, serviços e processos da CAIXA ASSET;
    - Responsável: Vanessa Piovesan Balista Lerias;
    - Quantidade de pessoas: 19.

- Diretoria Gestão de Fundos de Investimentos – DITER:
    - Finalidade: Conduzir a gestão de ativos de terceiros e fundos de fundos;
    - Responsável: Carlos Alberto Zachert;
    - Quantidade de pessoas: 4.

- Gerência Nacional Fundos Estruturados – GEFES:
    - Finalidade: Gerir fundos de investimento estruturados e fundos de fundos;
    - Responsável: Gabriel Gonçalves Bizzarro – em exercício;
    - Quantidade de pessoas: 12.

- Superintendência Nacional Gestão de Fundos Líquidos – SUGET:
    - Finalidade: Coordenar estratégia para composição de fundos de investimento e carteiras administradas;
    - Responsável: Pedro Victor Gonçalves do Vale;
    - Quantidade de pessoas: 18.

- Gerência Nacional Fundos de Renda Fixa – GEFIX:
    - Finalidade: Gerir carteiras administradas e fundos de renda fixa;
    - Responsável: Carlos Eduardo Biteli;
    - Quantidade de pessoas: 22.

- Gerência Nacional Fundos de Renda Variável – GEVAR:
    - Finalidade: Gerir carteiras administradas e fundos de renda variável;
    - Responsável: Danilo Cesar Renaux dos Santos;
    - Quantidade de pessoas: 22.

SEÇÃO V - AUDITORIA INTERNA E *COMPLIANCE*

36. **Descrever a estrutura de gerenciamento de risco e *Compliance* da Gestora.**
    COMITÊ DE ESTRATÉGIA DE RISCOS, COMPLIANCE E GOVERNANÇA
    Responsável por monitorar e deliberar sobre os assuntos relacionados a limites operacionais, gestão de riscos, compliance e governança no âmbito do gestor de recursos.

37. **Quem é o responsável pela área e a quem se reporta?**

A Companhia utiliza, via convênio de compartilhamento, a estrutura de Auditoria Interna da Controladora no monitoramento dos negócios, assim como as estruturas de ouvidoria e corregedoria. A Auditoria Interna se reporta ao Comitê de Auditoria da CAIXA ASSET. As equipes da Gerência Nacional de Governança, Riscos Especializados e Compliance e Gerência Nacional de Riscos Financeiros, atuam sob coordenação da Superintendência Nacional de Risco Compliance e Governança e condução da Diretoria Executiva de Riscos, Governança e Integridade e Compliance, compondo o eixo de GRC da Companhia. Sua atuação é reportada ao Comitê de Estratégia de Riscos, Compliance e Governança da CAIXA ASSET.

38. **Descrever as principais mudanças na equipe de risco nos últimos 5 (cinco) anos.**

Em 07 de dezembro de 2023, a Assembleia Geral Ordinária aprovou a reforma estatutária da Companhia e, dentre as alterações, houve a criação do cargo estatutário de Diretor de Riscos, Governança, Integridade e Compliance.

O Conselho de Administração da CAIXA ASSET elegeu, em 08 de fevereiro de 2024, a Sra. Mônica dos Santos Monteiro para o cargo de Diretor Executivo na Diretoria Riscos, Governança, Integridade e Compliance, que tomou posse em 23 de fevereiro de 2024, para cumprir o mandato unificado 2023/2025.

O Conselho de Administração da CAIXA ASSET elegeu, em 14 de abril de 2025, o Sr. Marcelo Sudá Maia para o cargo de Diretor Executivo na Diretoria Riscos, Governança, Integridade e Compliance, que tomou posse em 22 de abril de 2025, para cumprir o mandato unificado 2025/2027, em substituição à Diretora Executiva, Sra. Mônica dos Santos Monteiro cujo exercício do cargo encerrou em 21 de abril de 2025.

39. **Quais serviços/sistemas são utilizados para apoio no controle de riscos? São desenvolvidos internamente ou contratado junto a terceiros? Quem os fornece? Citar, especificadamente, por tipo de risco (crédito, contraparte, preço, liquidez e operacional).**

Sistema Argus (fornecido pela empresa Maps S.A. Soluções e Serviços) para gestão de risco de mercado e, para a gestão de risco de liquidez e crédito, é utilizado sistema interno – Sistema de Risco de Ativos de Terceiros.

40. **Como funciona a área de auditoria interna da Gestora? Como ela é composta? A quem se reporta?**

Companhia utiliza, via convênio de compartilhamento, a estrutura de Auditoria Interna da Controladora no monitoramento dos negócios, assim como as estruturas de ouvidoria e corregedoria. A Auditoria Interna se reporta ao Comitê de Auditoria da CAIXA ASSET.

As equipes da Gerência Nacional de Governança, Riscos Especializados e Compliance e Gerência Nacional de Riscos Financeiros, atuam sob coordenação da Superintendência Nacional de Risco Compliance e Governança e condução da Diretoria Executiva de Riscos, Governança e Integridade e Compliance, compondo o eixo de GRC da Companhia. Sua atuação é reportada ao Comitê de Estratégia de Riscos, Compliance e Governança da CAIXA ASSET.

41. **Quais procedimentos internos estão formalizados e com qual periodicidade eles passam por revisão?**

A frequência de realização dos testes para verificação de segurança e integridade de sistemas é de no mínimo de 02 (duas) vezes ao ano, com a participação das áreas

envolvidas executando as atividades críticas da unidade e documentando os testes realizados.

42. **Toda decisão de investimento passa pelo *Compliance*?**
Sim.

43. **Quais procedimentos são adotados quando a auditoria interna ou o *Compliance* detecta alguma inconformidade?**
Eventuais situações de inconformidade relacionadas às demais atividades desempenhadas pela instituição são mitigadas por meio de segregação física, tecnológica e organização das companhias, bem como pelas estruturas de governança que contam com comitês segregados, assegurando que a tomada de decisão ocorra de forma colegiada e independente.

44. **Nos casos de posições que ultrapassem seus limites, como é o processo de tomada de decisão para o reenquadramento?**
Os eventos de Nível Extrapolação são reportados diariamente ao gestor, por meio de comunicação eletrônica e de relatório de risco, e devem ser ajustados aos limites estabelecidos em até 1 (um) dia útil a partir do recebimento da comunicação eletrônica. Caso o ajuste não ocorra dentro do prazo definido, o gestor submete ao Comitê de Estratégia de Riscos, Compliance e Governança da CAIXA ASSET as justificativas e o plano de reenquadramento de carteira.

45. **Caso haja uma posição contraria ao *Compliance*, quem determina a efetivação da posição?**
Comitê de Estratégia de Riscos, Compliance e Governança da CAIXA ASSET

46. **Caso a Gestora desenvolva outras atividades, descreva sua política de *chinese wall* e de que forma é garantida a proteção da informação entre departamentos que não estejam envolvidos no mesmo projeto ou linha de negócio.**
N/A

47. **Existe política ou procedimento de prevenção à lavagem de dinheiro?**
Realiza diligência de identificação das contrapartes e emissores envolvidos em negociações de ativos financeiros com os fundos sob gestão. Adoção de procedimentos "Conheça o Histórico do Preço" quando da realização de investimento, com o objetivo de controlar e monitorar a faixa de preços dos ativos e valores mobiliários negociados para os fundos, de modo que eventuais operações fora dos padrões praticados pelo mercado sejam identificadas.
Para operações de Crédito Privado nos mercados primário e secundário realiza são analisadas informações com relação aos negócios realizados, tais quais: emissor do ativo, (coobrigados (se houver), garantias (se houver), fluxo e probabilidade de default (PDD) ou equivalência do rating interno do gestor com os ratings das agências classificadoras de risco de crédito, rating do ativo ou do emissor fornecido por agência classificadora de risco (se houver), classificação de risco interna do gestor; taxa negociada; solicitação e análise das informações produzidas pelo gestor que fundamentam a operação; documentos integrantes da operação ou a ela acessórios e, nas operações com garantia real ou fidejussória, à descrição das condições aplicáveis ao seu acesso e execução.

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

SEÇÃO VI - ÁREA DE TECNOLOGIA E CONTINGÊNCIAS

48. **Descreva o parque tecnológico atual da Gestora e os procedimentos de *backup* e redundância de informações (periodicidade, local e prazo de armazenamento).**
A Capacidade de processamento e armazenamento do Parque Tecnológico da CAIXA é de:
· 8 mainframes (2 do modelo Z14 e 6 do modelo Z15)
· 390.612 MIPS (milhões de instruções por segundo) no ambiente mainframe;
· 20.115 Terabytes de Armazenamento OPEN;
· 2.240 Terabytes de Armazenamento Mainframe;
· 811 servidores físicos de plataforma baixa;
· 17.358 servidores lógicos de plataforma baixa;
· 23 Servidores físicos de plataforma intermediária;
· 06 Silos Robóticos;
· 07 Virtual Storage Manager (VSM);
· 4.969 Roteadores;
· 638 Switches (Centralizado).
· 4 circuitos de internet de 10Gbps com dupla abordagem

49. **Descreva a política de segurança da informação**.
A CAIXA ASSET mantém o compromisso com a integridade, confidencialidade e disponibilidade das informações sob sua responsabilidade, por meio da Política de Segurança e Informação – PO007 da CAIXA, alinhada às diretrizes do Conglomerado e às melhores práticas de mercado.
A política estabelece um conjunto de princípios e diretrizes que visam proteger os ativos informacionais da Companhia contra acessos não autorizados, vazamentos, alterações indevidas e indisponibilidades, abrangendo não apenas os sistemas tecnológicos, mas também processos, pessoas e documentos físicos.

Entre os principais pilares da política, destacam-se:

·Governança e Gestão de Riscos: A segurança da informação é integrada ao planejamento estratégico da CAIXA ASSET, com estruturas de governança compatíveis com a complexidade das operações e gestão contínua de riscos cibernéticos.
· Cultura Organizacional: A Companhia promove ações de conscientização, treinamentos e testes periódicos, como simulações de phishing, para fortalecer a cultura de segurança entre seus colaboradores.
· Privacidade e Proteção de Dados: Em conformidade com a LGPD, a CAIXA ASSET assegura que o tratamento de dados pessoais seja realizado com base legal, de forma transparente, proporcional e com respeito aos direitos dos titulares.
· Segurança Cibernética: São adotadas medidas técnicas e organizacionais para proteger a infraestrutura tecnológica, incluindo varreduras de vulnerabilidades, controle de acessos, uso de soluções homologadas e monitoramento contínuo.
· Continuidade de Negócios: A política contempla planos robustos de continuidade operacional, gestão de crises e recuperação de desastres, garantindo a resiliência dos processos críticos da organização.

· Parcerias Estratégicas: A CAIXA ASSET atua em conjunto com entidades como ANBIMA, órgãos reguladores e áreas especializadas da CAIXA para fortalecer sua postura de segurança e conformidade regulatória. A aderência a PO 007 reforça o posicionamento da CAIXA ASSET como uma gestora sólida, ética e comprometida com a proteção de seus clientes, colaboradores e parceiros, contribuindo para a
confiança no mercado financeiro e a sustentabilidade de seus negócios.

50. **Descreva os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres.**
A CAIXA ASSET possui Plano de Continuidade dos Negócios, visando garantir a continuidade de seus processos/subprocessos críticos e minimizar os impactos decorrentes de disrupções, além de recuperar perdas de ativos físicos, financeiros e de informação em nível aceitável, por intermédio de ações de resposta a incidentes e recuperação de desastres. Isso inclui a resiliência dos sistemas e processos e, de maneira mais geral, a capacidade da organização de continuar operando seus negócios durante disrupções.
Para a continuidade dos negócios, mantém-se ambiente alternativo na cidade de São Paulo, com toda a infraestrutura necessária à execução das atividades críticas, caso o ambiente operacional não esteja disponível.
No ambiente alternativo são efetuadas ações para verificar o funcionamento dos recursos disponíveis com a participação das áreas da companhia que possuem processos/subprocessos críticos, implicando na execução das atividades críticas da unidade e na documentação dos testes realizados.
As atividades críticas e o detalhamento dos procedimentos operacionais de cada unidade estão registrados no Portal PCN, dentro do formulário denominado Plano de Continuidade Operacional, que pode ser consultado e revisto a qualquer momento.

Os testes do ambiente alternativo são realizados conforme abaixo:

• Técnicos: ocorrem trimestralmente e contemplam a verificação do pleno funcionamento dos recursos disponíveis no ambiente alternativo, além do levantamento de eventuais necessidades de ajustes/melhorias nos recursos utilizados para a execução das atividades críticas; e
• Funcionais: ocorrem anualmente e correspondem à execução das atividades críticas no ambiente alternativo e a verificação da eficácia dos Planos de Continuidade.
Após a realização dos testes, as unidades gestoras reportam os resultados via formulário no Portal PCN relacionando os problemas, se houver. Estes são reportados ao técnico de TI disponibilizado pela CAIXA, que realiza as configurações e atualizações necessárias ainda durante o período do teste.

51. **Possui terceirizado? Qual o plano de contingência?**
O acesso físico e lógico do Data Center da instituição é realizado apenas por empregados e colaboradores credenciados e autorizados, que atuam na área de Tecnologia da empresa.

52. **Onde fica o servidor de armazenamento de informações?**
N/A
53. **Algum fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação?**
Não.

SEÇÃO VII - GESTÃO DE RECURSOS E DECISÃO DE INVESTIMENTO

54. **Como se dá o processo decisório de investimento, independente do produto? Quais são as etapas, requerimentos mínimos etc.?**

A CAIXA ASSET mantém o compromisso com a integridade, confidencialidade e disponibilidade das informações sob sua responsabilidade, por meio da Política de Segurança e Informação – PO 007 da CAIXA, alinhada às diretrizes do Conglomerado e às melhores práticas de mercado.

A política estabelece um conjunto de princípios e diretrizes que visam proteger os ativos informacionais da Companhia contra acessos não autorizados, vazamentos, alterações indevidas e indisponibilidades, abrangendo não apenas os sistemas tecnológicos, mas também processos, pessoas e documentos físicos.

Entre os principais pilares da política, destacam-se:

· Governança e Gestão de Riscos: A segurança da informação é integrada ao planejamento estratégico da CAIXA ASSET, com estruturas de governança compatíveis com a complexidade das operações e gestão contínua de riscos cibernéticos. testes periódicos, como simulações de phishing, para fortalecer a cultura de segurança entre seus colaboradores.

· Privacidade e Proteção de Dados: Em conformidade com a LGPD, a CAIXA ASSET assegura que o tratamento de dados pessoais seja realizado com base legal, de forma transparente, proporcional e com respeito aos direitos dos titulares.

· Segurança Cibernética: São adotadas medidas técnicas e organizacionais para proteger a infraestrutura tecnológica, incluindo varreduras de vulnerabilidades, controle de acessos, uso de soluções homologadas e monitoramento contínuo.

· Continuidade de Negócios: A política contempla planos robustos de continuidade operacional, gestão de crises e recuperação de desastres, garantindo a resiliência dos processos críticos da organização.

· Parcerias Estratégicas: A CAIXA ASSET atua em conjunto com entidades como ANBIMA, órgãos reguladores e áreas especializadas da CAIXA para fortalecer sua postura de segurança e conformidade regulatória.

A aderência a PO 007 reforça o posicionamento da CAIXA ASSET como uma gestora sólida, ética e comprometida com a proteção de seus clientes, colaboradores e parceiros, contribuindo para a confiança no mercado financeiro e a sustentabilidade de seus negócios.

55. **É compartilhado, discricionário ou ambos? Detalhe o funcionamento de instâncias internas de decisão (tais como Comitês de Investimento etc.).**

COMITÊ DE GOVERNANÇA DIGITAL

O Comitê de Governança Digital tem por finalidade exercer a Governança da Tecnologia da Informação e Comunicação (TIC) da CAIXA ASSET, conduzindo os processos de direção, monitoramento e avaliação do desempenho de TIC, e deliberando sobre os assuntos a ela relacionados.

COMITÊ DE GESTÃO DE FUNDOS MÚTUOS

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

COMITÊ DE INVESTIMENTO E GESTÃO DE FUNDOS ESPECIAIS

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

COMITÊ DE ESTRATÉGIA DE RISCOS, COMPLIANCE E GOVERNANÇA
Responsável por monitorar e deliberar sobre os assuntos relacionados a limites operacionais, gestão de riscos, compliance e governança no âmbito do gestor de recursos.

COMITÊ DE PRODUTO E COLOCAÇÃO DE FUNDOS
Responsável por monitorar o movimento da indústria de fundos de investimento e deliberar sobre a viabilidade, constituição, alteração, reposicionamento de produtos e sua estratégia de colocação, além de encerramento de produtos de rede.
A regularidade de reuniões dos Comitês Internos da CAIXA ASSET é descrita nos respectivos Regimentos Internos.

56. **Utiliza *research* próprio ou de terceiros? Descreva os fornecedores.**
A unidade de pesquisa desenvolve o Research próprio, mas também temos acesso a Research externo. Toda a pesquisa relacionada à economia e ativos domésticos é feita internamente, embora, também tenhamos acesso à relatórios de terceiros.

57. **Caso utilize *research* próprio, quais ferramentas de análise são utilizadas no processo decisório? Esta equipe trabalha exclusivamente para o *buy side* ou também produz relatórios e informações para outros *(sell side)*?**
No Research próprio, são desenvolvidas pesquisas e análises no âmbito macro, micro/setorial e quantitativo. Como ferramentas de análise são utilizados modelos de projeção de indicadores macroeconômicos para a fundamentação da análise da conjuntura doméstica e internacional, modelos financeiros e estatísticos utilizados para identificar oportunidades de mercado, seja no âmbito tático ou no estratégico, e modelos de análise econômico-financeira de empresas com o objetivo de balizar a expectativa de valor intrínseco. Estas atividades estão diretamente ligadas ao processo de investimento da gestão de fundos líquidos. A equipe tem dedicação exclusiva à CAIXA DTVM, sendo estritamente um Research de buy side.

58. **De que forma o desempenho dos gestores e dos fundos é avaliado?**
Tanto os gestores como os fundos são avaliados principalmente com base em dois indicadores chave (Resultados Chave - KR), que são ligados aos objetivos estratégicos que compõem o plano de negócios e o planejamento estratégico atuais da CAIXA Asset.
Para fundos passivos, os fundos são medidos por meio do seu desempenho absoluto. Para isso, é calculado o tracking error diário de cada fundo, utilizando sua cota líquida, comparando-o com o tracking error de uma carteira teórica que possui 95% do seu Patrimônio Líquido alocado no respectivo benchmark. Para este indicador, temos a meta de que 70%, ou mais, dos fundos apresente um tracking error menor comparado à carteira teórica, considerando os parâmetros citados.

Para fundos ativos, são utilizadas duas métricas de avaliação:

I- Desempenho absoluto;

II- Desempenho relativo.

III- Para avaliação do desempenho absoluto dos fundos de gestão ativa será utilizada a rentabilidade líquida, em relação aos seus respectivos índices de referência ou benchmarks, a fim de capturar a perspectiva do cotista sobre a superação desses índices/benchmarks.

São excluídos do indicador os fundos exclusivos e fundos com Patrimônio Líquido inferior a R$ 5 milhões. Sua mensuração se dá da seguinte forma:

Superação Parcial: Para fundos que, em janela móvel de 12 meses, superarem seu benchmark ou índice de referência descontado da taxa de administração, será atribuído 0,5 ponto.

Superação Total: Para fundos que, em janela móvel de 12 meses, superarem seu benchmark ou índice de referência sem desconto da taxa de administração, será atribuído 1 ponto.

Dessa forma, o desempenho absoluto dos fundos = [0,5*Σ (fundos com superação parcial) + Σ(fundos com superação total)] / Σ (fundos avaliados)

Para este indicador, a meta é atingir índice igual ou superior a 50%.

IV- Para avaliação do desempenho relativo, primeiramente é definida uma lista de fundos flagship da CAIXA Asset, composta pelos fundos de gestão ativa de maior Patrimônio Líquido em cada estratégia de gestão mantida pela CAIXA Asset. Essa lista é reavaliada anualmente, com base nesse critério, e busca representar a capacidade de gestão de recursos da CAIXA Asset através dos fundos que mantém a maior parte dos recursos investidos nas respectivas estratégias. Essa amostra consta do Plano de Negócios da CAIXA Asset. Após essa definição, para cada fundo flagship é definida uma lista de fundos de gestoras concorrentes com características e demais estratégias de investimentos semelhantes (peer group).
O desempenho relativo visa avaliar a diferença de retorno bruto dos nossos fundos flagship e o retorno bruto obtido pelo peer group. Para este cálculo será considerada janela móvel de 12 meses e sua mensuração se dará da seguinte forma: uma vez definidos os fundos flagship e seus respectivos peer groups, os flagship serão ranqueados mensalmente pelo retorno bruto acumulado em janelas móveis de 12 meses, em relação aos demais fundos do seu peer group, visando identificar o quartil do ranqueamento em que o fundo se encontra. Considerando a posição do flagship no ranqueamento, é atribuído uma pontuação mensal:
1º quartil: 1,20 ponto;
2º quartil: 1,00 ponto;
3º quartil: 0,25 ponto;
4º quartil: 0,00 ponto.

O desempenho dos fundos flagship num determinado mês é a somatória dos pontos dos últimos 12 meses. E para o cálculo da pontuação final é considerado o percentual dos pontos dos flagships perante os pontos possíveis, em janela móvel de 12 meses.
Para este indicador, a meta é atingir índice igual ou superior a 67%.

59. **A gestora recebe rebate pela alocação em ativos financeiros, quais as regras?**
Não.

60. **Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?**
N/A.

61. **Trabalha com *capacity* nas estratégias de investimento? Essa informação é divulgada ao investidor?**
Conforme política de investimento do fundo disponibilizada no site da Caixa.

SEÇÃO VIII - PRÁTICAS E CRITÉRIOS ESG

62. **A Gestora produz Relatórios de Sustentabilidade baseados nas normas GRI? Se sim, com qual frequência os relatórios são atualizados e publicados?**

    Nossos relatórios de sustentabilidade são emitidos em conjunto com a controladora. E a revisão da PRSAC é realizada no mínimo a cada três anos ou quando ocorrerem eventos relevantes para a instituição, conforme a Resolução CMN nº 4.945/202.

63. **A Gestora possui certificações e/ou selos ESG emitidos por organizações e entidades independentes?**

    N/A

64. **A Gestora é signatária do PRI? Como a Gestora incorpora os princípios ESG no processo de análise e tomada de decisão de investimentos?**

    A CAIXA incorpora critérios sociais, ambientais e climáticos na oferta de crédito, investimentos e negócios, restringindo recursos a instituições que não estejam em conformidade com a legislação e diretrizes de sustentabilidade. Também há incorporação da análise e mitigação de riscos sociais, ambientais e climáticos em políticas e processos, inclusive no lançamento de novos produtos ou serviços.

65. **Com que frequência são revisados os processos para a incorporação de fatores ESG nas decisões de investimentos?**

    A revisão da PRSAC ocorre a cada três anos ou quando há eventos relevantes, conforme a Resolução CMN nº 4.945/2021.

66. **Existe engajamento ativo com as empresas investidas com relação às práticas ESG?**

    Sim. A CAIXA atua junto aos stakeholders, parceiros e mercado de forma transparente, promovendo diálogo aberto e contínuo sobre aspectos sociais, ambientais, climáticos e de governança. Também busca engajamento com fornecedores e parceiros, incentivando práticas de responsabilidade social, ambiental e climática.

67. **O gestor fornece relatórios regulares sobre o impacto ESG dos investimentos aos investidores?**

    A CAIXA divulga de forma objetiva os aspectos ESG relevantes às partes interessadas.

68. **Existe uma equipe ou comitê dedicado à análise ESG dentro da Gestora? Como é composta(o)?**

    Sim. O Fórum ASG é composto pelos membros: Superintendente Nacional da SURIG, Gerente Nacional da GECAT, Gerente Executivo da GECAT responsável pela gestão dos Riscos Especializados e Analista responsável pela análise.

69. **São realizadas auditorias independentes acerca das ações e métricas ESG da Gestora?**

    Sim.

SEÇÃO IX - RELACIONAMENTO COM O COTISTA

70. **Quais as formas de relacionamento estabelecidas com os clientes da Gestora? Quem é responsável por este relacionamento?**
    Comunicação direta: Atendimento personalizado com os clientes por meio de reuniões presenciais ou virtuais e ligações telefônicas, para entender suas necessidades e apresentar resultados.
    Canais digitais: O uso de e-mail, chats online e portais do cliente permite uma comunicação rápida e eficiente, mantendo os investidores atualizados sobre o desempenho dos fundos e o mercado financeiro.
    Relatórios e informativos: A gestora fornece relatórios periódicos de desempenho dos fundos, cartas do gestor e informativos sobre o cenário econômico para manter os clientes bem informados sobre seus investimentos.

71. **Quais os relatórios disponíveis do fundo? Detalhar. Qual sua periodicidade? Com qual defasagem?**
    Boletim Comercial | Disponibilizado mensalmente, informa a rentabilidade, parâmetros, histórico de rentabilidade e as estratégias permitidas. Desafagem de um mês.
    Extrato do Fundo | Disponibilizado mensalmente, posição individualizada do cotista. Desafagem de um mês.
    Relatório de Cota | Disponibilizado diariamente, caso o cotista tenha cadastrado seu endereço eletrônico previamente. Informa a variação da cota do fundo. Defasagem de um dia.
    Relatório da Carteira do Fundo | Disponibilizado mensalmente, dados referentes a composição dos ativos do fundo. Desafagem de um mês.

72. **Com qual grau de detalhamento a carteira pode ser disponibilizada aos cotistas? Qual o prazo de reserva para cada estratégia? Padrão ANBIMA?**
    Conforme padão ANBIMA.

73. **Com qual frequência é possível realizar *conference call* com o gestor do fundo?**
    A qualquer momento, apenas sujeito a disponibilidade do gestor.

74. **Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual horário para atendimento?**
    A Rede de agências CAIXA, principal canal de atendimento ao cotista. O atendimento conta ainda com a GERDI, como unidade de suporte a fundos junto à rede.

DECLARAÇÃO

Declaramos que este questionário foi preenchido, revisado e assinado por pessoas devidamente autorizadas a fazê-lo, respondendo esta instituição pela sua exatidão, veracidade e integridade das informações de todo o conteúdo prestado neste documento e de seus anexos.

Comprometemo-nos a manter todas as informações deste questionário devidamente atualizadas e, caso sofram alterações relevantes, estas serão comunicadas imediatamente após a sua ocorrência.

São Paulo/SP **03/11/2025**
Local **Data**

Luan Augusto Silveira da Costa

Assinado de forma digital por Luan Augusto Silveira da Costa
Dados: 2025.11.03 16:15:22 -03'00'

Luan Augusto Silveira da Costa
Gerente de Clientes e Negócios I