

ANEXO E - Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

ADMINISTRADORES DE CARTEIRAS DE VALORES MOBILIÁRIOS	
1.	Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário
1.1.	Declarações dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e desta Resolução, atestando que:
a.	reviram o formulário de referência
b.	o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa
	Nome do Responsável pelo conteúdo do Formulário de Referência: <u>Rafael Fonseca Nogueira</u> Cargo: Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários
	Nome do Responsável pelo conteúdo do Formulário de Referência: <u>Cezar Monho Neto</u> Cargo: Diretor Responsável pelo Compliance, Gestão de Riscos e PLD
	Os diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e desta Resolução, atestam que reviram o formulário de referência e o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa.
	<hr/> RAFAEL FONSECA NOGUEIRA Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários
	<hr/> CEZAR MONHO NETO Diretor Responsável pelo Compliance, Gestão de Riscos e PLD
2.	Histórico da empresa
2.1.	Breve histórico sobre a constituição da empresa
	A Chimera Capital Asset Management Ltda. (“Chimera” ou “Sociedade”), fundada em junho de 2020, é o resultado da união de profissionais experientes do mercado financeiro e de capitais, que defendem os mesmos ideais e objetivos em termos de gestão, ética e desenvolvimento profissional na busca do melhor retorno possível, e, por conseguinte, da satisfação de seus clientes.
2.2.	Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo:
a.	os principais eventos societários, tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário

Após a sua constituição, a Chimera passou por eventos societários, culminando na saída de antigos sócios, de modo que atualmente é uma sociedade unipessoal representada pelo sócio Janser da Silva Saloman.

Em 07/04/2021, a Sociedade promoveu a 1ª alteração do contrato social, substituindo o Diretor de Gestão, Sr. André Strauss Vasques, pelo Sr. Virgílio Ghirardello.

Em 25/05/2021, a Sociedade promoveu a 2ª alteração do contrato social, substituindo o Diretor de Risco e Compliance, Sr. Eduardo Ferraz de Lima Vieira, pelo Sr. Shreedhar Madhusudanan.

Em 12/11/2021, a Sociedade promoveu a 3ª alteração do contrato social, onde os sócios Sr. Eduardo Ferraz de Lima Vieira e Sr. Virgílio Ghirardello se retiraram da Sociedade.

Em 20/07/2022, a Sociedade promoveu a 4ª alteração do contrato social, nomeando o Sr. Gustavo Taucei Schellenberger como Diretor de Gestão, bem como nomeando o Sr. Cezar Monho Neto como Diretor de Risco e Compliance da Sociedade.

Em 11/07/2023, a Sociedade promoveu a 5ª alteração do contrato social, substituindo o Diretor de Gestão, Sr. Gustavo Taucei Schellenberger, pelo Sr. Rafael Fonseca Nogueira.

b. escopo das atividades

Não houve alterações.

c. recursos humanos e computacionais

Reestruturação societária em 12/11/2021, com a saída de antigos diretores, e em 11/07/2022, com o ingresso dos novos e atuais Diretores de Gestão e Compliance e Risco da Sociedade.

d. regras, políticas, procedimentos e controles internos

No ano de 2023, a Chimera realizou atualização no seu conjunto de Políticas para adequar as normas regulatórias e a legislação vigente.

3. Recursos humanos

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

a. número de sócios

1

b. número de empregados

8

c. número de terceirizados

0

d. indicar o setor de atuação dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e os respectivos exames de certificação realizados para fins do art. 3º, III, c/c art. 4º, III, desta Resolução

Rafael Fonseca Nogueira – CPF/ME n.º 299.298.108-70– Diretor de Gestão – CGA/CGE

e. lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e que atuem exclusivamente como prepostos, empregados ou sócios da empresa

Rafael Fonseca Nogueira – CPF/ME n.º 299.298.108-70

4. Auditores
4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:
a. nome empresarial
N/A
b. data de contratação dos serviços
N/A
c. descrição dos serviços contratados
N/A
5. Resiliência financeira
5.1. Com base nas demonstrações financeiras, ateste:
a. se a receita em decorrência de taxas com bases fixas a que se refere o item 9.2.a é suficiente para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários
Sim.
b. se o patrimônio líquido da empresa representa mais do que 0,02% dos recursos financeiros sob administração de que trata o item 6.3.c e mais do que R\$ 300.000,00 (trezentos mil reais)
Não.
5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Resolução
Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.
6. Escopo das atividades
6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo:
a. tipos e características dos serviços prestados (gestão discricionária, planejamento patrimonial, controladoria, tesouraria, etc.)
A Chimera é composta por profissionais com trajetória e histórico de sucesso no Mercado Financeiro e de Capitais, especialmente na gestão de investimentos. A Chimera atuará como gestora discricionária de fundos de investimentos em ativos ilíquidos direcionados para público específico.
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.)
A Chimera atuará na gestão de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios, adequados a todos os perfis de investidores, os quais, conforme o caso, investem em ativos negociados no Brasil.
c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Direitos Creditórios Padronizados, Direitos Creditórios Não Padronizados, Cotas de Fundos, títulos de renda fixa, entre outros...
d. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor
A Chimera não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários, destacando:
a. os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades; e
A Chimera exerce somente a atividade de administração de carteiras e de valores mobiliários, não havendo, portanto, potenciais conflitos de interesses.
b. informações sobre as atividades exercidas por sociedades controladoras, controladas, coligadas e sob controle comum ao administrador e os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades.
A Chimera é uma empresa interligada ao Grupo Chimera, que conta, ainda, com a Chimera Capital Partners Consultoria Empresarial Ltda. (“Chimera Capital Partners”) (CNPJ/ME nº 15.492.157/0001-59), e a sociedade Montblanc Participações S.A (“Montblanc”) (CNPJ/ME nº 30.545.240/0001-32).
Após a autorização da Chimera para atuar como gestora no ano de 2023, a Chimera Capital Partners passou a ser principalmente uma sociedade com a finalidade de deter participação em outras sociedades. Apesar de ainda constar formalmente como consultora especializada em um FIDC, o referido fundo está em período de desinvestimento. Ou seja, a Chimera Capital Partners não possui atividade operacional. Logo após a concessão da autorização da Chimera para atuar como administradora de carteiras de valores mobiliários, a antiga Chimera Consultoria deixou de prestar os serviços de consultoria especializada em NPL, extinguindo potenciais conflitos de interesses. Já a Montblanc, esta também possui atividade a detenção de participação em outras sociedades, inexistindo potenciais conflitos de interesses em relação a ela também.
6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos e carteiras administradas geridos pela empresa, fornecendo as seguintes informações:
a. número de investidores (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)
Número de Investidores Total: 20 Número de Investidores em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Qualificados: 20 Número de Investidores em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Não-Qualificados: 0
b. número de investidores, dividido por:
i. pessoas naturais
6
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)
1

iii. instituições financeiras
0
iv. entidades abertas de previdência complementar
NA
v. entidades fechadas de previdência complementar
NA
vi. regimes próprios de previdência social
NA
vii. seguradoras
NA
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil
NA
ix. clubes de investimento
NA
x. fundos de investimento
13
xi. investidores não residentes
0
xii. outros (especificar)
NA
c. recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)
Total: R\$ 59.935.144,33 Recursos Financeiros sob Administração em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Qualificados: R\$ 59.935.144,33 Recursos Financeiros sob Administração em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Não Qualificados: R\$ 0,00
d. recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior
NA
e. recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)
R\$ 34.800.000,00; R\$ 6.750.000,00; R\$ 5.954.881,25; R\$ 4.152.116,14; R\$ 4.090.881,25; R\$ 3.500.000,00; R\$ 2.700.000,00; R\$ 2.325.000,00; R\$ 2.027.500,00; e R\$ 1.500.000,00.
f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:
i. pessoas naturais

▪ R\$ 6.750.000,00
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)
R\$ 3.500.000,00
iii. instituições financeiras
N/A
iv. entidades abertas de previdência complementar
NA
v. entidades fechadas de previdência complementar
NA
vi. regimes próprios de previdência social
NA
vii. seguradoras
NA
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil
NA
ix. clubes de investimento
N/A
x. fundos de investimento
R\$ 55.225.378,64
xi. investidores não residentes
N/A
xii. outros (especificar)
N/A
6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:
a. ações
N/A
b. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras
N/A
c. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras
N/A
d. cotas de fundos de investimento em ações
N/A
e. cotas de fundos de investimento em participações

N/A
f. cotas de fundos de investimento imobiliário
N/A
g. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios
R\$ 9.803.105,59
h. cotas de fundos de investimento em renda fixa
R\$ 15.628.678,88
i. cotas de outros fundos de investimento
R\$ 2.487.848,02
j. derivativos (valor de mercado)
N/A
k. outros valores mobiliários
▪
l. títulos públicos
R\$ 1.378.144,15
m. outros ativos
Imóveis (R\$ 3.565.660,76), Direitos Creditórios (R\$ 28.848.377,16)
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. Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.
6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
A Chimera não possui outras informações relevantes a serem divulgadas.
7. Grupo econômico
7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:
a. controladores diretos e indiretos
O controlador da sociedade é o Sr. Janser da Silva Saloman (controlador direto).
b. controladas e coligadas
A Chimera não possui controladas e coligadas.
c. participações da empresa em sociedades do grupo
A Chimera não detém participações em outras sociedades.
d. participações de sociedades do grupo na empresa
A Chimera não possui participações de sociedades na empresa.
e. sociedades sob controle comum
● Chimera Capital Partners Consultoria Empresarial Ltda. – CNPJ/ME: 15.492.157/0001-59.

• Montblanc Participações Ltda. – CNPJ/ME: 30.545.240/0001-32.

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

A Chimera não considera necessária a inclusão de um organograma societário.

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 Técnico:

O Departamento Técnico é responsável pela análise profunda e fundamentalista dos ativos, e, em geral, pela gestão dos fundos de investimentos, atuando sempre sob responsabilidade do diretor de gestão, responsável pela gestão de recursos perante a CVM, e supervisão do diretor executivo. Para elaboração das estratégias de investimento, serão levados em consideração o objetivo e regulamento de cada fundo, bem como as condições específicas do regulamento, tanto no que diz respeito a limites de concentração por ativo e emissão, quanto no que diz respeito a necessidade de liquidez para cada fundo. Para suportar as tomadas de decisões relacionadas aos fundos geridos, o referido departamento será responsável pela elaboração de estudos e análises fundamentalistas dos ativos, assim como pela execução das ordens, sempre segundo orientação geral ou específica estabelecida pelo diretor de gestão.

Departamento de Risco/Compliance:

O Departamento de Risco e Compliance operará com total independência em relação ao departamento técnico e à área responsável pela gestão de recursos da sociedade, e terá como finalidade acompanhar a exposição a riscos em relação a todos os portfólios sob gestão, bem como assegurar e zelar pelo cumprimento, pela Chimera e por seus colaboradores, de todas as regras e procedimentos de controles internos e das regulamentações e legislações aplicáveis às atividades desenvolvidas pela gestora.

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

N/A

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

Diretores	Atribuições
Rafael Fonseca Nogueira	Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários.
Cezar Monho Neto	Diretor Responsável pelo Compliance, Gestão de Riscos, Prevenção à Lavagem de Dinheiro.

8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 8.1

A Chimera acredita que não há necessidade de inserir organograma.

8.3. Em relação a cada um dos diretores de que tratam os itens 8.4, 8.5, 8.6 e 8.7 e dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar, em forma de tabela:

Nome	Rafael Fonseca Nogueira	Cezar Monho Neto
Idade	41 anos	35 anos
Profissão	Engenheiro	Advogado
CPF	299.298.108-70	382.857.968-0934
Cargo ocupado	Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários	Diretor Responsável pelo Compliance
Data da Posse	11/07/2023	12/07/2022
Prazo do Mandato	Indeterminado	Indeterminado
Outros Cargos na Empresa	N/A	Diretor de Gestão de Riscos e PLD

8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer:

a. currículo, contendo as seguintes informações:

i. cursos concluídos;

- Master of Business Administration (MBA) em Finanças – Insper – Jan/2022.
- Graduação em Engenharia Civil – Universidade de São Paulo (USP) – 2007.

ii. aprovação em exame de certificação profissional

- CGA/CGE.

iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:

- nome da empresa
- cargo e funções inerentes ao cargo
- atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
- datas de entrada e saída do cargo

- Jul/2023 – Atualmente - Chimera Capital – Diretor de Gestão
Função: Diretor Responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários da gestora.
Atividade: Administradora de Carteiras de Valores Mobiliários.
- Mar/2016 – Mar2020 – Localize – Diretor Executivo (CEO)
Função: Diretor Executivo (CEO).
Atividade: Aceleradora de recuperação de créditos, investigação de bens e ativos, inteligência de dados a gestão de créditos, soluções avançadas para credores, etc.

<ul style="list-style-type: none"> Mai/2017 – Jun/2019 – Itaim Asset Management – Diretor de Operações (COO) <u>Função:</u> Diretor de Operações da gestora. <u>Atividade:</u> Administradora de Carteiras de Valores Mobiliários.
8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e desta Resolução, fornecer:
a. currículo, contendo as seguintes informações:
i. cursos concluídos:
<ul style="list-style-type: none"> Pós-graduação em Direito Processual Civil – Damásio Educacional. Graduação em Direito – Centro Universitário das Faculdades Metropolitanas Unidas (FMU) / Pontifícia Universidade Católica de Campinas (PUC).
ii. aprovação em exame de certificação profissional
N/A
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
<ul style="list-style-type: none"> nome da empresa cargo e funções inerentes ao cargo atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram datas de entrada e saída do cargo
<ul style="list-style-type: none"> 2022 – Atualmente – Chimera Capital. <u>Função:</u> Diretor Responsável pela implementação das regras, políticas e controles internos da gestora. <u>Atividade:</u> Administradora de Carteiras de Valores Mobiliários. 2020 – 2022 – Deloitte Brasil – Consultor Sênior da Área de Asset Tracking. <u>Função:</u> Participação de investigações para rastreamento de ativos, relatórios de inteligência, mapeamento de grupos econômicos, entre outros. <u>Atividade:</u> Auditoria, consultoria, assessoria financeira, risk Advisory, consultoria tributária e serviços relacionados. 2017 – 2020 – Moraes Salles Advogados – Advogado <u>Função:</u> Responsável por demandas judiciais cíveis de média e alta complexidade, com controle de prazos, reuniões, elaboração de peças processuais e realização de audiências. <u>Atividade:</u> Escritório de Advocacia.
8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:
a. currículo, contendo as seguintes informações:
i. cursos concluídos;
ii. aprovação em exame de certificação profissional
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
<ul style="list-style-type: none"> nome da empresa

<ul style="list-style-type: none"> • cargo e funções inerentes ao cargo
<ul style="list-style-type: none"> • atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
<ul style="list-style-type: none"> • datas de entrada e saída do cargo
Vide 8.5
8.7. Em relação ao diretor responsável pela atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento, caso não seja a mesma pessoa indicada no item 8.4, fornecer:
a. currículo, contendo as seguintes informações:
i. cursos concluídos;
ii. aprovação em exame de certificação profissional
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
<ul style="list-style-type: none"> • nome da empresa
<ul style="list-style-type: none"> • cargo e funções inerentes ao cargo
<ul style="list-style-type: none"> • atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
<ul style="list-style-type: none"> • datas de entrada e saída do cargo
A Chimera não distribui as cotas dos fundos de investimentos sob sua gestão.
8.8. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:
a. quantidade de profissionais
05 (cinco) profissionais, incluindo o Diretor de Gestão de Recursos.
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
Gestão análise de emissores dos ativos que irão compor a carteira dos fundos, análise dos cenários macro e microeconômicos que impactam as estratégias dos fundos, operações e controles.
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
Todas as rotinas e procedimentos encontram-se devidamente discriminados na política de gerenciamento de riscos da Chimera.
Caberá à Chimera a análise e seleção dos ativos a serem adquiridos, bem como pela avaliação econômica de cedentes e devedores dos ativos alvo de operações.
Deste modo, a análise a ser feita pela Chimera levará em consideração a segurança sobre a existência, legitimidade e validade dos ativos, bem como a situação patrimonial dos agentes envolvidos. Quando as operações envolverem pessoas jurídicas, a análise abrangerá, inclusive, as informações de seus controladores e as questões relacionadas ao grupo econômico envolvidos.
Também serão analisados os riscos associados a cada operação, independentemente das partes envolvidas, tendo em vista a natureza de cada ativo, operação e agentes.
Para auxiliar a Chimera nesta análise, a sociedade dispõe de sistemas informatizados como o UpMiner, BigData Corp e sistema próprio de gestão.

8.9. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:
a. quantidade de profissionais
01 (um) Diretor de Compliance e Risco, 01 (um) Diretor Jurídico, 01 (um) Diretor responsável pela Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Processos Internos e 02 (dois) Analistas.
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
A diretoria de compliance visa verificar a conformidade e da Chimera, seus colaboradores e sócios com as normas e procedimentos determinados pelos órgãos reguladores, autorreguladores e, também, às normas descritas em todas as políticas e diretrizes da Chimera.
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
<p>Todas as rotinas e procedimentos encontram-se devidamente discriminados no Manual de Compliance e Código de Ética da sociedade.</p> <p>Para auxiliar nas atividades de compliance a Chimera possui uma biblioteca digital para armazenamento de documentos e registro de eventos.</p> <p>Os procedimentos de controles internos adotados pela área de compliance são baseados na implementação, monitoramento e avaliação. Dessa forma, a área é responsável em primeiro lugar pelo estabelecimento dos princípios e regras internas, as quais estão dispostas nos manuais e políticas da sociedade. Análise e monitoramento do cumprimento dos procedimentos internos adotados. Avaliação e adequação dos métodos e testes adotados para os processos de controles internos e, por fim, o acompanhamento do resultado desses testes sendo formalizados por meio de um relatório que indicará as falhas e os acertos, bem como um cronograma para saneamento.</p> <p>A área de compliance é também responsável por manter os colaboradores da sociedade devidamente atualizados sobre as normas e procedimentos a serem observados por eles, observado o programa de treinamentos.</p> <p>Dentre as atribuições da área de compliance estão: (i) fiscalização do cumprimento pelos colaboradores da Chimera das regras estabelecidas nos manuais da gestora; (ii) implementação de programas de treinamentos para os colaboradores, mantendo-os constantemente atualizados em relação aos códigos da sociedade e a outros de autorregulação aos quais a sociedade tenha aderido ou venha a aderir, bem como garantir o conhecimento dos colaboradores acerca da legislação atual aplicável às atividades da sociedade e às regras de Compliance e controles internos; (iii) acompanhamento das normas emitidas pelos órgãos reguladores e autorreguladores para adequação da Chimera; (iv) verificar os cálculos dos valores das cotas dos fundos geridos pela Chimera; (v) verificar o enquadramento dos fundos geridos, (vi) avaliação e revisão dos procedimentos e condutas da Chimera; (vii) assegurar a confidencialidade das informações relacionadas ao desempenho da atividade principal da Chimera; e (viii) restrição de acesso aos dados da sociedade relacionados à atividade de gestão.</p>
d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor

<p>O Diretor de Risco e Compliance atuará com completa independência para tomar qualquer decisão quanto às questões de <i>compliance</i>, sendo de sua exclusiva responsabilidade a gestão sobre essa área.</p>	
<p>8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de riscos, incluindo:</p>	
<p>a. quantidade de profissionais</p>	
<p>01 (um) Diretor de Compliance e Risco, 01 (um) Diretor Jurídico, 01 (um) Diretor responsável pela Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Processos Internos e 02 (dois) Analistas.</p>	
<p>b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes</p>	
<p>A Área de Gestão de Riscos produz relatórios, mantém controles, é responsável por redigir e atualizar as políticas de gestão de riscos e tem como incumbência organizar e gerenciar os comitês de risco.</p>	
<p>c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>	
<p>Todas as rotinas e procedimentos encontram-se devidamente discriminados na política de gerenciamento de riscos da Chimera.</p> <p>O controle e monitoramento de limites de estratégias são realizados diariamente pela equipe de gestão de risco O diretor de risco elabora relatório mensal para o diretor de gestão contendo os principais pontos acerca dos possíveis riscos.</p> <p>Para análise do crédito e risco dos direitos creditórios a Chimera utilizará planilhas proprietárias contendo as informações públicas obtidas pela equipe de risco, especialmente, em relação a processos em Tribunais Cíveis, Federais, Trabalhista e instancias superiores, Diário Oficial/Diário da Justiça, bem como nas juntas comerciais, sistemas registradores e sites de registro de imóveis e o Serasa, conforme o caso.</p> <p>Além disso, a Chimera contará com o auxílio do sistema UpMiner, plataforma desenvolvida para otimizar as atividades que auxiliam os processos de tomada de decisão de risco, sendo possível torná-los mais rápidos e assertivos.</p>	
<p>d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor</p>	
<p>Por fim, o Diretor Responsável pela Gestão de Riscos atuará com completa independência para tomar qualquer decisão quanto às questões de Risco, sendo de sua exclusiva responsabilidade a gestão sobre essa área.</p>	
<p>8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas, incluindo:</p>	
<p>a. quantidade de profissionais</p>	
<p>Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.</p>	
<p>b. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>	
<p>Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.</p>	
<p>c. a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade</p>	

Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.
8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:
a. quantidade de profissionais
A Chimera não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
A Chimera não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
c. programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas
A Chimera não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
d. infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição
A Chimera não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
e. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
A Chimera não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
A Chimera entende que não há outras informações relevantes a ser divulgadas.
9. Remuneração da empresa
9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 6.1, indicar as principais formas de remuneração que pratica
Taxa de Gestão, Taxa de Performance e Taxa de Ingresso.
9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total auferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente, durante o mesmo período, dos clientes em decorrência de:
a. taxas com bases fixas
100%
b. taxas de performance
0%
c. taxas de ingresso
0%
d. taxas de saída
0%
e. outras taxas
0%
9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
A Chimera não entende necessária a divulgação de outras informações.

10. Regras, procedimentos e controles internos
10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços
<p>A Chimera possui específica política para a contratação de terceiros, a fim de resguardar as boas práticas empresais e evitar danos a sociedade, especialmente, com a realização de <i>due diligence</i>.</p> <p>Resumindo, durante o processo de Contratação, os Colaboradores deverão obter informações qualitativas e de custo sobre o Terceiro que tenha interesse em iniciar vínculo jurídico com a Chimera, de modo a permitir um melhor julgamento durante a pré-seleção.</p> <p>O início das atividades do Terceiro deve ser vinculado à formalização da Contratação, e nenhum tipo de pagamento poderá ser efetuado antes da celebração do contrato. Os contratos celebrados para efetiva formalização da Contratação deverão possuir os requisitos contidos no Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para Administração e Gestão de Recursos de Terceiros.</p> <p>A Chimera realizará um monitoramento contínuo, pelo prazo que durar a Contratação, e analisando o objeto contratado vis a vis a entrega realizada, com ênfase nas eventuais disparidades na tempestividade, qualidade e quantidade esperadas. Ainda, este monitoramento deve ser capaz de identificar preventivamente atividades que possam resultar em riscos para a Chimera.</p>
10.2. Descrever como os custos de transação com valores mobiliários são monitorados e minimizados
<p>A Chimera não utiliza corretoras.</p>
10.3. Descrever as regras para o tratamento de <i>soft dollar</i>, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens etc.
<p>Conforme o Código de Ética da Chimera, todos os colaboradores são obrigados a informar ao Diretor de Compliance acerca das propostas de recebimento de presentes, cursos e viagens em valores superiores a R\$ 250,00 (duzentos e cinquenta reais).</p>
10.4. Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados
<p>A Chimera possui específico e detalhado Plano de Contingência e Continuidade de Negócios para que a atividade da sociedade não seja descontinuada quando da ocorrência de um imprevisto ou desastre; cabendo ao Diretor de Risco e Compliance a implementação.</p> <p>Deste modo, a fim de preservar as atividades da Chimera, todos os colaboradores possuem canal de comunicação facilitada ao Diretor de Risco e Compliance a fim de comunicar o mais rápido possível a situação adversa identificada ou ameaça de situação adversa.</p> <p>Assim, uma vez que seja identificada qualquer situação concreta ou que potencialmente ofereça risco às atividades, o Diretor de Risco e Compliance será imediatamente para que sejam tomadas as providências cabíveis; seja o acionamento do sistema de backup, seja o acionamento do sistema de recuperação de dados.</p>

De igual modo, com o objeto de avaliar as medidas que serão tomadas pela empresa, são analisados o cenário de risco e o potencial impacto na Chimera, considerando, ainda, sempre a probabilidade de sua ocorrência e o nível de gravidade

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

Por meio da Política de Gerenciamento de Risco, os colaboradores da Chimera são instruídos a analisar e identificar riscos a serem controlados.

A gestão do Risco de Liquidez considera a estrutura envolvida na atividade, especialmente quanto à liquidez dos ativos e características dos passivos geridos. Leva também em consideração que a gestão de liquidez é um controle que atua em conformidade aos eventos do mercado, tornando-se ainda mais relevante durante períodos de oscilações e crises.

Nestas situações o Diretor de Risco poderá, conforme o caso e observada a regulamentação e a especificidade de cada situação concreta, utilizar ferramentas para a gestão da liquidez, tais como: (i) suspensão temporária de resgates; (ii) resgate mediante entrega de ativos para os cotistas dos fundos; (iii) cisão do fundo; (iv) liquidação com valor depreciado de certos ativos; (v) a criação de Barreiras de Resgate, onde poderá existir a restrição dos pedidos de resgate a determinado percentual do patrimônio líquido do fundo ou da classe (art. 41, da Resolução CVM nº 175/22); e (vi) a adoção de *Side Pocket*, onde a seu exclusivo critério, a Chimera poderá cindir o patrimônio da classe os ativos excepcionalmente ilíquidos, para sua utilização na integralização de cotas de uma nova classe fechada ou de uma nova subclasse de classe fechada já existente (§5º, art. 44, da Resolução CVM nº 175/22).

A metodologia é revisada, no mínimo, anualmente, intervalo adequado às características dos fundos geridos, as variações históricas dos cenários eleitos para a realização do teste de estresse, além das condições de mercado vigentes. A revisão ainda sempre considerará a evolução das circunstâncias de liquidez e volatilidade dos mercados, em função das alterações de conjuntura e econômica, bem como a crescente sofisticação e diversificação dos ativos, refletindo a realidade dos respectivos mercados.

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

A Chimera não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.

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

www.chimeracapital.com.br

11. Contingências

11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, que sejam relevantes para os negócios da empresa, indicando:

a. principais fatos

b. valores, bens ou direitos envolvidos
A Chimera não possui qualquer tipo de contingência.
11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem sua reputação profissional, indicando:
a. principais fatos
b. valores, bens ou direitos envolvidos
O Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários não possui qualquer tipo de contingência.
11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores
O Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários não possui qualquer tipo de contingência.
11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que a empresa tenha figurado no polo passivo, indicando:
a. principais fatos
b. valores, bens ou direitos envolvidos
A Chimera não possui qualquer tipo de contingência.
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
b. valores, bens ou direitos envolvidos
O Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários não possui qualquer tipo de contingência.
12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, informando sobre:
a. acusações decorrentes de processos administrativos, bem como punições sofridas, nos últimos 5 (cinco) anos, em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, Banco Central do Brasil, Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC, incluindo que não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos
O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários declara que não existem acusações decorrentes de processos administrativos, bem como não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pela CVM, pelo Banco Central do Brasil, pela Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou pela Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC, incluindo

que não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos.

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

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários declara que não existem condenações por crime falimentar, prevaricação, suborno, concussão, peculato, “lavagem” de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores, contra a economia popular, a ordem econômica, as relações de consumo, a fé pública ou a propriedade pública, o sistema financeiro nacional, ou a pena criminal que vede, ainda que temporariamente, o acesso a cargos públicos, por decisão transitada em julgado, ressalvada a hipótese de reabilitação.

c. impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários declara que não está impedido de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa.

d. inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários declara que não está incluído no cadastro de serviços de proteção ao crédito.

e. inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários, declara que não está incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado.

f. títulos contra si levados a protesto

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários, declara que não tem contra si títulos levados a protesto.

RAFAEL FONSECA NOGUEIRA

Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários