

ANEXO E - Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

CHIMERA CAPITAL ASSET MANAGEMENT LTDA.

CNPJ/MF 37.332.689/0001-61

Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2025

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/> <p style="text-align: center;">RAFAEL FONSECA NOGUEIRA</p> <p style="text-align: center;">Diretor responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários</p>
	<hr/> <p style="text-align: center;">CEZAR MONHO NETO</p> <p style="text-align: center;">Diretor responsável pelo Compliance, Gestão de Riscos e PLD</p>
2.	Histórico da empresa
2.1.	Breve histórico sobre a constituição da empresa
	A Chimera Capital Asset Management Ltda. (“Chimera Asset” ou “Gestora”) 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 das melhores oportunidades de investimento e, por conseguinte, da satisfação de seus investidores. O Ato Declaratório nº 20.714 da CVM, de 22 de março de 2023, foi o marco oficial para a sua atuação como gestora de recurso de terceiros, com foco em ativos estressados e ilíquidos, em especial NPLs, precatórios, pré-precatórios e créditos decorrentes de operações estruturadas de maior complexidade. Todavia, a sua história já remonta ao ano de 2012, quando da constituição da Chimera Capital Partners Consultoria Empresa Ltda. (vide 6.2. b.)

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 constituição formal da Gestora, cujo marco foi a publicação do Ato Declaratório da CVM, a Chimera Asset passou por eventos societários, dos quais são relevantes mencionar, a nomeação do Sr. Gustavo Taucei Schellenberger, como Diretor de Gestão, e do Sr. Cezar Monho Neto, como Diretor de Compliance, Risco e PLD. Já em 11/07/2023, a Chimera Asset substituiu até então Diretor de Gestão, Sr. Gustavo Taucei Schellenberger, pelo Sr. Rafael Fonseca Nogueira.
b. escopo das atividades
Não houve alterações.
c. recursos humanos e computacionais
A Chimera Asset conta com 35 colaboradores, entre sócios, diretores, funcionários e terceirizados. A Gestora investe continuamente na aquisição de equipamentos e sistemas para a manutenção e melhoria dos recursos computacionais e tecnológicos necessários à sua atuação.
d. regras, políticas, procedimentos e controles internos
No ano de 2025, a Chimera Asset realizou a habitual atualização no seu conjunto de Políticas e Manuais.
3. Recursos humanos
3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:
a. número de sócios
1
b. número de empregados
29
c. número de terceirizados
5
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/MF 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/MF n.º 299.298.108-70
4. Auditores
4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:
a. nome empresarial
A Chimera Asset não possui auditoria independente.
b. data de contratação dos serviços
A Chimera Asset não possui auditoria independente.
c. descrição dos serviços contratados

A Chimera Asset não possui auditoria independente.	
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)
Sim.	
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 Asset, devidamente credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários na CVM, por meio do Ato Declaratório nº 20.714, exerce exclusivamente a gestão discricionária de recursos de terceiros, por meio de fundos de investimento.	
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 Asset atua na gestão de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios e em seus respectivos <i>Feeders</i> (Fundos de Investimento Financeiro), direcionados a um nicho específicos de investidores, que objetivam alocar seus investimentos em ativos negociados no Brasil.	
c.	tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão
Os ativos sob gestão da Chimera Asset, por meio dos veículos de investimento anteriormente citados, compreendem debêntures, notas comerciais, cotas de fundos estruturados, cotas de fundos de liquidez e direitos creditórios.	
d.	se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor
A Chimera Asset 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 Asset exerce exclusivamente 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 Asset é controlada por um administrador comum, o qual também, direta ou indiretamente, participa no capital das seguintes entidades:	
(a) Chimera Capital Partners Consultoria Empresarial Ltda., CNPJ/MF nº 15.492.157/0001-59 (“Chimera Capital Partners”).	
(b) Montblanc Participações S.A., CNPJ/MF nº 30.545.240/0001-32 (“Montblanc”).	

(c) Chimera RE2 Participações Ltda., CNPJ/MF nº 34.767.978/0001-03 (“Chimera RE2”).

(d) Chimera RE3 Participações Ltda., CNPJ/MF nº 34.766.638/0001-50 (“Chimera RE3”).

(e) Legal Claims Brasil Ltda., CNPJ/MF nº 54.196.765/0001-78 (“Legal Brasil”).

Nesse sentido, a Chimera Asset sujeita-se à ocorrência de situações de potencial conflito de interesse em relação à aquisição, por parte dos fundos geridos, de ativos originados e/ou apresentados por essas empresas.

Para mitigação desses potenciais conflitos de interesses, a Gestora possui segregação física e lógica em relação as demais entidades, sem contar a efetiva independência de tomada de decisão quanto aos colaboradores atuantes na área de gestão. Todos os possíveis conflitos de interesse são repassados ao Diretor de Compliance, Risco e PLD, o qual analisa o caso concreto e adota as devidas providências necessárias para a mitigação dos riscos.

Em acréscimo às referidas medidas, a Chimera Asset poderá fazer a divulgação do potencial conflito de interesses mediante previsão de tal possibilidade de contratação e/ou aquisição, nos contratos, nos regulamentos e/ou nos materiais publicitários dos fundos geridos, se aplicável. De qualquer modo, é assegurado que eventual contratação e/ou aquisição se dará em condições de mercado.

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: 464

Número de Investidores em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Qualificados: 464

Número de Investidores em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Não-Qualificados: 0

b. número de investidores, dividido por:

i. pessoas naturais

146

ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)

06

iii. instituições financeiras

0

iv. entidades abertas de previdência complementar

0

v. entidades fechadas de previdência complementar

0

vi. regimes próprios de previdência social

0

vii. seguradoras

0

viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil

0

ix. clubes de investimento

0

x. fundos de investimento

122
xi. investidores não residentes
0
xii. outros (especificar)
190 - PCO
c. recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)
Total: R\$ 1.112.155.737,63 de Patrimônio Líquido. Capital Comprometido a ser chamado: R\$ 355.000.000,00. Recursos Financeiros sob Administração em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Qualificados: R\$ 1.112.155.737,63 de Patrimônio Líquido. 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
R\$ 0,00
e. recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)
R\$ 117.380.917,04 R\$ 65.716.082,67 R\$ 59.179.277,33 R\$ 53.798.144,13 R\$ 51.803.196,53 R\$ 45.140.819,15 R\$ 43.426.511,69 R\$ 36.627.632,29 R\$ 31.452.696,36 R\$ 31.235.562,24
f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:
i. pessoas naturais
R\$ 83.440.736,67
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)
R\$ 115.139.318,96
iii. instituições financeiras
R\$ 0,00
iv. entidades abertas de previdência complementar
R\$ 0,00
v. entidades fechadas de previdência complementar
R\$ 0,00
vi. regimes próprios de previdência social
R\$ 0,00

vii. seguradoras
R\$ 0,00
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil
R\$ 0,00
ix. clubes de investimento
R\$ 0,00
x. fundos de investimento
R\$ 906.698.250,09
xi. investidores não residentes
R\$ 0,00
xii. outros (especificar)
R\$ 6.683.839,55 - PCO
6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:
a. ações
R\$ 0,00
b. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras
R\$ 0,00
c. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras
R\$ 0,00
d. cotas de fundos de investimento em ações
R\$ 0,00
e. cotas de fundos de investimento em participações
R\$ 9.957.121,49
f. cotas de fundos de investimento imobiliário
R\$ 0,00
g. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios
R\$ 390.004.238,95
h. cotas de fundos de investimento em renda fixa
R\$ 44.836.883,28
i. cotas de outros fundos de investimento
R\$ 153.496.297,21
j. derivativos (valor de mercado)
R\$ 0,00
k. outros valores mobiliários
R\$ 0,00
l. títulos públicos
R\$ 0,00

m. outros ativos
Imóveis (R\$ 2.149.500,00) e Direitos Creditórios (R\$ 513.048.029,51)
6.5. Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária
Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.
6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
A Chimera Asset 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
Vide item
c. participações da empresa em sociedades do grupo
Vide item 6.2.b.
d. participações de sociedades do grupo na empresa
Vide item 6.2.b.
e. sociedades sob controle comum
Vide item 6.2.b.
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 Asset 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
A Gestora possui uma diretoria composta por 3 (três) diretores: um diretor responsável pela visão estratégica, um diretor responsável pela gestão dos recursos de terceiros e um diretor responsável pelo compliance, controles internos, gestão de riscos e prevenção à lavagem de dinheiro. Departamento Técnico/Gestão: 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 suas condições específicas, 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 Compliance, Risco e PLD: O Departamento de Compliance, Risco e PLD opera 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 Asset 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

A Gestora possui um Comitê de Investimentos instituído em caráter não permanente de funcionamento e se reunirá sempre que algum assunto assim o justificar. A composição, regularidade e temas pertinentes podem variar quando se tratar de Comitê estabelecido em regulamento de fundo sob sua gestão.

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

Diretores	Atribuições
Janser da Silva Saloman	Diretor responsável pela visão estratégica e comercial.
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 Asset não considera necessária a inclusão de um 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	43 anos	37 anos
Profissão	Engenheiro	Advogado
CPF	299.298.108-70	382.857.968-09
Cargo ocupado	Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários	Diretor Responsável pelo Compliance, Gestão de Riscos, Prevenção à Lavagem de Dinheiro.
Data da Posse	11/07/2023	12/07/2022
Prazo do Mandato	Indeterminado	Indeterminado
Outros Cargos na Empresa	Diretor de Gestão	Diretor de Compliance, 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

<ul style="list-style-type: none"> • CGA/CGE.
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
<ul style="list-style-type: none"> • Jul/2023 – Atualmente - Chimera Capital – Diretor de Gestão <u>Função:</u> Diretor Responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários da gestora. <u>Atividade:</u> Administradora de Carteiras de Valores Mobiliários. • Mar/2016 – Mar2020 – Localize – Diretor Executivo (CEO) <u>Função:</u> Diretor Executivo (CEO). <u>Atividade:</u> Aceleradora de recuperação de créditos, investigação de bens e ativos, inteligência de dados a gestão de créditos, soluções avançadas para credores, etc. • 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
<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
<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

Função: Responsável por demandas judiciais cíveis de média e alta complexidade, com controle de prazos, reuniões, elaboração de peças processuais e realização de audiências.

Atividade: 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:

- 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

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:

- 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

A Chimera Asset 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

20 (vinte) profissionais, incluindo o Diretor de Gestão.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

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 Asset.

Caberá à Chimera Asset 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 Asset 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 à cada operação, independentemente das partes envolvidas, à natureza de cada ativo, operação e agentes.

Para auxiliar nesta análise, a Gestora dispõe de sistemas contratados e ferramentas próprias.

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

08 (oito) profissionais, incluindo o Diretor de Compliance, Risco e PLD.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A área de controles visa verificar a conformidade das operações da Chimera Asset, 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 internas.

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

Todas as rotinas e procedimentos encontram-se devidamente discriminados no Manual de Compliance e Código de Ética da Gestora.

Para auxiliar nas atividades de compliance, a Chimera Asset possui uma biblioteca digital para armazenamento de documentos e registro de eventos.

Os procedimentos de controles internos adotados pela área são baseados na implementação, monitoramento e avaliação. Dessa forma, a área é responsável (i) pelo estabelecimento dos princípios e regras internas, os quais estão dispostos nos manuais e políticas da Gestora; (ii) pela análise e monitoramento do cumprimento dos procedimentos internos adotados; (iii) pela avaliação e adequação dos métodos e testes adotados para os processos de controles internos e, por fim, (iv) pelo 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.

A área de controles é também responsável por manter os colaboradores da Gestora devidamente atualizados sobre as normas e procedimentos a serem observados por eles, observado o programa de treinamentos.

Dentre as atribuições da área estão: (i) fiscalização do cumprimento pelos colaboradores da Chimera Asset das regras estabelecidas nos manuais; (ii) implementação de programas de treinamentos para os colaboradores, mantendo-os constantemente atualizados em relação aos códigos de órgãos de autorregulação, aos quais a Gestora tenha aderido ou venha a aderir, bem como garantir o conhecimento dos colaboradores acerca da legislação atual aplicável às atividades desenvolvidas, as regras de Compliance e os controles internos; (iii) acompanhamento das normas emitidas pelos órgãos reguladores e autorreguladores para adequação da Gestora; (iv) verificação dos cálculos dos valores das cotas dos fundos geridos; (v) verificação o enquadramento dos fundos geridos; (vi) avaliação e revisão dos procedimentos e condutas da Gestora; (vii) assegurar a confidencialidade das informações relacionadas ao desempenho da atividade da Gestora; e (viii) assegurar a restrição de acesso de dados relacionados à atividade de gestão.

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

O Diretor de Compliance, Risco e PLD atuará com completa independência para tomar qualquer decisão quanto às questões de *compliance*, sendo de sua exclusiva responsabilidade a gestão sobre essa área.

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

a. quantidade de profissionais

08 (oito) profissionais, incluindo o Diretor de Compliance, Risco e PLD.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A área produz relatórios, mantém controles e é responsável por redigir e atualizar as políticas de gestão de riscos e tem como incumbência organizar e gerenciar eventuais comitês de risco.

c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
<p>Todas as rotinas e procedimentos encontram-se devidamente discriminados na política de gerenciamento de riscos da Chimera Asset.</p> <p>O controle e monitoramento de limites de estratégias são realizados diariamente pela área. A equipe elabora relatórios contendo os principais pontos acerca dos possíveis riscos, caso identificados.</p> <p>Para análise do crédito e risco dos direitos creditórios, a Chimera Asset utiliza 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 Asset conta com o auxílio do sistema proprietário desenvolvido para otimizar as atividades que auxiliam os processos de tomada de decisão de risco, sendo possível torná-los mais rápidos e assertivos.</p>
d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor
<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>
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:
a. quantidade de profissionais
<p>Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.</p>
b. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
<p>Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.</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.</p>
8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:
a. quantidade de profissionais
<p>A Chimera Asset não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.</p>
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
<p>A Chimera Asset não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.</p>
c. programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas
<p>A Chimera Asset não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.</p>
d. infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição
<p>A Chimera Asset não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.</p>
e. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
<p>A Chimera Asset não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.</p>
8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
<p>A Chimera Asset entende que não há outras informações relevantes a ser divulgadas.</p>
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 (<i>Fee</i> Estruturação).
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
75%
b. taxas de performance
15%
c. taxas de ingresso
10%
d. taxas de saída
0%
e. outras taxas
0%
9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
A Chimera Asset 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 Asset possui específica política para a contratação de terceiros, a fim de resguardar as boas práticas empresariais 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 Asset, 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 Asset 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.</p>
10.2. Descrever como os custos de transação com valores mobiliários são monitorados e minimizados
A Chimera Asset não utiliza corretoras.
10.3. Descrever as regras para o tratamento de <i>soft dollar</i>, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens etc.
Conforme o Código de Ética da Chimera Asset, 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\$ 500,00 (quinhentos reais).
10.4. Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados

A Chimera Asset 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 Compliance a implementação.

Deste modo, a fim de preservar as atividades da Gestora, todos os colaboradores possuem canal de comunicação facilitada ao Diretor de Compliance a fim de comunicar o mais rápido possível a situação adversa identificada ou ameaça de situação adversa.

Assim, uma vez que seja identificada qualquer situação concreta ou que potencialmente ofereça risco às atividades, o Diretor de Compliance será imediatamente acionado, para que sejam tomadas as providências cabíveis, seja o acionamento do sistema de backup, seja o acionamento do sistema de recuperação de dados.

De igual modo, com o objeto de avaliar as medidas que serão tomadas, são analisados o cenário de risco e o potencial impacto na Gestora, 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 Asset 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 Asset 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 Asset 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 Asset 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