



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

ANEXO E À RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica – Art. 17, II
(informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro)

ADMINISTRADORES DE CARTEIRAS DE VALORES MOBILIÁRIOS	Os campos assinalados com “FG” são facultativos para o administrador registrado na categoria gestor de recursos
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	Anexo I
2. Histórico da empresa¹	
2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa	A Carbon Asset Management Ltda. foi constituída em 2020 pela Carbon Holding S.A. com o objetivo de ofertar aos clientes do Grupo C6 produtos diferenciados, de acordo com seus perfis e necessidades de investimentos. A gestora possui fundos de investimentos, os quais negociam (no Brasil ou no

¹ A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>exterior) ativos locais e internacionais com diferentes riscos, tais como títulos públicos e privados, ações, derivativos, bem como fundos de investimentos de diferentes categorias.</p> <p>A oferta vai ao encontro com o objetivo do Grupo em ser um banco completo para os clientes, disponibilizando produtos e serviços exclusivos de forma transparente.</p>
<p>2.2. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo:</p>	
<p>a. os principais eventos societários, tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário</p>	<p>Em fevereiro de 2022, a sócia quotista Carbon Holding S.A. transferiu à JPMorgan Chase Holdings LLC um determinado número de quotas da Carbon Asset Management Ltda. que conferiu à JPMorgan Chase Holdings LLC uma participação de 40% (quarenta por cento) no capital social da Carbon Asset Management Ltda. O atual quadro de sócios da Carbon Asset Management Ltda. e suas respectivas participações no capital social encontram-se indicados no item 3.1 (a) abaixo.</p>
<p>b. escopo das atividades</p>	<p>N/A</p>
<p>c. recursos humanos e computacionais</p>	<p>N/A</p>
<p>d. regras, políticas, procedimentos e controles internos</p>	<p>N/A</p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

3. Recursos humanos²	
3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:	
a. número de sócios	Dois (02), sendo eles: <ul style="list-style-type: none">• 60% – Carbon Holding S.A.• 40% – JPMorgan Chase Holdings LLC
b. número de empregados	Gestora: 07 (sete) Áreas compartilhadas: 42 (quarenta e dois)
c. número de terceirizados	0 (zero)
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	Sr. Tiago Miranda Quixada, CPF 010.508.823-42, responsável pela gestão da carteira de valores mobiliários, possui certificação CGA (ANBIMA) válida.
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, bem como seus respectivos setores de atuação	Sr. Tiago Miranda Quixada, CPF 010.508.823-42, responsável pela gestão da carteira de valores mobiliários.
4. Auditores	
4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:	
a. nome empresarial	PricewaterhouseCoopers.

² A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

b. data de contratação dos serviços	4 de novembro de 2021.
c. descrição dos serviços contratados	Serviços de auditoria externa.
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	N/A. Conforme indicado no item 9.2 (a), a Carbon Asset Management Ltda. possui menos do que 36 meses desde seu início operacional
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 ³	FG
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 gestora foi constituída para exercer a gestão discricionária de recursos de terceiros, sendo responsável pela gestão 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	A Carbon Asset Management Ltda. realiza a gestão de fundos de investimento.

³ A apresentação destas demonstrações financeiras e deste relatório é obrigatória apenas para o administrador registrado na categoria administrador fiduciário de acordo com o inciso II do § 2º do art. 1º.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

investimento em direitos creditórios, fundos de índice, clubes de investimento, carteiras administradas etc.)	
c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão	Os fundos de investimento investem em: <ul style="list-style-type: none">• Títulos públicos;• Títulos Privados;• Ações;• Derivativos;• Cotas de Fundos de Investimento. Os ativos são locais ou internacionais e negociados no Brasil ou exterior.
d. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor	A Carbon Asset Management Ltda. não atua na distribuição de cotas de 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	Não aplicável. A Carbon Asset Management Ltda. exerce apenas atividades de gestão discricionária de recursos de terceiros.
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 Carbon Asset Management Ltda. faz parte do Grupo C6, que atua em outros segmentos, tais como Banco Múltiplo com Carteira Comercial, Corretora, Seguros, Meios de Pagamento e outros. Para a gestão de possíveis conflitos de interesse entre as atividades do Grupo e as atividades da Carbon, reiteramos que a estrutura de gestão de recursos está



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>fisicamente segregada das demais atividades da empresa e do Grupo, de forma a preservar o acesso à área.</p> <p>Adicionalmente, há controle de acesso lógico, conforme disposto em nossas políticas, de modo a não haver compartilhamento de informações não públicas entre as diferentes empresas.</p> <p>Além disso, a Carbon Asset Management Ltda. segue políticas e procedimentos que visam mitigar potenciais conflitos de interesse e proteger o sigilo das informações. As políticas abrangem a definição de conflito de interesse, consequências, responsabilidades do colaborador, entre outros aspectos.</p> <p>A área de Compliance é responsável pela gestão das políticas e procedimentos, destacando-se a aplicação de treinamentos regulatórios para colaboradores.</p>
6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos ⁴ 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)	Aprox. 43,4 mil investidores.
b. número de investidores, dividido por:	
i. pessoas naturais	Aprox. 43,4 mil.

⁴ Se for o caso, fornecer informações apenas dos investidores dos fundos **feeders**, e não do fundo **master**.

**COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)	2
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	0
xi. investidores não residentes	0
xii. outros (especificar)	0
c. recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)	Aprox. R\$ 277,2 milhões.
d. recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior	Aprox. R\$ 1,1 milhão.
e. recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)	1 - R\$ 19.957.235,93 2 - R\$ 17.434.268,55 3 - R\$ 16.754.674,35 4 - R\$ 8.444.703,78



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	5 - R\$ 5.599.734,83 6 - R\$ 3.894.189,4 7 - R\$ 3.799.993,73 8 - R\$ 2.576.337,5 9 - R\$ 2.453.471,27 10 - R\$ 1.975.407,98
f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:	
i. pessoas naturais	Aprox. R\$ 240,5 milhões.
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)	Aprox. R\$ 36,7 milhões.
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	0
xi. investidores não residentes	0

**COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

xii. outros (especificar)	0
6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:	
a. ações	Aprox. R\$ 38,2 milhões
b. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras	0
c. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	Aprox. R\$ 16,2 milhões
d. cotas de fundos de investimento em ações	Aprox. R\$ 21,6 milhões
e. cotas de fundos de investimento em participações	0
f. cotas de fundos de investimento imobiliário	0
g. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	0
h. cotas de fundos de investimento em renda fixa	Aprox. R\$ 78,9 milhões
i. cotas de outros fundos de investimento	Aprox. R\$ 19,7 milhões
j. derivativos (valor de mercado)	Aprox. R\$ 39 milhões
k. outros valores mobiliários	0
l. títulos públicos	Aprox. R\$ 102,4 milhões
m. outros ativos	Aprox. R\$ 0,2 milhões
6.5. Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária	FG

**COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes	N/A
7. Grupo econômico	
7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:	
a. controladores diretos e indiretos	Controlador direto - Carbon Holding S.A. Controladores indiretos – Csixers 3 Holding S.A. (controladora da Carbon Holding S.A.), Csixers Holding S.A. (controladora da Csixers 3 Holding S.A.) e Marcelo Kalim (controlador da Csixers Holding S.A. e beneficiário final da Asset).
b. controladas e coligadas	Não há.
c. participações da empresa em sociedades do grupo	Não há.
d. participações de sociedades do grupo na empresa	Apenas a Carbon Holding S.A.
e. sociedades sob controle comum	Carbon Holding Financeira S.A., Csixers 2 Holding S.A., Carbon Investments S.A., Banco C6 S.A. e N7 Holding S.A.
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.	Não Aplicável.
8. Estrutura operacional e administrativa⁵	

⁵ A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

<p>8.1. Descrever a estrutura administrativa da empresa, conforme estabelecido no seu contrato ou estatuto social e regimento interno, identificando:</p>	
<p>a. atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico</p>	<p><u>Conselho de Administração</u>: supervisiona a administração e direciona e acompanha os negócios da sociedade.</p> <p><u>Diretoria</u>: gerencia o andamento dos negócios da sociedade e pratica todos os atos necessários ao seu regular funcionamento, observadas as disposições legais e estatutárias aplicáveis.</p> <p><u>Gestão de Recursos</u>: toma as decisões de investimentos (alocação em ativos e tamanho de alocação) baseado nos insumos provenientes da área de Pesquisa Econômica.</p> <p><u>Comitê de Gestão</u>: discussão de temas de investimentos, incluindo análise de cenários, indicadores econômicos, preço de ativos e alocação em classe de ativos com os respectivos pesos.</p> <p><u>Comitê Operacional da Asset</u>: fórum multidisciplinar para discussão e acompanhamento de temas relevantes da gestora.</p>
<p>b. em relação aos comitês, sua composição, frequência com que são realizadas suas reuniões e a forma como são registradas suas decisões</p>	<p><u>Comitê de Gestão</u>: composto pelo Diretor de Gestão, e membros da área de Gestão. Frequência mensal ou sempre que convocada pelo responsável pela área de</p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>Gestão. Decisões registradas em Atas.</p> <p><u>Comitê Operacional da Asset</u>: composto pelo Diretor de Gestão e membros das áreas de Gestão de Recursos, Diretor de Compliance e membros da área de Compliance, Diretor de Riscos e membros da área de Riscos, membros da área jurídica e eventualmente membros convidados. Frequência quinzenal ou ad hoc. Decisões registradas em Atas.</p>
<p>c. em relação aos membros da diretoria, suas atribuições e poderes individuais</p>	<p>Marcelo Kalim: Diretor Presidente.</p> <p>Tiago Miranda Quixada: Diretor de Gestão. Responsável pela administração das carteiras de valores mobiliários.</p> <p>Patricia Sauma Giglio: Diretora Jurídica e de Compliance. Responsável pela gestão e representação da Sociedade e demais assuntos atinentes ao Departamento Jurídico e de Compliance em geral.</p> <p>Philippe Katz: Diretor Financeiro.</p> <p>Nelson Novaes Neto: Diretor de Tecnologia.</p> <p>Fernando Nogueira Nolasco Astolfi: Diretor de Risco. Responsável pela gestão de riscos.</p> <p>Marcelo Cruz de Haidar Jorge: Diretor sem Designação Específica.</p> <p>Gustavo Caldas da Silva: Diretor de Integridade. Responsável pelo cumprimento das normas relativas à</p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>prevenção à lavagem de dinheiro, nos termos da Resolução CVM nº 50/21, bem como pelo cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos da Sociedade do art. 4º, IV, da Resolução CVM nº 21/21.</p> <p>Os Diretores citados possuem poderes individuais para o desempenho de suas atividades, no que diz respeito aos seus respectivos campos de atuação. Em relação à representação da instituição, prevalece o especificado nos documentos societários.</p>
<p>8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 8.1.</p>	<p>Não aplicável.</p>
<p>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:</p>	
<p>a. nome</p>	<p><u>Tiago Miranda Quixadá</u></p>
<p>b. idade</p>	<p>Atribuição: Administração de Carteira Idade: nascimento em 19/08/1986</p>
<p>c. profissão</p>	<p>Profissão: Engenheiro</p>
<p>d. CPF ou número do passaporte</p>	<p>CPF: 010.508.823-42</p>
<p>e. cargo ocupado</p>	<p>Cargo: Diretor Data da Posse: Set/21</p>
<p>f. data da posse</p>	<p>Prazo do Mandato: Indeterminado</p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

g. prazo do mandato	Outros Cargos ou Funções: N/A
h. outros cargos ou funções exercidas na empresa	<p><u>Gustavo Caldas da Silva</u> Atribuição: Diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos. Idade: nascimento em 26/12/1978 Profissão: Bacharel em Ciências Contábeis CPF: 082.200.647-22 Cargo: Diretor Data da Posse: 03/04/2023 Prazo do Mandato: Indeterminado Outros Cargos ou Funções: Diretor responsável pelo cumprimento das normas relativas à prevenção à lavagem de dinheiro</p> <p><u>Fernando Nogueira Nolasco Astolfi</u> Atribuição: Diretor responsável pela gestão de risco Idade: nascimento em 04/08/1983 Profissão: Engenheiro Eletricista CPF: 104.480.007-09 Cargo: Diretor Data da Posse: 03/04/2023 Prazo do Mandato: Indeterminado Outros Cargos ou Funções: N/A</p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer:	
a. currículo, contendo as seguintes informações:	<u>Formação acadêmica</u>
i. cursos concluídos;	<ul style="list-style-type: none">• Instituto Tecnológico de Aeronáutica (ITA): Graduação em Engenharia Mecânica-Aeronáutica (2004-2008).• Inspers: MBA Executivo em Finanças (2015-2017).
ii. aprovação em exame de certificação profissional	
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	<u>Exames de Certificação Profissional</u> <ul style="list-style-type: none">• CPA-20 (Mai/20).• CGA (Mar/21).
<ul style="list-style-type: none">• nome da empresa	<u>Experiência profissional</u>
<ul style="list-style-type: none">• cargo e funções inerentes ao cargo	<ul style="list-style-type: none">• Banco BBM (2008-2011):<ul style="list-style-type: none">○ Iniciou, em julho de 2008, sua carreira em análise e gestão de investimentos, responsável pela gestão de fundos de fundos de investimentos e alocação dos recursos dos clientes da BBM Investimentos.○ Em julho de 2010, foi para mesa de operações de Renda Fixa, responsável pela tesouraria dos fundos de investimentos, alocação de estratégias específicas para fundos institucionais e/ou restritos e desenvolvimento e aprimoramento dos produtos da BBM Investimentos.
<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	



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<ul style="list-style-type: none">• BBM II Gestão de Recursos (2011-2013):<ul style="list-style-type: none">○ Em novembro de 2011, com a segregação da gestora de recursos da BBM Investimentos do Banco, se tornando por fim independente, continuou com suas atividades na mesa de Renda Fixa. • Opus Gestão de Recursos (2014):<ul style="list-style-type: none">○ Responsável pelas operações de Renda Fixa em juros futuros e títulos públicos dos fundos de investimentos; além de operações de tesouraria on-shore dos fundos. • Banco Santander (2015-2021):<ul style="list-style-type: none">○ Gerente de Riscos de Mercado da Tesouraria do Banco; responsável pela equipe de análise das diversas métricas de riscos de mercado e capital, de acordo com os critérios regulatórios nacionais e internacionais. • Carbon Asset Management Ltda. (2021-Atual):<ul style="list-style-type: none">○ Responsável pela administração de recursos da Carbon Asset Management.
<p>8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas,</p>	



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

procedimentos e controles internos e desta Resolução, fornecer:	
a. currículo, contendo as seguintes informações:	<u>Formação acadêmica</u>
i. cursos concluídos;	• Candido Mendes University – Centro RJ: Graduação em Ciências Contábeis (1998 –2001).
ii. aprovação em exame de certificação profissional (opcional);	
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	
• nome da empresa	<u>Experiência profissional</u> • BDO Trevisan Auditores Independentes (2002 – 2004): <ul style="list-style-type: none">○ Suas atividades incluíam a participação em projetos de auditoria contábil, envolvendo: definição de trabalho, mapeamento, levantamento, revisão das demonstrações financeiras, análise e modelagem de processos visando sua melhoria contínua.○ Principais clientes: Vale, OI, Xerox, ALBRAS e ALUNORTE.
• cargo e funções inerentes ao cargo	
• atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	
• datas de entrada e saída do cargo	
	• PWC (Preço Waterhouse Coopers) (2004 – 2006): <ul style="list-style-type: none">○ Responsável por gestão de projetos de consultoria empresarial, com experiência em projetos de compliance da Lei Sarbanes-Oxley. (“SOX”).○ Responsável por ministrar treinamentos SOX para



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>funcionários e clientes; atender clientes com necessidades de otimização de processos financeiros, produção ou implantação de estrutura de controles internos;</p> <ul style="list-style-type: none">○ Principais clientes: ALBRAS, ALUNORTE e PSA (Peugeot / Citroën).● Banco BTG Pactual (2006-2016)<ul style="list-style-type: none">○ Ingressou como gerente de Compliance, sendo responsável pelas divisões de Investment Banking, reporte de Compliance diretamente ao Head Global de Compliance.○ Implantação da Sala de Controle em escala global, atuando no desenvolvimento de controles, processos e sistemas.○ Liderança do grupo de trabalho responsável pela implementação do PQO e da regulamentação regulatória como ICVM 505, ICVM 542, ICVM 400, ICVM 476 e ICVM 883.○ Interface e implementação de práticas de Compliance da matriz nos escritórios internacionais
--	---



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>(EUA, Reino Unido, Chile, Colômbia e México).</p> <ul style="list-style-type: none">○ Implementação do processo de investimento pessoal para os colaboradores do grupo BTG Pactual em escala global.○ Interface com agências reguladoras, principalmente BSM, ANBIMA, FINRA, CVM e SUSEP.● XP Investimentos “XP Inc” (2016 – 2018)<ul style="list-style-type: none">○ Contratado para gerenciar a equipe de Compliance da XP Investimentos, atuou na melhoria e estruturação dos processos de Prevenção à Lavagem de Dinheiro, acompanhamento de demandas regulatórias e desenvolvimento de controles regulatórios relacionados à distribuição, gestão e intermediação de valores mobiliários.○ Ponto focal para atendimento a agências reguladoras e autorreguladores, responsável pela frente que garante os controles de governança para atender a Programa de Qualificação Operacional (PQO) da BSM.
--	---



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<ul style="list-style-type: none">○ Estruturou a área de Compliance para atender as demandas das áreas de Investment Banking (IBD), Research e Asset Management.○ Responsável pela gestão da governança dos agentes autônomos vinculados à XP Investimentos.● Grupo C6 (2018 – Atualmente):<ul style="list-style-type: none">○ Em abril de 2018 o Sr. Gustavo passou a integrar o C6 Bank, tendo sido contratado para estruturar e gerenciar as áreas de Compliance e Prevenção à Lavagem de Dinheiro do conglomerado C6 Bank. Desde 2018, é diretor estatutário de Controles Internos e Prevenção à Lavagem de Dinheiro da C6 Corretora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda., homologada pelo Banco Central do Brasil.○ Desenvolveu processo automatizado de Due Diligence de PLD consultando fontes públicas, através de bureau, para classificar cliente/fornecedor/parceiro em alto, médio ou baixo risco de suscetibilidade à lavagem de dinheiro.○ Implementou a área de monitoramento transacional para
--	---



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>identificar transações atípicas considerando requisitos regulatórios, otimização de processos e abordagem baseada em risco.</p> <ul style="list-style-type: none">○ Implementou também o desenvolvimento do disque-denúncia anônima, comitê de ética, gestão e criação de políticas/procedimentos corporativos, acompanhamento de demandas regulatórias, desenvolvimento de controles regulatórios relacionados à distribuição, gestão e intermediação de valores mobiliários.○ Participação relevante no processo de Due Diligence referente ao investimento do JP Morgan no C6 Bank.
<p>8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:</p>	
<p>a. currículo, contendo as seguintes informações:</p>	<p><u>Formação acadêmica</u></p> <ul style="list-style-type: none">• Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro: Graduação em Engenharia Elétrica (2002-2008)
<p>i. cursos concluídos;</p>	
<p>ii. aprovação em exame de certificação profissional</p>	<p><u>Experiência profissional</u></p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	<ul style="list-style-type: none">• Foco Asset Management (2007-2009)<ul style="list-style-type: none">○ Analista de Riscos, suas atividades incluíam a estimação dos riscos de mercado relacionados a carteira administrada pela Foco, a elaboração e execução de estratégias de gestão de riscos, relatórios de riscos e o desenvolvimento de metodologias de análise de risco para a administração de recursos de terceiros.• Opus Investimentos (2009 - 2012)<ul style="list-style-type: none">○ Gerente de Riscos, responsável pela análise prévia dos riscos associados às principais decisões de negócios da Opus, a elaboração de relatórios de análise de riscos dos ativos e mercados investidos pela Opus, e a avaliação dos métodos, políticas internas e estratégias de gestão de riscos em vigor.• BTG Pactual (2012 – 2022)<ul style="list-style-type: none">○ Ingressou no BTG Pactual em janeiro de 2012, ocupando o cargo de associado do banco em 2016.○ Foi responsável pelas áreas de Capital e Liquidez, assim como pela modelagem quantitativa e
• 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	



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>apreçamento dos ativos pertencentes ao BTG Pactual.</p> <ul style="list-style-type: none">○ Além disso, também foi responsável pela área de Controles Gerenciais e Contábeis de todas as unidades de negócios do Banco, incluindo Crédito, Wealth Management, Asset Management, Juros e Moedas, Ações, Cartão de Crédito, Investment Banking, entre outras.○ Entre suas responsabilidades, Fernando supervisionava e gerenciava estas áreas que possuíam mais de 150 funcionários. <ul style="list-style-type: none">● Banco C6 S.A. (2022 - Atualmente)<ul style="list-style-type: none">○ Ingressou no Grupo C6 em 2022 como Gerente de Riscos, responsável pela estruturação e gestão da área de Riscos do Banco.○ É responsável pelo desenvolvimento das políticas e estratégias de riscos do banco, supervisão da equipe de riscos e pela análise dos riscos inerentes a condução dos negócios do Banco C6.○ Entre suas responsabilidades, Fernando supervisiona mais de 320 empregados, sendo fundamental na
--	---



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	gestão da área de Riscos do Banco C6.
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:	Não aplicável. A Carbon Asset Management Ltda. não atua na distribuição de cotas de fundos de investimento.
• 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	
8.8. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:	
a. quantidade de profissionais	03 (três)
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes	A área de Gestão toma as decisões de estratégias de investimentos avaliando o cenário econômico, as expectativas e projeções econômicas. Considerando também os preços, liquidez e risco dos ativos nos mercados para definir as



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	alocações e posições. A área de gestão acompanha os indicadores de rentabilidade, risco, concentração, diversificação dos fundos, avaliando a aderência e conformidade aos objetivos definidos.
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	<p>O sistema Lote45 permite:</p> <ul style="list-style-type: none">• a elaboração de relatórios customizados que podem auxiliar em relatórios internos assim como na criação da lâmina do Fundo;• o cadastro e gerenciamento de prospectos, tanto de PF quanto de PJ;• Cadastro de rebates de distribuidores e Fundos, incluindo a rentabilidade por cautela;• Performance contra benchmark do Fundo;• Cálculo de taxa de administração, performance, IOF e IR por cautela, incluindo come-cotas;• Gerenciamento de aplicações e resgates por cliente, Fundo e distribuidor;• Agenda de eventos e reuniões;• Conciliação do XML do administrador;



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<ul style="list-style-type: none">• Resultado da carteira e estratégias com cálculo de cota e patrimônio;• Boletagem/captura automática/distribuição de trades;• Performance Attribution por classe de ativos, por estratégia e por setor da Bolsa no Brasil;• Verificação das posições vs XML Anbima e possibilidade de integração com outros sistemas.
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	18 (Dezoito)
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes	As áreas de Compliance e Controles da Carbon Asset Management Ltda. são responsáveis pela elaboração e manutenção do Programa de Compliance. Os procedimentos visam garantir o cumprimento das normas internas e legais, de forma a mitigar riscos regulatórios e de imagem.
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	A gestora adota rotinas e procedimentos para a implementação do Programa de Compliance, tais como: <ul style="list-style-type: none">• Gestão de políticas internas;



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<ul style="list-style-type: none">• Aplicação de treinamentos aos colaboradores;• Monitoramento de operações para prevenção à lavagem e dinheiro;• Realização de diligências em todas as partes com as quais mantenha relacionamento (clientes, parceiros, colaboradores, fornecedores etc.);• Apoio consultivo às demais áreas;• Acompanhamento das normas e diretrizes regulatórias;• Atendimento aos reguladores. <p>Utilizamos os sistemas e bureaus para a execução das atividades, sendo:</p> <ul style="list-style-type: none">○ Neoway;○ E-guardian – Advice;○ World Compliance – Lexis Nexis;○ Serasa;○ PH3A. <p>Adicionalmente, temos o sistema Lote45, que permite monitorar de forma automática:</p> <ul style="list-style-type: none">• Normas Prudenciais;• Normas do Regulamento de cada Fundo;• Normas Gerenciais criadas pelo cliente, incluindo métricas de risco, índices de liquidez, túnel de preço,
--	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>black-list, controle de day- trades, drawdown, stop-loss etc.;</p> <ul style="list-style-type: none">• Verificar a aderência às normas de novos trades antes de serem executados;• Reconciliar os trades efetivamente executados com os trades previamente autorizados;
<p>d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor</p>	<p>A área de Compliance é independente em relação às demais, e seus resultados são reportados diretamente ao Diretor de Compliance. Este, por sua vez, possui posição estatutária, reporta-se diretamente ao Presidente e não possui atuação em funções que poderiam gerar conflitos de interesse ou comprometer sua independência.</p>
<p>8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de riscos, incluindo:</p>	
<p>a. quantidade de profissionais</p>	<p>05 (cinco)</p>
<p>b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes</p>	<p>A área é responsável pelos procedimentos necessários ao cumprimento das diretrizes de gerenciamento de riscos estabelecidas, possuindo as seguintes atribuições:</p> <ul style="list-style-type: none">• Assegurar que todas as operações realizadas diariamente pelas áreas de gestão estejam corretamente contempladas e modeladas no Sistema de Operações e no Sistema



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>de Risco, de forma a refletir a totalidade da carteira de ativos de cada um dos Fundos;</p> <ul style="list-style-type: none">• Monitorar e assegurar que os limites de risco e/ou exposição estabelecidos para cada um dos Fundos sejam observados;• Gerar e encaminhar, diariamente, para a Diretoria e Áreas de Gestão relatórios de monitoramento de risco, dentre eles a exposição dos fundos, limites e parâmetros de risco de mercado estabelecidos;• Gerar e encaminhar, diariamente, às Áreas de Gestão, Controle Operacional e Compliance o relatório de Controle de Liquidez de Ativos;• Gerar e encaminhar, diariamente, às Áreas de Gestão, relatório com eventuais descasamentos de posições entre fundos multimercados com estratégias similares;• Atualizar estes procedimentos quando necessário, bem como submetê-los previamente à aprovação da Diretoria.
--	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

<p>c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>	<p>A Carbon Asset Management Ltda. utiliza um sistema terceirizado para o gerenciamento de risco de mercado. O Sistema Lote45 permite monitorar:</p> <ul style="list-style-type: none">• Métricas de Risco VaR histórico, VaR paramétrico, Stress Test e diversos relatórios;• Gregas: Delta, Gamma, Vega e Rho;• Simulação Delta-Gamma;• A LOTE45 atualmente possui mais de 500 classes de ativos já cadastradas que englobam tanto o mercado local quanto os mercados offshore, com manual de risco e modelagem de preços;• Configurar cada classe de produto ou cada produto específico, classificando como: a) sem liquidez ou em default, b) Só no vencimento, c) sem lockout (disponível), ou d) com lockup até uma determinada data;• Definir o ADTV (caso o produto ainda não tenha ADTV já calculado automaticamente pela LOTE45) e o percentual considerado viável de sair da posição causando uma alteração no preço razoável;
---	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<ul style="list-style-type: none">• Relatório específico de liquidez, mostrando o total liquidável em cada dia e acumulado dia a dia, incluindo gráfico;• Criar regras com valores percentuais do NAV mínimos de ativos liquidáveis em algum prazo – podem ser feitas quantas regras forem necessárias;• Criar regras com limites individuais de ADTV para cada produto específico.
d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor	A Área de Risco é subordinada ao Diretor de Riscos, visando independência em relação às demais áreas da instituição e evitando eventual conflito de interesse com as áreas de gestão. O Diretor de Riscos possui posição estatutária, reporta-se diretamente ao Presidente e não possui atuação em funções que poderiam gerar conflitos de interesse ou comprometer sua independência.
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:	FG
a. quantidade de profissionais	FG
b. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	FG

**COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

c. a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade	FG
8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:	
a. quantidade de profissionais	Não aplicável. Carbon Asset Management Ltda. não atua na distribuição de cotas de fundos de investimento.
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes	
c. programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas	
d. infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição	
e. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	
8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes	N/A
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	A Carbon Asset Management Ltda. é remunerada pela prestação dos seus serviços através das seguintes taxas: (i) taxa de administração expressa em percentual sobre o valor dos recursos sob gestão; e/ou (ii) taxa de performance sobre o excedente de determinado benchmark. No caso da taxa de administração o valor máximo de cobrança será de 2,10%. Para a



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	taxa de performance o valor máximo será de 20% da rentabilidade excedente sobre o benchmark.
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:	N/A, pois a Carbon Asset Management possui menos do que 36 meses desde seu início operacional.
a. taxas com bases fixas	N/A
b. taxas de performance	N/A
c. taxas de ingresso	N/A
d. taxas de saída	N/A
e. outras taxas	N/A
9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes	N/A
10. Regras, procedimentos e controles internos	
10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços	A política de contratação e gestão de serviços e terceiros vigente, prevê as definições de aspectos a serem considerados para a decisão pela contratação de serviços terceirizados, além dos papéis, responsabilidades e etapas desse processo para a adequada seleção, homologação, formalização, gestão e pagamento de prestadores de serviços. Para adequada seleção, prevê a avaliação da aderência da contratação com os objetivos estratégicos da instituição,



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>promovendo, sempre que possível, a igualdade de oportunidades e levando em consideração a existência de fornecedores similares já homologados, assim como a atuação de compras, conforme regras definidas em sua própria política, referenciada neste documento.</p> <p>Após a seleção, define que o prestador de serviço deve ser homologado pelas áreas aplicáveis, conforme tipologia do serviço prestado, podendo este ser classificado como um fornecedor relevante, para o quais estão definidas exigências adicionais.</p> <p>Seguindo por fim, para as definições sobre a elaboração, análise e assinatura do instrumento contratual entre as partes.</p> <p>Possui como definição que a prestação do serviço, assim como o pagamento pela prestação do serviço, deverá ocorrer apenas após a devida homologação e assinatura do contrato. Em casos de fornecedores com riscos a serem aprovados, são descritos os devidos fóruns para aprovação.</p> <p>Por fim, fica definida a responsabilidade de supervisão da prestação de serviço ao gestor responsável pelo contrato, assim como a reavaliação dos riscos do prestador de serviço pelas áreas envolvidas na sua homologação.</p>
<p>10.2. Descrever como os custos de transação com valores mobiliários são monitorados e minimizados</p>	<p>Há um processo de escolha dos prestadores de serviço, tais como corretoras, custodiantes, administradores, dentre</p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>outros. A escolha leva em consideração itens como corretagem, emolumentos e outros custos. Após a definição dos prestadores de serviço, estes passam pela validação de Compliance que realiza o seu processo de background check. Os custos são formalizados em contrato e os prestadores são revalidados periodicamente para manutenção de relacionamento.</p>
<p>10.3. Descrever as regras para o tratamento de soft dollar, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens etc.</p>	<p>Conforme previsto no Código de Ética e Conduta, nenhum Colaborador poderá aceitar presentes dados por terceiros em razão de seu cargo ou suas funções no C6.</p> <p>Excepcionalmente, os Colaboradores poderão aceitar presentes cujo valor unitário na data da entrega não exceda R\$ 500,00 (quinhentos reais).</p> <p>Além disso, caso o somatório dos Presentes recebidos por cada colaborador em um ano-calendário ultrapasse o referido limite de R\$ 1.500 (mil e quinhentos reais), ou quantia equivalente em moeda estrangeira, o Colaborador estará instruído a doar o excedente para o C6, que promoverá um sorteio do Presente aos seus Colaboradores.</p> <p>Em situações excepcionais, a área de Compliance poderá autorizar o recebimento de Presentes que não se enquadrem nas exceções acima, caso fique claro que tal ato não tem o condão de comprometer a imparcialidade e a impessoalidade na tomada de decisão por parte do Colaborador. Para a autorização</p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>citada acima, é necessária a aprovação do gestor direto do colaborador e da área de Compliance.</p>
<p>10.4. Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados</p>	<p>A Carbon Asset Management Ltda. possui um plano de continuidade de negócios, que estabelece um conjunto de estratégias e medidas para assegurar a continuidade de suas funções vitais diante da ocorrência de um ou mais eventos que afetem significativamente as suas operações.</p> <p>As ações de contingência descritas no plano estão baseadas em riscos que possam impactar a continuidade das operações da Carbon Asset Management Ltda., considerando principalmente os cenários de falha e/ou indisponibilidade de sistemas do Grupo C6, ausência de pessoas, perda e/ou indisponibilidade das instalações (edifícios) do Grupo C6, indisponibilidades e/ou falhas em serviços providos por prestadores de serviço etc.</p> <p>Adicionalmente, o Grupo C6 possui um plano de recuperação de desastres que visa o restabelecimento da infraestrutura tecnológica que suporta as funções e os processos críticos de negócio durante a ocorrência de um desastre. Os planos são testados anualmente para validar a efetividade das estratégias de contingência estabelecidas.</p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>Cumprе destacar que o Grupo C6 possui um plano sobre cópia de segurança (backup) das informações do Grupo, conforme critérios estabelecidos de elegibilidade e periodicidade. Além da execução do backup, o plano contempla ainda atividade de monitoramento, para que eventuais falhas sejam identificadas e corrigidas tempestivamente, bem como a atividade de restauração e teste de backups. O tempo de retenção dos backups é definido de acordo com as diretrizes internas e instrumentos normativos de reguladores.</p>
<p>10.5. Descrever as políticas, práticas e controles internos para a gestão do risco de liquidez das carteiras de valores mobiliários</p>	<p>O gerenciamento de risco de liquidez da Carbon Asset Management Ltda. tem como principal pilar a definição de forma conservadora dos prazos de resgates de seus fundos, de forma que os controles realizados servem como apoio na gestão diária e verificação das premissas comentadas. As diretrizes para gestão do risco de liquidez estão descritas no documento “Política de Gerenciamento de Riscos” da Carbon Asset Management Ltda.. Este documento contém as diretrizes do gerenciamento do risco de liquidez, como tratamento dos ativos e passivos, definição de limites e governança. Essas diretrizes estão de acordo com as regulamentações vigentes (Instrução CVM</p>



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>nº 555 e Código de Autorregulação da ANBIMA). Dentre os principais pontos, podemos destacar:</p> <p><u>Periodicidade da avaliação do risco de liquidez e comunicação</u></p> <ul style="list-style-type: none">• O risco de liquidez dos fundos geridos pela Carbon Asset Management, considerando as condições de mercado vigentes, perfis de liquidez dos ativos das carteiras e histórico de aquisição e resgates de cotas, deve ser avaliado com periodicidade diária.• Adicionalmente à avaliação do risco de liquidez tendo em conta as condições elencadas em Política, a Carbon Asset Management Ltda. deve realizar testes de estresse de liquidez com periodicidade mínima mensal. Os testes de estresse devem considerar, no mínimo, as movimentações do passivo, liquidez dos ativos investidos e o calendário de cotização dos fundos.• Independentemente das periodicidades acima descritas, a Carbon Asset Management Ltda. poderá recalcular, a qualquer tempo, as métricas de risco de
--	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>liquidez e os resultados dos testes de estresse de forma a avaliar os impactos decorrentes de conjunturas adversas de mercado e/ou outras situações que possam comprometer a liquidez dos fundos.</p> <ul style="list-style-type: none">• A Carbon Asset Management Ltda. deve informar, de forma tempestiva, ao Administrador Fiduciário, quaisquer eventos de iliquidez referentes aos ativos financeiros que compõem a carteira do fundo. O Administrador Fiduciário deve, por sua vez, fornecer as informações necessárias para que a Carbon Asset Management Ltda. gerencie de maneira eficaz o risco de liquidez dos fundos por esta geridos. <p><u>Diretrizes gerais para tratamento dos ativos</u></p> <ul style="list-style-type: none">• O gerenciamento do risco de liquidez do ativo dos fundos deve considerar a liquidez dos diferentes ativos dos fundos e as obrigações referentes depósitos de margem e outras garantias.• Na definição da liquidez dos diferentes ativos deve-se considerar a liquidez inerente de mercado
--	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>(profundidade) vis-à-vis o tamanho das posições detidas e, como consequência, um período de liquidação consistente (holding period).</p> <ul style="list-style-type: none">• Deve ser sempre considerado o prazo para liquidação (settlement) dos ativos vis-à-vis o prazo para liquidação de despesas operacionais e resgates de cotas, especialmente no caso de fundos cujo regulamento prevê uma porcentagem mínima do Patrimônio Líquido aplicados em uma classe de ativos específica.• O risco de liquidez do ativo deve também levar em conta as despesas correntes dos fundos, como pagamento de custos de auditoria, taxas de administração, taxas da CVM, dentre outros, assim como despesas devido à negociação de ativos como ajuste diário (e.g. futuros), compra de ativos e corretagens.• Fundos de Fundos (FICs): Para estes fundos, a referência para gestão do risco de liquidez deve considerar pelo calendário de cotização do FIC. Assim, a Liquidez do FIC deve ser
--	---



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	<p>monitorada com base nas exposições dos FIs investidos com prazo de cotização menor ou igual àquele do FIC.</p> <p><u>Diretrizes gerais para tratamento dos Passivos</u></p> <ul style="list-style-type: none">• O gerenciamento do risco de liquidez do passivo dos fundos deve considerar os resgates solicitados e agendados pelos cotistas bem como uma estimativa de resgates esperados baseada em critérios estatísticos robustos e compatíveis com o histórico do fundo. Deve ser analisado também o nível de concentração da propriedade das cotas do fundo e o seu potencial impacto na eventualidade de um resgate dessas posições concentradas. <p><u>Definição de limites</u></p> <ul style="list-style-type: none">• Os limites devem ser estabelecidos, consoante os regulamentos dos fundos e eventuais limites de liquidez que se façam necessários para garantir o bom gerenciamento e o enquadramento da liquidez do fundo.
--	---



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

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. 33, caso decida atuar na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor	Não se aplica. A Carbon Asset Management Ltda. não atua na distribuição de cotas de 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. 16 desta Resolução	https://c6gestoraderecursos.com.br/
11. Contingências ⁶	
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	A Carbon Asset Management Ltda. não possui processos relevantes em que figure no polo passivo.
b. valores, bens ou direitos envolvidos	A Carbon Asset Management Ltda. não possui processos relevantes em que figure no polo passivo.
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	O Diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários não possui processos em que figure no polo

⁶ A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	passivo e que afetem sua reputação profissional.
b. valores, bens ou direitos envolvidos	O Diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários não possui processos em que figure no polo passivo e que afetem sua reputação profissional.
11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores	Não aplicável.
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	A Carbon Asset Management Ltda. não possui condenações transitadas em julgado em que figure no polo passivo.
b. valores, bens ou direitos envolvidos	A Carbon Asset Management Ltda. não possui condenações transitadas em julgado em que figure no polo passivo.
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	O Diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários não



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

	possui condenações transitadas em julgado em que figure no polo passivo e que tenham afetado seus negócios ou sua reputação profissional.
b. valores, bens ou direitos envolvidos	O Diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários não possui condenações transitadas em julgado em que figure no polo passivo e que tenham afetado seus negócios ou sua reputação profissional.
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	Anexo III
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	
c. impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa	
d. inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito	



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

e. inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado	
f. títulos contra si levados a protesto	



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

Anexo I - Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário

Declaramos que o Formulário de Referência da Carbon Asset Management Ltda. foi revisado e aprovado, assim como 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.

Tiago Miranda Quixadá

Diretor responsável pela administração das carteiras de valores mobiliários

Gustavo Caldas da Silva

Diretor de Integridade



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares, Centro, Rio de Janeiro/RJ – CEP: 20050-901 – Brasil - Tel.: (21) 3554-8686
Rua Cincinato Braga, 340/2º, 3º e 4º Andares, Bela Vista, São Paulo/ SP – CEP: 01333-010 – Brasil - Tel.: (11) 2146-2000
SCN Q.02 – Bl. A – Ed. Corporate Financial Center, S.404/4º Andar, Brasília/DF – CEP: 70712-900 – Brasil -Tel.: (61) 3327-2030/2031
www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

Anexo III – Declarações adicionais do diretor responsável pela administração

Eu, Tiago Miranda Quixadá, na qualidade de diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários da Carbon Asset Management Ltda., declaro que:

- a) não sofri acusações decorrentes de processos administrativos, bem como punições, 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, e não estou inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos;
- b) não fui condenado 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) não estou impedido de administrar meus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa;
- d) não estou incluído em cadastro de serviços de proteção ao crédito;
- e) não estou incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado;
- f) não tenho títulos contra mim levados a protesto.

Tiago Miranda Quixadá

Diretor responsável pela administração das carteiras de valores mobiliários