

ANEXO 15-II da Instrução 558 CVM de 26 de março de 2015
DATA DO ENVIO 01/03/2019
ADMINISTRADORES DE CARTEIRA DE VALORES MOBILIÁRIOS

META ASSET MANAGEMENT LTDA
CNPJ: 06.088.907/0001-30

Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário

CÉLIO AFONSO DA SILVA

Sócio

Graduado em Administração de empresas pela UFMG, ingressou no mercado financeiro em 1974. Passou por todos os segmentos do mercado, de análises de investimentos, operações, criação e comercialização de produtos. Foi diretor executivo de mercado de capitais do BMG e posteriormente criou e foi sócio responsável pela BMG Asset Management por quase 10 anos

Durante sua gestão, a BMG Asset Management foi durante um período a quarta maior gestora de fundos de ações no Brasil, e foi uma das instituições pioneiras na estruturação de fundos de recebíveis (FIDC). Em 2003 desligou-se do grupo BMG para criar a Meta Asset Management em sociedade com o Grupo Brasif.

Constituiu o MAM International Fund, em parceria com o Banco UBS, tendo sido o seu diretor de Investimentos por dois anos, no período de 2005 a 2007.

Foi membro do Comitê Financeiro da Brasif Gestão Internacional que, administrava recursos nos mercados nacional e internacional.

Membro do Comitê de Riscos e de Investimentos da Meta Asset Management desde dezembro/2015.

ERIK SZANIECKI

Sócio

Graduado em medicina pela UFRJ. Experiência de 25 anos no mercado financeiro. Iniciou sua carreira em 1993 na corretora Ágora como trader. Atuou como trader de câmbio na Tesouraria do Banco Bozano, Simonsen. Em seguida na área de Riscos do Banco Santander. Voltou posteriormente para o grupo Bozano, na Asset Management reconstituída. Ingressou na Meta em 2018 como diretor de Risco e Compliance.



ÁLVARO GUILHERME MONTEIRO BARBOSA

Sócio

Graduado em Economia pela UCAM. Com experiência de mais de 30 anos em áreas de controles gerenciais em diversas Instituições financeiras. Trabalhou no Banco Brascan no Banco Brascan por 10 anos onde desenvolveu a área de controles e análises gerenciais e risco da instituição. Tem certificado CPA20 pela ANBIMA desde 2012. Atua na Meta como Controller e na diretoria de distribuição de fundos e suitability.

Declarações dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e desta Instrução, atestando que:

a: reviram o formulário de referência

R: O referido formulário foi elaborado pela equipe da Meta tomando como base os manuais de risco, compliance, política de segurança de informação e o Manual de Conduta Ética da Meta.

Tendo sido revisto pelo Diretor responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários e pelo Diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos, controles internos e controles relativos à ICVM 558, conforme declaram os mesmos para todos os fins de direito.

b: Declaram, ainda, os mesmos Diretores acima que as informações descritas são verdadeiras e espelham detalhadamente a estrutura operacional e organizacional da META ASSET MANAGEMENT.

R: As informações descritas são verdadeiras e espelham detalhadamente a estrutura operacional e organizacional da META ASSET MANAGEMENT

Histórico da empresa

Breve histórico sobre a constituição da empresa

R: A Meta Asset Management (MAM) é uma empresa nacional, independente, formada por profissionais de larga experiência no mercado financeiro, dedicada exclusivamente à gestão de recursos aliada à análise criteriosa de riscos. Formada em março de 2004, partir da união entre um forte grupo nacional, as Empresas Brasif, e experientes executivos do mercado financeiro, a MAM desenvolve suas atividades dentro dos mais elevados padrões de conduta ética, focando

sua atuação exclusivamente na gestão de fundos de investimentos e mantendo uma política de segregação de funções e responsabilidades em relação às atividades de custódia, cálculo de quotas e precificação de ativos. A responsabilidade dessas atividades é transferida a instituições financeiras de renome e com vasta experiência global em administração de recursos. Por ser uma empresa de gestão de recursos totalmente independente, a MAM não desenvolve nenhuma atividade que possa representar qualquer conflito de interesse com seus clientes.

a) Registro CVM: Ato Declaratório nº 7694 de 24 de março de 2004;

b) Departamentos técnicos e demais recursos e serviços utilizados para gerir o FUNDO:

A META possui departamento técnico altamente qualificado, tanto para análises Macroeconômicas quanto para análises Microeconômicas e de Empresas.

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

R: A META foi fundada em 2004 numa associação entre a Brasif e o executivo Célio Afonso da Silva com cerca de R\$ 30 milhões sob gestão.

Em 2006 Brasif vende o Duty Free e aporta cerca de R\$ 100 milhões na META.

Em 2007 a META alcança cerca de R\$ 500 milhões sob gestão. Em 2010 a META passa por reorganização societária, tendo Célio Afonso adquirido a participação da Brasif.

b: escopo das atividades

R: A META atua exclusivamente na gestão de fundos de investimentos.

c: recursos humanos e computacionais

R: A META valoriza seu quadro profissional, mantendo sempre uma estrutura de primeiro nível. Com relação a recursos computacionais, a META se mantém atualizada com recursos tecnológicos modernos. Para suporte na área de informática, a Meta conta com a assessoria da empresa especializada Endev.

d: regras, políticas, procedimentos e controles internos

R: Nesses últimos 5 anos, a META procurou fortalecer suas regras e procedimentos de controles, implementados com base em seus manuais de Código de Conduta e Ética e Política de Segurança da Informação, atualizados frequentemente.

Recursos Humanos

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

a: número de sócios

R: Treze sócios

b: número de empregados

R: A META não tem empregados sendo gerida por seus sócios

c: número de terceirizados

R: Quatro

d: lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e atuam exclusivamente como prepostos ou empregados da empresa

R: Célio Afonso da Silva, Mauricio Chagas Bicalho Neto, Alexandre Horstmann

Auditoria

Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:

a: nome empresarial

R: KPMG

b: data de contratação dos serviços

R: Desde a constituição dos fundos.

c: descrição dos serviços contratados

R: serviços terceirizados:

- 1- BNY Mellon como administrador fiduciário,
- 2- BNY Mellon como Banco custodiante,
- 3- Serviço de auditoria realizado pelas empresas KPMG,
- 4- Contabilidade feito pela empresa Technos,
- 5- Informática e telefonia pela empresa Endev.

Resiliência financeira

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

R: Sim, nos últimos 36 meses as receitas acumuladas da META foram maiores que os custos e os investimentos realizados pelo seus administradores.

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)

R: A META ASSET em 31/12/18 tinha sob gestão R\$ 217.470.474,91 e seu Patrimônio líquido em 30/12 era de 676.202,50 mil reais. Ou seja o PL representa de 0,31% dos recursos administrados.

Escopo das atividades

Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo:

a: tipos e características dos serviços prestados (gestão discricionária, planejamento patrimonial, controladoria, tesouraria, etc.)

R: A META ASSET não trabalha com planejamento patrimonial, controladoria ou tesouraria. A empresa dedica-se exclusivamente à gestão de fundos abertos sob a forma discricionária.
Todas as outras atividades de controladoria e administração fiduciária são feitas pelo BNY Mellon.

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.)

R: Um fundo de ação IBX ativo , um fundo de ação Small Cap . E dois fundos Multimercados.

c: tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

R: Ações, derivativos, títulos públicos.

d: se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor

R: A Meta atua como distribuidor apenas dos fundos próprios.

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

R: A META ASSET atua somente como gestora e distribuidora de fundos próprios, portanto não há conflito entre as atividades. Todas as ações são voltadas para a melhor gestão dos recursos administrados pela empresa.

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.

R: A META ASSET atua somente como gestora e distribuidora, e não participa de sociedades controladoras, controladas ou coligadas.

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)

R: Atualmente a META possui 201 cotistas, divididos da seguinte forma: 14 cotistas do fundo Meta Plus, 4 cotistas do fundo Meta Small Cap, 174 cotistas do Meta Valor e 9 cotistas do Samba Toddy. Alguns cotistas aplicam em mais de um fundo.

Os fundos Meta Valor, Meta Plus e Meta Small Cap são dirigidos a investidores institucionais e público em geral. E o fundo Samba Toddy para público em geral.

b: número de investidores, dividido por:

i. pessoas naturais (físicas)

R: 150 pessoas naturais

ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)

R: 0 (zero)

iii. instituições financeiras

R: 0 (zero)

iv. entidades abertas de previdência complementar

R: 0 (zero)

v. entidades fechadas de previdência complementar

R: 2 (duas)

vi. regimes próprios de previdência social

R: 44 RPPS

vii. seguradoras

R: 0 (zero)

viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil

R: 0 (zero)

ix. clubes de investimento

R: 0 (zero)

x. fundos de investimento

R: 3 (Três)

xi. investidores não residentes

R: 0 (zero)

xii. outros (especificar)

R: 0 (zero)

c: recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)

R: Os fundos Meta Valor, Meta Small Cap e Meta Plus são para investidores institucionais e público em geral. E o fundo Samba Toddy para público em geral. PLs: Meta Plus - R\$ 7,871 MM; Meta Small Cap - R\$ 1,862 MM; Samba Toddy - R\$ 17,922 MM; Meta Valor - R\$ 189,815 MM

d: recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior

R: Zero

e: recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)

R: 19,47% do total - 8,68% - 7,82% - 6,37% - 4,79% - 4,57% - 4,11% - 3,55% - 3,36% - 3,21%

f: recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

i. pessoas naturais (físicas)

R: 29,70% dos recursos

ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)

R: 0 (zero)

iii. instituições financeiras

R: 0 (zero)

iv. entidades abertas de previdência complementar

R: 0 (zero)

v. entidades fechadas de previdência complementar

R: 67,52% dos recursos (somando com RPPS*)

vi. regimes próprios de previdência social

R: 67,52% dos recursos (somando com EFPC*)

vii. seguradoras

R: 0 (zero)

viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil

R: 0 (zero)

ix. clubes de investimento

R: 0 (zero)

x. fundos de investimento

R: 2,78% dos recursos

xi. investidores não residentes

R: 0 (zero)

xii. outros (especificar)

R: 0 (zero)

Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:

a: ações

R: 204.911.855,00

b: debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras

R: 0 (zero)

c: títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras

R: 0 (zero)

d: cotas de fundos de investimento em ações

R: 0 (zero)

e: cotas de fundos de investimento em participações

R: 0 (zero)

f: cotas de fundos de investimento imobiliário

R: 0 (zero)

g: cotas de fundos de investimento em direitos creditórios

R: 0 (zero)

h: cotas de fundos de investimento em renda fixa (fundos da Mellon cash)

R: 8.642.732,00

i: cotas de outros fundos de investimento

R: 0 (zero)

j: derivativos (valor de mercado)

R: -27.742.233,00

k: outros valores mobiliários

R: 0 (zero)

l: títulos públicos

R: 8.088.291,00

m: outros ativos

R: 0 (zero)

Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária

R: Nossos gestores exercem somente função de gestão, e não de administração fiduciária.

Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

R: xxx

Grupo econômico

Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:

a: controladores diretos e indiretos

R: Célio Afonso da Silva controla 76,00% das cotas da META ASSET

b: controladas e coligadas

R: NÃO HÁ.

c: participações da empresa em sociedades do grupo

R: NÃO HÁ.

d: participações de sociedades do grupo na empresa

R: NÃO HÁ.

e: sociedades sob controle comum

R: NÃO HÁ.

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.

Estrutura operacional e administrativa

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

R:

Comitê de riscos e compliance é responsável pela análise de risco, enquadramento e adequação de cada produto da META. O Comitê de investimentos é responsável pela estratégia de investimentos da META

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

R: O comitê de risco e compliance se reúne uma vez por semana e é composto pelos diretores Erik Szaniecki, Álvaro Barbosa e Mauricio Bicalho. O comitê de investimentos também se reúne uma vez por semana e é composto pelos diretores Célio Afonso, Alexandre Horstmann, Dario Tanure, e pelo sócio Luiz Broad.

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

R:

São membros da diretoria Célio Afonso da Silva (diretor geral), Alexandre Horstmann (Gestão), Erik Szaniecki (Risco e Compliance), Alvaro Barbosa (Distribuição e Suitability), Dario Tanure (Diretor Executivo) e Mauricio Bicalho (Diretor Executivo). As decisões estratégicas da META são tomadas nas reuniões de seus Comitês.

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

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:

a: nome

R: Célio Afonso da Silva

b: idade

R: 71 anos

c: profissão

R: Administrador de empresa

d: CPF ou número do passaporte

R: 132.827.516-72

e: cargo ocupado

R: Diretor geral

f: data da posse

R: desde outubro/2014

g: prazo do mandato

R: 2 anos

h: outros cargos ou funções exercidos na empresa

R: diretor executivo

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

a: nome

R: Alexandre Horstmann

b: idade

R: 45 anos

c: profissão

R: Economista

d: CPF ou número do passaporte

R: 028.450.637-09

e: cargo ocupado

R: Diretor de gestão

f: data da posse

R: desde abril/2018

g: prazo do mandato

R: 2 anos

Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e desta Instrução, fornecer:

a: currículo, contendo as seguintes informações:

R: Erik Peccei Szaniecki

i: cursos concluídos;

R: Medicina UFRJ, MBA Finanças IBMEC, Direito UNESA

ii: aprovação em exame de certificação profissional

R: foi certificado como administrador de carteiras CVM

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

R:

Atuou como diretor de Risco e Compliance na Rapier Investimentos e COO na Bozano Asset Management

iv: atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram

R: gestão de recursos

datas de entrada e saída do cargo

R: Junho 2013 a abril 2018

Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:

R: xxx

i: cursos concluídos;

R: xxx

ii: aprovação em exame de certificação profissional

R: xxx

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

R: xxx

nome da empresa

R: xxx

cargo e funções inerentes ao cargo

R: xxx

atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram

R: xxx

datas de entrada e saída do cargo

R: xxx

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: nome

R: Álvaro Guilherme Monteiro Barbosa

b: idade

R: 62 anos

c: profissão

R: Economista

d: CPF ou número do passaporte

R: 470.580.807-04

e: cargo ocupado

R: Diretor de distribuição

f: data da posse

R: desde novembro/2016

g: prazo do mandato

R: 2 anos

Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:

a: quantidade de profissionais

R: 2 profissionais (Célio e Alexandre)

b: natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

R: Análises macro e microeconômicas, análise conjuntural, fundamentalista, estudo das empresas e gestão de ativos.

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

R: Usamos terminais do sistema Broadcast, Valor, e o portal do administrador BNY Mellon; site da BOVESPA, ANBIMA, CVM, BACEN e o Manual de Risco e Compliance da META ASSET

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

R: A gestão atua independente das outras diretorias, tendo autonomia total, desde que respeitadas todas as regras internas e legislação prertinente.

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

R: 2 profissionais (Erik e Alvaro)

b: natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

R: Reunião semanal do comitê de compliance e risco. Análise diária das operações programadas, aprovando ou não dentro da estrutura estabelecida e do enquadramento legal e regulamentar de cada fundo. Acompanhamento permanente da legislação pertinente a fundos de investimentos.

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

R: Usamos o portal do administrador BNY Mellon; site da BOVESPA, ANBIMA, CVM, BACEN, o Manual de Risco e Compliance da META ASSET e o regulamento dos fundos

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

R: A diretoria de risco e compliance atua independente da diretoria de gestão, tendo no organograma da empresa autonomia na aprovação ou não das operações. Seguimos rigorosamente as determinações dos Manuais de Compliance e Risco da META ASSET

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

a: quantidade de profissionais

R: igual item anterior

b: natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

R: igual item anterior

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

R: igual item anterior

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

R: igual item anterior

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

R: Nossa administração fiduciária é feita pela BNY Mellon.

b: os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

R: Nossa administração fiduciária é feita pela BNY Mellon.

c: a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade

R: Nossa administração fiduciária é feita pela BNY Mellon.

Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo

a: quantidade de profissionais

R: 1 profissional

b: natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

R: Relacionamos abaixo algumas atividades desenvolvidas pela equipe de distribuição:

Cadastro, Compliance e Operações:

- Aplicação do Suitability; (terceirizado com o BNY Mellon)
- Procedimentos de AML, incluindo KYC, monitoramento de transações de cotistas (terceirizado com a Mellon)
- Verificação e manutenção de cadastro;
- Atendimento a cotistas, incluindo o envio de materiais de distribuição;
- Boletagem de movimentações de passivo nos fundos e acompanhamento de ordens.

c: programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas

R: O diretor responsável pela área de distribuição possui CPA-20 e 38 anos de experiência no mercado financeiro

d: infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição

R: Usamos o sistema SMA interface da Mellon para cadastramento e envio de documentos dos cotistas. Seguimos o Manual de Cadastramento da Meta para procedimentos de cadastro e arquivamento das análises

e: os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

R: Usamos o sistema SMA interface da Mellon para cadastramento e envio de documentos dos cotistas. Seguimos o Manual de Cadastramento da Meta para procedimentos de cadastro e arquivamento das análises

Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

R: xxx

Remuneração da empresa

Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 6.1, indicar as principais formas de remuneração que pratica

R: A META ASSET tem como receita taxa de administração e taxa de performance.

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

R: 2,32% a.a. na média de 36 meses.

b: taxas de performance

R: *A taxa de performance ao longo dos últimos 3 anos foi de R\$ 1.698.347,06.*

c: taxas de ingresso

R: Não há

d: taxas de saída

R: Não há

e: outras taxas

R: Não há

Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados

R: Em nossa política de Segurança da Informação constam as práticas e cuidados mínimos necessários aplicáveis a todos os colaboradores da Meta Investimentos. Diariamente realizamos backup da nossa rede de dados com disco externo no sentido de mitigar possíveis problemas. Além disso, toda a infraestrutura de tecnologia está sendo migrada para a nuvem. Temos dupla verificação e controle de informações dos nossos fundos, pois eles são administrados pela Mellon que mantém arquivos de dados com todas as informações dos fundos

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

R: A gestão de riscos é de responsabilidade do Comitê de Riscos.

Os profissionais do comitê possuem formação e experiência na área.

O comitê tem poder de veto sobre qualquer operação dos fundos. Uma das suas principais

preocupações é o monitoramento da exposição ao risco de mercado e da aderência dos fundos aos seus respectivos mandatos e às expectativas de rentabilidade. Além do risco de mercado, cabe a ele gerenciar os riscos de liquidez, operacional e legal.

Os fundos geridos pela META estão sujeitos a dois controles de riscos paralelos e independentes: o interno à própria empresa, gerido pelo Comitê de Riscos, e o do administrador, a BNY Mellon Serviços Financeiros.

O Comitê de Riscos da META tem também como objetivo a verificação do cumprimento dos mandatos e a avaliação de potenciais riscos em cenários com perdas potencialmente elevadas.

Diariamente a área de riscos avalia a alavancagem e o capital em risco envolvido nos fundos

e realiza simulações de impacto de novas adições ao estoque de posições dos fundos. Os fundos têm seu VaR (valor a risco) diário calculado com um nível de confiança de 95%. Os limites estabelecidos, caso atingidos, implicam redução progressiva das posições.

A META tem ciência das limitações de qualquer modelo matemático e, por isso, avalia a variação da carteira em cenários de mudanças bruscas. Essa análise de estresse contempla situações extremas observadas ou não anteriormente no mercado. A META atua com extrema cautela na validade de correlações históricas em momentos de estresse.

Para o risco de mercado, a META conta com ferramentas para duas abordagens distintas: o controle de risco a posteriori – que consiste na geração de relatórios de exposição e testes de estresse sobre a carteira de fechamento diária – e o controle de risco pró-ativo – que consiste nas simulações de exposição e de estresse antes da efetiva realização de novas operações.

Os cálculos de perda sob cenários de estresse são realizados à parte pela área de Risco da META, sendo cada cenário definido pelo Comitê de Riscos.

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

R:

Em relação à troca de informações entre distribuidor e administrador de fundos de investimento, a Meta utiliza-se do sistema eletrônico SMA (Sistema Mellon de Atendimento) que é um canal de comunicação com os distribuidores que prevê a troca de informações relacionadas a movimentações dos cotistas. Existe também uma Política de Suitability, contendo as regras e definições acerca da adequação dos produtos, serviços e operações ao perfil do cliente.

A Meta também possui documento específico estabelecendo regras e processos internos aplicáveis ao cadastro de clientes (Manual de Cadastramento)

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

R: www.metaasset.com.br

Contingências

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

R: A META não está envolvida em nenhum processo judicial.

b: valores, bens ou direitos envolvidos

R: A META não está envolvida em nenhum processo judicial.

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

R: Nenhum diretor da META está envolvido em processos judiciais.

b: valores, bens ou direitos envolvidos

R: Nenhum diretor da META está envolvido em processos judiciais.

Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores

R: A META não tem outras contingências relevantes

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

R: A META não está envolvida em nenhum processo judicial.

b: valores, bens ou direitos envolvidos

R: A META não está envolvida em nenhum processo judicial.

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

R: Nenhum diretor da META está envolvido em processos judiciais.

b: valores, bens ou direitos envolvidos

R: Nenhum diretor da META está envolvido em processos judiciais.

Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, atestando:

a:

que 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

R: O diretor responsável pela administração 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

b: que não foi 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

R: O diretor responsável pela administração não foi 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: que não está impedido de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa

R: O diretor responsável pela administração não está impedido de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa

d: que não está incluído no cadastro de serviços de proteção ao crédito

R: O diretor responsável pela administração não está incluído no cadastro de serviços de proteção ao crédito.

e: que não está incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado

R: O diretor responsável pela administração não está incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado

f: que não tem contra si títulos levados a protesto

R: O diretor responsável pela administração não tem contra si títulos levados a protesto

g: que, nos últimos 5 (cinco) anos, não sofreu punição em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, do Banco Central do Brasil, da Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC

R: O diretor responsável pela administração atesta que, nos últimos 5 (cinco) anos, não sofreu punição em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, do Banco Central do Brasil, da Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC

h: que, nos últimos 5 (cinco) anos, não foi acusado em processos administrativos pela CVM, pelo Banco Central do Brasil, pela Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou pela Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC

R: O diretor responsável pela administração atesta que, nos últimos 5 (cinco) anos, não sofreu punição em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, do Banco Central do Brasil, da Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC

