

FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA – CVM

Prezados,

A consulta do formulário de referência pode ser efetuada diretamente no site da CVM, utilizando o link abaixo, conforme instruções a seguir:

<https://cvmweb.cvm.gov.br/SWB/Sistemas/SCW/CPublica/FormBuscaPartic.aspx?TpConsulta=16>

A consulta pode ser efetuada tanto pelo nome da gestora, bem como pelo CNPJ.

Chromo Investimentos Ltda

19361845000130

Consulta Pública de de Formulário de Referência de Administradores de Carteira

Preencha com parte do nome do administrador de carteira ou com o número do CPF/CNPJ:

Competência: Mais Recente ▾

[Fale com a CVM](#)

A consulta possibilita consultar diversos anos de competência, conforme imagem abaixo:

Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 19.361.845/0001-30
Nome do Administrador de Carteira: CHROMO INVESTIMENTOS LTDA.
Ano de competência: 2020 ▾ Consultar

| | | | | | | | | | |
|--------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|--------------------------|--------------------|---|---------------------------|---|-------------------|-----------------|
| 2. Histórico da Empresa | 3. Recursos Humanos 4. Auditores | 5. Resiliência Financeira | 6. Escopo das Atividades | 7. Grupo Econômico | 8. Estrutura Operacional e Administrativa | 9. Remuneração da Empresa | 10. Regras Procedimentos e Controles Internos | 11. Contingências | 12. Declarações |
|--------------------------------|-------------------------------------|---------------------------|--------------------------|--------------------|---|---------------------------|---|-------------------|-----------------|

2. Histórico da empresa *campos de preenchimento obrigatório

Cordialmente,

Chromo Investimentos Ltda



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 - www.cvm.gov.br

Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 19.361.845/0001-30

Nome do Administrador de Carteira: CHROMO INVESTIMENTOS LTDA.

Ano de competência: 2021

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A CHROMO INVESTIMENTOS LTDA. foi devidamente autorizada, por meio do Ato Declaratório nº 14.271, de 19/06/2015, a prestar os serviços de administração de carteira de valores mobiliários, possuindo atualmente 7 (sete) fundos de investimentos sob a sua gestão, sem dupla contagem de master feeder.

2.2. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo

a. Principais eventos societários tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário

Abertura de filial no exterior;
Ascendência do colaborador para o quadro societário;
Sócio majoritário cede suas cotas para entidade pessoa jurídica baseada nos EUA 100% detida pelo próprio;
Alteração do quadro societário com o ingresso de um novo sócio, substituindo sócio que veio a falecer em 2020.

b. Escopo das atividades

Exercício da atividade de gestão de recursos de terceiros.

c. Recursos humanos e computacionais

Recursos humanos: 6 sócios, sendo 4 pessoas físicas e 2 pessoas jurídicas.
Recursos Computacionais: 4 CPUs e 2 Notebooks

d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos

Contidas no Manual de Compliance da CHROMO.

3. Recursos Humanos

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

a. Número de sócios:

6

b. Número de empregados:

1

c. Número de terceirizados:

0

| CPF | Nome |
|----------------|------------------------|
| 957.466.920-34 | TIAGO WALLAU KRETZMANN |



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 - www.cvm.gov.br

4. Auditores

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

4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:

| Nome empresarial | Data da contratação | Descrição |
|------------------|---------------------|-----------|
|------------------|---------------------|-----------|

5. Resiliência Financeira

5.1. Com base nas demonstrações financeiras, ateste:

a. Se a receita em decorrência de taxas com bases fixas a que se refere o item 9.2.a é suficiente para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários

Sim

b. Se o patrimônio líquido da empresa representa mais do que 0,02% dos recursos financeiros sob administração de que trata o item 6.3.c e mais do que R\$300.000,00 (trezentos mil reais)

Sim

5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução (A apresentação destas demonstrações financeiras e deste relatório é obrigatória apenas para o administrador registrado na categoria Administrador Fiduciário, subcategoria Capital Mínimo, de acordo com o inciso II do § 2º do art. 1º.):)

Demonstração Financeira: Não se aplica

Relatório: Não se aplica

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 Chromo atua na gestão discricionária de ativos financeiros através de uma equipe com alta expertise em mercado global e com foco em um portfólio diversificado.

b. Tipos e características dos produtos administrados ou geridos (fundos de investimento, fundos de investimento em participação, fundos de investimento imobiliário, fundos de investimento em direitos creditórios, fundos de índice, clubes de investimento, carteiras administradas, etc.)

A Chromo faz a gestão de carteiras administradas e dentre os principais ativos estão fundos de investimentos multimercados (FIM), FIDC, fundos de investimentos em ações (FIA) e fundo de investimento em participações (FIP).



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 - www.cvm.gov.br

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Cotas de fundos de investimentos (FIM, FIA, FIP), debêntures, ativos de renda fixa e variável.

d. Se atua na distribuição de cotas de fundos de investimentos de que seja administrador ou gestor

Não

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

N/A

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

N/A

6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundo e carteiras administradas geridas pela empresa, fornecendo as seguintes informações

| | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|---------------------------|---|---|-------|
| a. Número de investidores | 8 | 0 | 8 |

| b. Número de investidores, dividido por: | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|---|---|---|-------|
| i. Pessoas Naturais | 6 | 0 | 6 |
| ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais) | 2 | 0 | 2 |
| iii. Instituições Financeiras | 0 | | 0 |
| iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar | 0 | | 0 |
| v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar | 0 | | 0 |
| vi. Regimes Próprios de Previdência Social | 0 | 0 | 0 |
| vii. Seguradoras | 0 | | 0 |
| viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil | 0 | | 0 |
| ix. Clubes de Investimento | 0 | 0 | 0 |
| x. Fundos de Investimento | 0 | | 0 |
| xi. Investidores não Residentes | 0 | | 0 |

| xii. Outros | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|-------------|---|---|-------|
| | 0 | 0 | 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 - www.cvm.gov.br

| | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|-------|---|---|-------|
| Total | 8 | 0 | 8 |

| | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|---|---|---|--------------------|
| c. Recursos financeiros sob administração | R\$ 461.988.814,21 | R\$ 0,00 | R\$ 461.988.814,21 |

d. Recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior

R\$ 1.569.649.605,02

e. Recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes) Caso deseje identificar o cliente, informe o nome após o valor dos recursos, utilizando o caracter ";" como separador

| Valor | Nome |
|--------------------|------|
| R\$ 151.016.629,48 | |
| R\$ 80.501.623,92 | |
| R\$ 77.242.625,81 | |
| R\$ 70.244.009,78 | |
| R\$ 51.570.575,58 | |
| R\$ 23.863.589,13 | |
| R\$ 7.462.754,96 | |
| R\$ 87.005,55 | |

f. Recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

| | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|---|---|---|--------------------|
| i. Pessoas Naturais | R\$ 430.662.470,13 | R\$ 0,00 | R\$ 430.662.470,13 |
| ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais) | R\$ 31.326.344,08 | R\$ 0,00 | R\$ 31.326.344,08 |
| iii. Instituições Financeiras | R\$ 0,00 | | R\$ 0,00 |
| iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar | R\$ 0,00 | | R\$ 0,00 |
| v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar | R\$ 0,00 | | R\$ 0,00 |
| vi. Regimes Próprios de Previdência Social | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 |
| vii. Seguradoras | R\$ 0,00 | | R\$ 0,00 |
| viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil | R\$ 0,00 | | R\$ 0,00 |
| ix. Clubes de Investimento | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 |
| x. Fundos de Investimento | R\$ 0,00 | | R\$ 0,00 |
| xi. Investidores não Residentes | R\$ 0,00 | | R\$ 0,00 |



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 - www.cvm.gov.br

| xii. Outros | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|-------------|---|---|--------------------|
| | | | |
| Total | R\$ 461.988.814,21 | R\$ 0,00 | R\$ 461.988.814,21 |

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

| | |
|--|--------------------|
| a. Ações | R\$ 10.333.512,00 |
| b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira | R\$ 0,00 |
| c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras | R\$ 0,00 |
| d. Cotas de fundos de investimento em ações | R\$ 101.410.628,33 |
| e. Cotas de fundos de investimento em participações | R\$ 1.472.977,78 |
| f. Cotas de fundos de investimento imobiliário | R\$ 0,00 |
| g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios | R\$ 3.051.079,69 |
| h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa | R\$ 61.309.223,85 |
| i. Cotas de outros fundos de investimento | R\$ 283.412.155,05 |
| j. Derivativos (valor de mercado) | R\$ 0,00 |
| k. Outros valores mobiliários | R\$ 0,00 |
| l. Títulos públicos | R\$ 999.237,51 |
| m. Outros ativos | R\$ 0,00 |
| Total | R\$ 461.988.814,21 |

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

N/A

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Os valores apresentados no item 6.4 são sem dupla contagem. Ou seja, existe alocação em algumas classes de ativo através de fundo Master que acabam agrupando no item i. cotas de outros fundos de investimento.

7. Grupo Econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

| CPF/CNPJ | Nome |
|--------------------|--|
| 485.017.940-15 | Marcelo Flores da Cunha Damasceno Ferreira |
| 957.466.920-34 | Tiago Wallau Kretzmann |
| 00.001.819/8220-01 | Evandro de Oliveira Lopes |



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 - www.cvm.gov.br

b. Controladas e coligadas

| CNPJ | Nome |
|------|---------------|
| - | Não Informado |

c. Participações da empresa em sociedade do grupo

| CNPJ | Nome |
|------|---------------|
| - | Não Informado |

d. Participações de sociedades do grupo na empresa

| CNPJ | Nome |
|------|---------------|
| - | Não Informado |

e. Sociedades sob controle comum

| CNPJ | Nome |
|------|---------------|
| - | Não Informado |

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 7.1.

202203281833083b43dcf4da5049e4a42f95106739e691.pdf

8. Estrutura Operacional e Administrativa

8.1. Descrever a estrutura administrativa da empresa, conforme estabelecido no seu contrato ou estatuto social e regimento interno, identificando:

a. Atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico

Comitê Executivo

O Comitê Executivo é o responsável por discutir e acompanhar o bom funcionamento da empresa. Além disso, é responsabilidade desse comitê a avaliação de assuntos pertinentes aos temas relacionados à Recursos Humanos (RH); Tecnologia (TI) e societário.

Comitê de Compliance

O Comitê Compliance é o responsável por assegurar, em conjunto com as outras disposições contidas no presente Manual de Controles Internos, a adequação, fortalecimento e o funcionamento do sistema de controles internos da Gestora, procurando mitigar eventuais riscos decorrentes da complexidade dos negócios da Gestora, bem como disseminar a cultura de controles para assegurar o cumprimento às leis e regulamentação aplicáveis à Gestora, relacionadas ao exercício de administração de carteira de valores mobiliários.

Comitê de Investimentos

O Comitê de Investimento é o responsável por definir e verificar cumprimento das políticas de gestão dos fundos e serve como instrumento para assessorar os gestores nas decisões sobre os investimentos. O Comitê é o responsável por apresentar, analisar e desenhar os cenários macroeconômicos que a empresa irá desenvolver seus investimentos e execução.

Comitê de Risco Financeiro e Crédito

O Comitê de Risco Financeiro e de Crédito é o responsável por definir, analisar e controlar os limites de exposição a risco associados aos portfólios de acordo com os mandatos dos fundos, bem como avaliar os ratings dos produtos, os limites de crédito estabelecidos e suas respectivas contrapartes.

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



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 - www.cvm.gov.br

Comitê Executivo

Participantes: Todos os diretores e representantes de sócios

Presidente do Comitê: Tiago Wallau Kretzmann e Marcelo Flores da Cunha Damasceno Ferreira

Periodicidade: Semestral (junho e dezembro)

Comitê de Compliance

Participantes: Todos os diretores e funcionários da gestora.

Presidente do Comitê: Evandro de Oliveira Lopes

Periodicidade: Semestral (abril e outubro)

Comitê de Investimentos

Participantes: Todos os diretores e o sócio majoritário Marcelo Flores da Cunha Damasceno Ferreira

Presidente do Comitê: Tiago Wallau Kretzmann

Periodicidade: Mensal, salvo quando houver pauta extraordinária.

Comitê de Risco Financeiro e Crédito

Participantes: Todos os diretores.

Presidente do Comitê: Evandro de Oliveira Lopes (Marcelo Adams Sanvitto substituirá em Março 2022) - Suportado pelo Diretor de Investimentos.

Periodicidade: Mensal.

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

A CHROMO tem 4 (quatro) Diretorias. Estas Diretorias, bem como as suas respectivas atribuições, são:

(i) Diretoria de Investimentos, responsável pela tomada discricionária das decisões de investimentos e desinvestimentos pertinentes à carteira de fundos de investimentos e administradas;

(ii) Diretoria de Compliance, responsável pelo cumprimento, por parte da asset, dos manuais, normas, regras de conduta, controles internos e regulamentação e legislação aplicáveis;

(iii) Diretoria de Risco, responsável pelo monitoramento, mensuração e ajuste permanentes dos riscos inerentes a cada uma das carteiras de valores mobiliários que administre; e (iv) Diretoria de Prevenção da Lavagem de Dinheiro, responsável pela aplicação das regras que dispõem sobre a identificação, o cadastro, o registro, as operações, a comunicação, os limites e a responsabilidade administrativa referentes aos crimes de "lavagem" ou ocultação de bens, direitos e valores.

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

Nenhum arquivo selecionado

8.3. Em relação a cada um dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar:

| CPF | Nome | Idade | Profissão | Cargo | Data da posse | Prazo do mandato | Outros cargos |
|----------------|------------------------|-------|---------------|--------------------------|---------------|------------------|---------------|
| 957.466.920-34 | TIAGO WALLAU KRETZMANN | 40 | Administrador | Diretor de Investimentos | 22/03/2019 | Indeterminado | |

8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, indicar:



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 - www.cvm.gov.br

| Qualificação | CPF | Nome | Idade | Profissão | Cargo | Data da posse | Prazo do mandato | Outros cargos | Cursos concluídos | Certificação profissional |
|-----------------------------|--------------------|---------------------------|-------|---------------|-----------------------------|---------------|------------------|---------------|---|---------------------------|
| 8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA) | 957.466.920-34 | TIAGO WALLAUKRETZMANN | 40 | Administrador | Diretor de Investimentos | 22/03/2019 | Indeterminado | | (i) Graduação em Administração, pela Universidade Federal do Rio Grande do Sul - UFRGS, em 2002; (ii) MBA em Finanças Corporativas pela Fundação Getúlio Vargas - FGV. (parcial); e (iii) University of Pennsylvania, The Wharton School of Business, Executive Education, Investment Strategies and Portfolio Management Program, em 2014; | CFP e CGA |
| 8.5 (COMPLIANCE) | 00.001.819/8220-01 | Evandro de Oliveira Lopes | 31 | Administrador | Diretor de Compliance e AML | 01/04/2021 | Indeterminado | | Bacharel em Administração pela FAPA. Mestrado em Finanças pela Florida Atlantic University (FAU) | N/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 - www.cvm.gov.br

8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, fornecer principais experiências profissionais durante os últimos cinco anos, indicando:

| CPF do Diretor | Nome do Diretor | Nome da Empresa | Cargo | Atividade principal | Data de Entrada | Data de Saída |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|--|--------------------------------|-----------------|---------------|
| 957.466.920-34 | TIAGO WALLAU KRETZMANN | CHROMO INVESTIMENTOS LTDA | Sócio responsável pela gestão do portfólio desde 2013, sendo, desde 22 de Março de 2019, Diretor de Investimentos. | Gestão de Portfólio | 01/01/2013 | |
| 00.001.819/8220-01 | Evandro de Oliveira Lopes | Chromo Investimentos Ltda | Sócio responsável pelo backoffice da gestora desde 2016. | Backoffice e apoio operacional | 01/03/2016 | |

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

a. Quantidade de profissionais

2

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Atividades de administração de carteiras de valores mobiliários.

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

A Chromo utiliza o sistema Bloomberg para análise de mercado, dados comerciais, indicadores financeiros e de ativos em tempo real;

Além disso, a gestora utiliza sistema de terceiros para gerenciamento dos ativos, bem como output de reports.

8.9. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentadores aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:

a. Quantidade de profissionais

2

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Revisão periódica do enquadramento nos termos do Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento, do Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para o Programa de Certificação Continuada e do Código de Processos da Regulação e Melhores Práticas, bem como a revisão periódica do enquadramento nas políticas internas da gestora.

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

Reuniões periódicas para acompanhamento e cumprimento de atualizações como este formulário de referência; A Chromo utiliza seu código de conduta, política e controles internos para tal;

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



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 - www.cvm.gov.br

O diretor de Compliance e risco atua na revisão dos códigos e regulamentos de forma independente, sem interação com as áreas de gestão operacional e recursos.

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

a. Quantidade de profissionais *

1

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Monitoramento, mensuração e ajuste permanentes dos riscos inerentes a cada uma das carteiras de valores mobiliários que porventura administre

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

A área de Risco é formada pelo Diretor de Compliance e Risco, a quem cabe desempenhar todas as funções relativas ao controle de risco dos fundos sob gestão da Chromo.

O Diretor de Compliance e Risco realiza um monitoramento diário, após o fechamento dos mercados de cada dia, em relação aos riscos de mercado, concentração, crédito, contraparte e liquidez. Com o auxílio de sistemas operacionais com output em planilhas proprietárias (em Excel), são gerados relatórios mensais de exposição a riscos para cada carteira de ativos financeiros sob gestão ou conforme solicitação das áreas envolvidas. Caso algum limite objetivo seja extrapolado, o Diretor de Compliance e Risco notificará imediatamente o Diretor de Investimentos para que este realize o devido reenquadramento.

O processo de avaliação e gerenciamento de riscos permeia todo o processo de decisão de investimento. Tal processo deve seguir determinados parâmetros em razão de se estar trabalhando com ativos que apresentem baixa liquidez (mercado de private equity) ou média e alta liquidez (mercado dos fundos multimercado regulados pela Instrução CVM 555/2014).

Os controles de risco de modo geral são desenvolvidos internamente, baseados no MtM da carteira e análise individual de cada ativo. São utilizadas planilhas em Excel para o controle e acompanhamento dos riscos das carteiras, havendo ainda o auxílio do sistema Bloomberg como ferramenta para o gerenciamento de risco, principalmente para fins de precificação interna dos ativos investidos.

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

Independência, prevista nos termos dos Manuais de Compliance e de Gestão de Riscos da CHROMO.

8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, de controle e de processamento de ativos e da escrituração da emissão e resgate de cotas, incluindo:

a. Quantidade de profissionais

0

b. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

N/A

c. A indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividades

N/A

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

a. Quantidade de profissionais

0

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes



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 - www.cvm.gov.br

N/A

c. Programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas

N/A

d. Infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos, programas e serviços utilizados na distribuição

N/A

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

N/A

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 2.1. do anexo 15-I, indicar as principais formas de remuneração que pratica:

A Chromo é remunerada pela taxa de administração e performance de cada fundo sob gestão.

9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total aferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente dos clientes, durante o mesmo período, em decorrência de:

a. Taxa com bases fixas (%):

20,00

b. Taxa de performance (%):

80,00

c. Taxa de ingresso (%):

0,00

d. Taxa de saída (%):

0,00

e. Outras taxas (%):

0,00

Total (%):

100,00

9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:

N/A

10. Regras Procedimentos e Controles Internos



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 - www.cvm.gov.br

10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços

Nos termos do Manual de Ética e Compliance da CHROMO, (i) o agente prestador dos serviços de administração, escrituração e custódia dos fundos e dos investimentos deve ser selecionado utilizando-se, no mínimo, os seguintes critérios: expertise comprovada em carteira de clientes no Brasil; posição no ranking ANBIMA; avaliação de reais ou potenciais conflitos de interesses entre os serviços de administração e de custódia dos ativos da CHROMO; clareza nas informações prestadas em relatórios gerenciais de risco e enquadramento; cumprimento de prazos; e custo dos serviços; (ii) como pré-qualificação para administrar as carteiras dos fundos, o candidato deve possuir um patrimônio compatível com sua atividade bem como estar devidamente autorizado pela CVM e, especificamente, quanto a fundos de ações e multimercado, o candidato deverá administrar outros fundos similares no mercado brasileiro com histórico de cotas mínimo de 36 (trinta e seis) meses; e (iii) ao se avaliar a melhor execução, o Diretor de Investimentos deve considerar toda a oferta de serviços da corretora avaliada, incluindo, entre outras condições, a capacidade de execução da ordem, a qualidade dos departamentos de análises, a corretagem cobrada e a solidez financeira da instituição, sendo, ainda, características necessárias, para efeito de aprovação das corretoras, a expertise operacional, a infra estrutura operacional, e os relatórios de research.

10.2. Descrever como os custos de transação de valores mobiliários são monitorados e minimizados

Os custos são analisados levando em consideração a qualidade do serviço prestado pelas corretoras/administradores de carteira;

É através de reuniões periódicas, baseadas em nossa política interna, que é definido a manutenção dos prestadores de serviço de valores mobiliários e corretagem.

10.3. Descrever as regras para o tratamento de soft dollar, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens, etc

Nos termos do Manual de Compliance da CHROMO, os Colaboradores obrigam-se a reportar aos Diretores da Gestora caso recebam qualquer presente ou brinde em razão da posição ocupada por este na mesma, inclusive de clientes, fornecedores ou prestadores de serviços. Caso referidos brindes ou presentes tenham valor superior a R\$100,00 (cem reais), os Diretores da Gestora decidirão acerca da destinação do brinde ou presente, podendo a Diretoria, a seu exclusivo critério, dar a destinação que julgar adequada a referido brinde ou presente, inclusive a sua devolução ou distribuição ou sorteio entre todos os Colaboradores.

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

A CHROMO, caso passe a efetivamente gerir carteira administradas e de fundos de investimentos, (i) contará com sistema de back-up, dotado de periodicidade diária, semanal e mensal, por meio do qual será realizado o processamento de cópias de seus respectivos sistema de dados e das ligações telefônicas efetuadas no desempenho da atividade de administração de recursos de terceiros; (ii) possuirá ainda um HD removível, que será diariamente armazenado em um local seguro e externo ao escritório; (iii) desenvolveu planos de contingência para efeito de gerenciamento de situações de crise, de forma a garantir a continuidade de seus negócios, até a sua completa superação; (iv) caso ocorra algum evento extraordinário que impossibilite a utilização de suas instalações e estrutura físicas, continuará as suas atividades em um escritório remoto, situado próximo a sua sede e que poderá ser utilizado em caso de contingências; (v) manterá telefones, computadores e impressoras adicionais para fins de substituição; (vi) trabalhará com dois servidores de banda-larga, um com tecnologia via cabo (cable modem) e outro via telefone (DSL); e (vii) contratará uma empresa prestadora de serviços especializados quanto à realização de suporte técnico nas áreas de telefonia e informática, a qual será acionada sempre que necessário.

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



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 - www.cvm.gov.br

Referida política tem por objetivo a formalização dos critérios e o acompanhamento do risco associado a perdas potenciais decorrentes da necessidade de geração de caixa para honrar compromissos do fundo, tais como: chamada de margens, liquidação de posições vendidas, despesas do fundo, resgates, entre outros.

Para esta finalidade e simplificação do processo de acompanhamento são considerados ilíquidos: todos os títulos de crédito privado; derivativos; ativos utilizados como margem, ajustes e outras garantias; e cotas de fundo de investimento com prazo de resgate superior a 3 dias.

Para efeito desta política, serão considerados todos os fundos fechados, não havendo a necessidade de tratamento de condições de resgate, concentração de cotistas e histórico de resgates. Dada a característica destes fundos, o valor de liquidez mínima será analisado caso a caso, sendo possível alterar os valores mínimos de liquidez exigidos.

Será considerado como parâmetro de liquidez mínimo exigido a despesa corrente dos próximos 3 meses e os valores requeridos por parte de posicionamento do fundo.

Será considerada liquidez livre para novos investimentos os valores líquidos dentro do fundo / carteira excluídos os valores apurados no item acima.

Antes da aquisição de qualquer posição que requeira margem futura, a mesma deve ser submetida ao cenário de stress e a resultante de liquidez exigida deve ser contemplada aos critérios acima.

Essa verificação deverá ser feita diariamente pela Diretoria de Risco Financeiro e Crédito.

10.6. Descrever as políticas, as práticas e 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

N/A

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

www.chromoinvest.com.br

11. Contingências

Importante: Não é necessário avaliação do administrador a respeito da chance de perda ou do valor que acredita ser efetivamente devedor em caso de eventual condenação.

11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, e sejam relevantes para seu patrimônio pessoal, incluindo:

a. Principais fatos *

N/A

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

N/A

11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteira de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem o seus negócios ou sua reputação profissional, incluindo:

a. Principais fatos

N/A

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

N/A

11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores:

N/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 - www.cvm.gov.br

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 tenha figurado no polo passivo, indicando:

a. Principais fatos

N/A

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

N/A

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

N/A

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

N/A

12. Declarações

Declaração do administrador, atestando:

Que reviu o formulário de referência

Marcado

Que o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo de seus negócios (PF) ou da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa (PJ)

Marcado

Declarações adicionais do administrador, informando sobre

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

Nada a declarar

Marcado



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 - www.cvm.gov.br

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

Nada a declarar

Mercado

Impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa

Nada a declarar

Mercado

Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

Nada a declarar

Mercado

Inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado

Nada a declarar

Mercado

Títulos contra si levados a protesto

Nada a declarar

Mercado

Data de envio: 28/03/2022 - 18:53:00

Data de impressão: 28/03/2022

Hora de impressão: 18:53:43