

POLÍTICA DE GERENCIAMENTO DE RISCOS – CAIXA ASSET

Versão FEV 25

Vigência 28/01/2025

SUMÁRIO

OBJETIVO	3
DEFINIÇÕES	3
MOTIVAÇÃO.....	6
VIGÊNCIA.....	6
DIRETRIZES GERAIS	6
RISCO DE CRÉDITO, CONCENTRAÇÃO E CONTRAPARTE	8
RISCO DE MERCADO.....	8
RISCO DE LIQUIDEZ	8
RISCO OPERACIONAL	9
RISCO SOCIAL, AMBIENTAL E CLIMÁTICO.....	9
RISCO DE IMAGEM E REPUTAÇÃO	9
RISCO DE <i>COMPLIANCE</i>	9
RISCO DE ESTRATÉGIA.....	10
OUTROS RISCOS	10
GERENCIAMENTO DE RISCOS	10
INDICADORES DE EFETIVIDADE	12
RESPONSABILIDADES.....	15

OBJETIVO

Estabelecer princípios e diretrizes para o gerenciamento dos riscos aos quais os produtos, os processos e os serviços de gestão de Ativos de Terceiros podem estar expostos, considerando suas características e priorizando a proteção de valor, em consonância com as regulamentações internas e externas, diretrizes do Conglomerado CAIXA e às melhores práticas de mercado.

DEFINIÇÕES

- Ativo financeiro – bens ou direitos que uma empresa ou pessoa possui e que podem gerar rendimentos;
- ASG – sigla utilizada para medir e informar as práticas e dados referente aos aspectos ambientais, sociais e de governança corporativa;
- Apetite a risco – trata-se do nível de risco que a organização está disposta a aceitar;
- CAIXA ASSET – Caixa Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.;
- Contraparte – parte participante de um negócio ou de um contrato. Caracterizado para fins do gerenciamento do risco de crédito como o tomador de recursos, o garantidor, o emissor de título ou valor mobiliário, o usuário final perante o emissor de instrumento de pagamento pós-pago, o emissor perante o credenciador de instrumento de pagamento; e a instituição devedora de outra instituição decorrente de acordo de interoperabilidade entre diferentes arranjos de pagamento;
- Derivativos – produtos de investimento que derivam de outros ativos – sejam eles físicos, como café e soja, por exemplo, ou financeiros, como dólar, índices e ações;
- Mitigar – desenvolver e implementar processos e atividades com a finalidade de minimizar a probabilidade de ocorrência de um risco, principalmente, seu impacto;
- Outros Riscos – abrange os demais riscos, abordados na presente norma, que podem ocasionar perdas à CAIXA ASSET ou descontinuidade dos serviços prestados, podendo estar relacionados a contratação de terceiros, à segurança da informação ou outros fatores não abordados nessa norma;
- PRSAC – Política de Responsabilidade Social, Ambiental e Climática;
- Risco à integridade – vulnerabilidade organizacional que pode favorecer ou facilitar a prática de atos irregulares ou ilícitos e eventos relacionados a corrupção, fraudes, irregularidades e/ou desvios éticos e de conduta que possam comprometer os valores e padrões preconizados pela instituição e a realização de seus objetivos; o risco para a

integridade pode ser causa, evento ou consequência de outros riscos, tais como financeiros, operacionais ou de imagem;

- Risco ambiental – possibilidade de ocorrência de perdas para a instituição ocasionadas por eventos associados à degradação do meio ambiente, incluindo o uso excessivo de recursos naturais;
- Risco climático de transição – possibilidade de ocorrência de perdas para a instituição ocasionadas por eventos associados ao processo de transição para uma economia de baixo carbono, em que a emissão de gases do efeito estufa é reduzida ou compensada e os mecanismos naturais de captura desses gases são preservados;
- Risco climático físico – possibilidade de ocorrência de perdas para a instituição ocasionadas por eventos associados a intempéries frequentes e severas ou a alterações ambientais de longo prazo, que possam ser relacionadas a mudanças em padrões climáticos;
- Risco de Compliance – caracterizado pela probabilidade de ocorrência de perdas financeiras ou reputacionais decorrentes do não cumprimento com as obrigações legais, regulamentares, códigos de conduta da organização em suas atividades, produtos e serviços;
- Risco de Concentração – possibilidade de perdas associadas a exposições significativas em uma mesma contraparte, a contrapartes com atuação em um mesmo setor econômico, região geográfica ou segmento de produtos ou serviços, contrapartes cujas receitas dependam de um mesmo tipo de mercadoria (commodity) ou atividade, a instrumentos financeiros cujos fatores de risco, incluindo moedas e indexadores, são significativamente relacionados, associadas a um mesmo tipo de produto ou serviço e cujo risco é mitigado por um mesmo tipo de instrumento;
- Risco de Contraparte – possibilidade de perdas decorrentes do não cumprimento de obrigações relativas à liquidação de operações que envolvam fluxos bilaterais, incluindo a negociação de ativos financeiros ou de derivativos;
- Risco de Crédito – possibilidade de ocorrência de perdas associadas ao não cumprimento pelo tomador ou contraparte de suas respectivas obrigações financeiras nos termos pactuados, à desvalorização de instrumento financeiros decorrente da deterioração na classificação de risco do tomador, à redução de ganhos ou remunerações, às vantagens concedidas na renegociação e aos custos de recuperação;

- Risco de Estratégia – decorrente de mudanças adversas no ambiente de negócios ou de utilização de premissas inadequadas na tomada de decisão;
- Risco de Imagem/Reputação – é a possibilidade de perdas decorrentes do desgaste da imagem da instituição junto ao mercado e órgãos reguladores em razão de publicidade negativa, ocasionadas por práticas internas, eventos de risco e fatores externos que possam gerar uma percepção negativa da instituição por parte de clientes, contrapartes, acionistas, investidores, supervisores, parceiros comerciais, entre outros, acarretando em impactos no valor da marca e/ou perdas financeiras, além de afetar de maneira adversa a capacidade da organização em manter relações comerciais existentes e dar início a novos negócios;
- Risco de Liquidez – possibilidade da organização ou dos veículos de investimento não serem capazes de honrar eficientemente suas obrigações esperadas e inesperadas, correntes e futuras, inclusive as decorrentes de vinculação de garantias, sem afetar suas operações diárias e sem incorrer em perdas significativas, e, também, de não conseguirem negociar a preço de mercado uma posição, devido ao seu tamanho elevado em relação ao volume normalmente transacionado ou em razão de alguma descontinuidade no mercado;
- Risco de Mercado – possibilidade de perdas resultantes da flutuação nos valores de mercado de posições detidas pela organização e pelos veículos de investimento. Essa definição inclui as operações sujeitas à variação cambial, das taxas de juros, dos preços de ações e dos preços de mercadorias (commodities);
- Risco Operacional – possibilidade da ocorrência de perdas resultantes de eventos externos ou de falha, deficiência ou inadequação de processos internos, pessoas ou sistemas, incluindo o risco legal associado à inadequação ou deficiência em contratos firmados pela instituição, às sanções em razão de descumprimento de dispositivos legais e às indenizações por danos a terceiros decorrentes das atividades desenvolvidas pela instituição;
- Risco social – possibilidade de ocorrência de perdas para a instituição ocasionadas por eventos associados à violação de direitos e garantias fundamentais ou a atos lesivos ao interesse comum;
- Sustentabilidade – princípio pelo qual se busca assegurar a satisfação das necessidades presentes e a prosperidade, equilibrando aspectos sociais, econômicos, ambientais e climáticos, sem comprometer a capacidade das gerações futuras de suprir suas próprias necessidades;

- Veículo de Investimento - fundos de investimento e/ou carteiras administradas sob gestão da CAIXA ASSET.

MOTIVAÇÃO

Atendimento à Lei nº 13.303/2016, ao Decreto 8.945/2016, quanto às diretrizes para gerenciamento de riscos na empresa pública, da sociedade de economia mista e de suas subsidiárias, no âmbito da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios.

Atendimento à Resolução BCB nº 265/2022, quanto a estrutura de gerenciamento de riscos e a estrutura de gerenciamento de capital das instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil.

Atendimento à Resolução CVM n.º 175/2022 que dispõe sobre a constituição, o funcionamento e a divulgação de informações dos fundos de investimento, bem como sobre a prestação de serviços para os fundos.

Atendimento ao Código de Administração e Gestão de Recursos de Terceiros da ANBIMA que dispõe sobre as atividades de administração fiduciária, gestão de recursos de terceiros e gestão de patrimônio financeiro dos fundos de investimento e das carteiras administradas.

VIGÊNCIA

A Política é revisada anualmente, ou sempre que se fizer necessário, com o objetivo de mantê-la adequada à natureza, complexidade e riscos compatíveis com as práticas de mercado e a governança corporativa da Companhia.

DIRETRIZES GERAIS

A construção e execução do processo de gerenciamento de riscos são pautadas no atendimento às regulamentações internas e externas, de acordo com o apetite a risco e complexidade do negócio e/ou produto, com execução tempestiva de ações preventivas e corretivas e de forma estruturada e abrangente, de forma que a gestão de riscos contribua para resultados consistentes.

A Política de Gerenciamento de Riscos é de caráter estratégico, compreendendo os produtos, processos e serviços para os quais seja necessário o monitoramento de tais riscos, auxiliando na melhor tomada de decisão.

Cabe a todos os gestores no âmbito dos seus produtos, serviços, processos e atividades a atuação como gestor de risco realizando a identificação e mitigação dos respectivos riscos inerentes.

A estrutura de gerenciamento de riscos permite identificar, avaliar, mensurar, monitorar, estabelecer limites, controlar, reportar, propor ações de mitigação e simular a exposição em cenários de normalidade e de estresse, abrangendo todas as fontes relevantes de risco.

Engloba políticas, procedimentos, e sistemas para medir, monitorar e controlar considerando a natureza e a complexidade dos produtos, processos e a dimensão da exposição aos riscos de crédito, mercado, liquidez, imagem e reputação, social, ambiental, climático, *compliance*, à integridade, operacional e demais riscos relevantes para os produtos, processos e serviços que envolvem a gestão de ativos de terceiros.

Promove os princípios de desenvolvimento sustentável implantando os conceitos da gestão integrada ao meio ambiente, qualidade, saúde e segurança no trabalho e responsabilidade social e climática ao negócio.

Todas as atividades e procedimentos de gestão de riscos ocorrem no estrito cumprimento das normas internas e externas e melhores práticas do mercado com as quais se relacionam guardando correspondência à regulamentação e as especificidades relacionadas ao negócio gestão de recursos de terceiros.

São adotados procedimentos periódicos para confirmar a autenticidade e veracidade dos documentos e informações apresentadas pelos parceiros, fornecedores e prestadores de serviços, com o objetivo de prevenir a realização e/ou manutenção de negócios com contrapartes inidôneas, bem como para assegurar que eles possuam práticas e procedimentos para coibir ações e/ou condutas inadequadas, quando aplicáveis e conforme regulações vigentes (*Due Diligence*).

A conduta ética e os valores morais norteiam o gerenciamento de riscos, com proteção da confidencialidade e da integridade das informações.

O processo de gestão de riscos utiliza como subsídio para mensuração das exposições informações internas, externas e de fontes públicas com monitoramento contínuo da base de dados primando pela integridade das informações geradas.

Os profissionais conduzem suas atividades e pautam suas decisões dentro de princípios éticos e morais, isentos de qualquer interesse pessoal, baseados nas normas internas e externas e nas melhores práticas de mercado.

A integridade e os valores éticos, são caracterizados como elementos essenciais no gerenciamento de riscos e contribuem para a eficácia no atingimento das estratégias e objetivos empresariais.

A CAIXA ASSET privilegia o aperfeiçoamento técnico do corpo funcional, nos diversos níveis hierárquicos, de forma contínua e permanente, por meio de treinamentos corporativos, certificações, cursos acadêmicos e seminários, de forma a promover a adequada mitigação dos Riscos a que a Companhia está sujeita.

RISCO DE CRÉDITO, CONCENTRAÇÃO E CONTRAPARTE

Para o gerenciamento dos Riscos de Crédito, de Concentração e de Contraparte são estabelecidos limites de exposição para cada produto e para exposição global com base em notas de avaliação atribuídas aos ativos ou emissores, bem como, características do fundo de investimento e seu perfil de risco.

Unidade Responsável: GN Riscos Financeiros - GERAT.

RISCO DE MERCADO

O Risco de Mercado dos Fundos de Investimentos e Carteiras Administradas é gerenciado por meio de modelos que permitem avaliar os instrumentos financeiros, identificar os riscos, mensurar o valor em risco e simular impactos macroeconômicos e de mudanças na composição dos ativos, inclusive em cenários de estresse.

Unidade Responsável: GN Riscos Financeiros - GERAT.

RISCO DE LIQUIDEZ

O Risco de Liquidez é monitorado considerando os fluxos de entradas e saídas de recursos financeiros ao longo do tempo e o volume de negociação no mercado secundário dos ativos detidos pelos fundos de investimento, a fim de evitar escassez de caixa e dificuldade em honrar as obrigações previstas.

Unidade Responsável: GN Riscos Financeiros - GERAT

RISCO OPERACIONAL

O Risco Operacional é avaliado com base no reporte de incidentes pelas unidades gestoras e monitoramento dos processos das unidades envolvidas com intuito de avaliar a suficiência dos mecanismos de mitigação adotados pela 1ª linha. A avaliação considera preponderantemente os processos críticos, permitindo intervenção gerencial antes da materialização do Risco Operacional em evento de perda, além de possibilitar a continuidade dos negócios em caso de indisponibilidade de recursos.

Unidades Responsáveis: Unidades CAIXA ASSET.

RISCO SOCIAL, AMBIENTAL E CLIMÁTICO

Os Riscos sociais, ambientais e climáticos são avaliados a partir do estudo dos segmentos, dos ativos investidos e dos emissores, produtos concebidos e decisões organizacionais segundo os critérios internacionais e internos de identificação de impactos ambientais, climáticos de transição e físico e sociais gerados, alinhados a Política de Responsabilidade Social, Ambiental e Climática da Controladora visando neutralizar ou minimizar os impactos negativos e potencializar e favorecer os impactos positivos para estas dimensões.

Unidades Responsáveis: Unidades CAIXA ASSET.

RISCO DE IMAGEM E REPUTAÇÃO

O Risco de Imagem e de Reputação é avaliado a partir de reações, pelos públicos interessados, às decisões de investimento, criação de produtos e demais atividades decorrentes da gestão de ativos de terceiros, utilizando ferramentas adequadas para identificar defensores e detratores da organização.

Unidades Responsáveis: Unidades CAIXA ASSET.

RISCO DE COMPLIANCE

O Risco de *Compliance* é gerenciado pela observação das normatizações internas e externas, verificando impactos relacionados e nível de importância, com execução de ações preventivas e corretivas. O monitoramento é realizado através de indicadores de normas, regulamentações e enquadramento dos Fundos de Investimento.

Unidades Responsáveis: Unidades CAIXA ASSET.

RISCO DE ESTRATÉGIA

O Risco de Estratégia é gerenciado a partir do acompanhamento dos ambientes interno e externo, do mercado competitivo, observando os principais vetores de transformação, oportunidades e ameaças. No seu monitoramento são estabelecidos indicadores vinculados ao plano de negócios anual da CAIXA ASSET.

Unidades Responsáveis: Unidades CAIXA ASSET.

OUTROS RISCOS

Demais riscos já identificados ou que sejam identificados, considerados como relevantes para o processo e serviços da CAIXA ASSET são analisados, avaliados e mensurados a partir de estudos técnicos, sendo adotadas ações para tratamento, monitoramento, estabelecimento de limites e mitigação de tais riscos.

Unidades Responsáveis: Unidades CAIXA ASSET.

GERENCIAMENTO DE RISCOS

Os limites de exposição a riscos e valores máximos admitidos de prejuízo potencial (perdas) para a gestão dos recursos próprios, dos Fundos de Investimento e Carteiras Administradas visam preservar a solvência, a liquidez e a rentabilidade da Companhia, dos fundos e carteiras geridas e administradas.

O relacionamento com parceiros, fornecedores e prestadores de serviços é monitorado periodicamente, podendo ser interrompido a qualquer tempo, quando for identificado sua possível vinculação com ações e condutas inidôneas e/ou infringências legais, que possam representar riscos de imagem e reputação à CAIXA ASSET.

Geração e divulgação de informações sobre riscos ocorrem de forma clara, completa e oportuna a fim de proporcionar às partes interessadas o acompanhamento e o entendimento do desempenho, e gerenciamento de riscos de forma inequívoca, subsidiando a tomada de decisão pela alta administração, observando-se, para tanto, as hipóteses legais de sigilo.

O desempenho das metodologias e dos modelos utilizados é avaliado de forma sistemática e periódica, com vistas à validação dos resultados obtidos, correções e ajustes necessários e a

verificação da suficiência da documentação para possibilitar a identificação dos elementos construtivos do processo de desenvolvimento e testes.

A descrição das estruturas e processos de gerenciamento dos riscos é publicada em relatório de acesso público, com periodicidade prevista na regulamentação externa e normatização interna.

A estrutura de gerenciamento de riscos assegura que as informações sobre riscos sejam fidedignas e adequadamente reportadas para a utilização como base para a tomada de decisões, aprimoramento da gestão e a responsabilização em todos os níveis organizacionais aplicáveis.

Os relatórios gerados a partir dos modelos de risco são divulgados, respeitado o grau de sigilo e conforme sua natureza, considerando informações qualitativas e quantitativas sobre os resultados apurados de forma a subsidiar o processo decisório e, conforme o caso, a disponibilização ao órgão regulador e ao público externo fortalecendo a visão integrada dos riscos e a disseminação da cultura de controle através de uma comunicação clara e intuitiva.

O monitoramento das exposições a riscos e dos limites é realizado periodicamente e visa assegurar o conhecimento da evolução das posições de riscos às instâncias competentes, através do reporte de informações técnicas e de exposição de risco por meio de relatórios e ferramentas de comunicação dinâmicas e interativas.

As atividades de identificação, avaliação, mensuração, mitigação, monitoramento e comunicação de riscos são executadas por unidade segregada e com independência funcional das unidades negociais, sendo pautadas nas boas práticas do mercado nacional e internacional, normas internas e legislações pertinentes.

As atividades e processos são executados respeitando-se a segregação de atividades determinadas pelas normas internas e externas e, em linha com as melhores práticas de mercado.

Os modelos e procedimentos utilizados na execução dos processos são acompanhados periodicamente, e de acordo com as normas estabelecidas, com o objetivo de zelar pela sua eficiência e efetividade e, ainda, assegurar os subsídios necessários para estabelecer os critérios, parâmetros e limites alinhados às melhores práticas de gestão de riscos e compatíveis com as determinações legais, normas internas e perfil dos produtos, buscando contribuir com o ganho de competitividade dos produtos e serviços.

As atividades e a estrutura de gerenciamento de riscos são monitoradas e adaptadas continuamente, de forma a contemplar mudanças internas e externas, avaliando-se os aspectos de adequação, suficiência e eficácia.

Todos os empregados atuam como gestores de riscos, entendendo o papel de cada um na mitigação e gestão dos riscos incorridos pela Instituição decorrentes de seus produtos, serviços, processos e atividades.

Monitoramento dos riscos é feito de forma holística, incluindo, as dimensões social, ambiental, de governança e econômica em todas avaliações e diretrizes para tomada de decisão.

O gerenciamento dos riscos da CAIXA ASSET considera o cenário de mudanças climáticas, a proteção ampla e preservação dos direitos humanos e do meio ambiente de modo geral, em suas atividades, serviços, produtos e relacionamentos, contemplando a legislação social e ambiental vigente, o engajamento com as partes interessadas, a acessibilidade, o cumprimento da legislação trabalhista, a não discriminação e a eficiência e sustentabilidade na utilização dos recursos naturais e prevenção da poluição.

Unidades Responsáveis: Unidades da CAIXA ASSET.

INDICADORES DE EFETIVIDADE

ÍNDICE DE DISSEMINAÇÃO DA POLÍTICA DE GERENCIAMENTO DE RISCOS

Objetivo - Dar ciência aos empregados acerca dos princípios e diretrizes da Política de Gerenciamento de Riscos.

Métrica: quantidade de empregados com declaração de ciência do inteiro teor desta Política dividido pela quantidade de empregados CAIXA ASSET.

Periodicidade de Apuração: Trimestral.

Responsável pela apuração: GN Governança, Riscos Especializados e Compliance - GECAT.

Abrangência: Todas as unidades da CAIXA ASSET.

ÍNDICE DE ADERÊNCIA À PRSAC CONTROLADORA

Objetivo - Garantir a ciência dos empregados da CAIXAASSET quanto às diretrizes e princípios de desenvolvimento sustentável contidas na PRSAC.

Métrica: quantidade de empregados com declaração de ciência do inteiro teor desta Política dividido pela quantidade de empregados CAIXA ASSET.

Periodicidade de Apuração: Anual.

Responsável pela apuração: GN Governança, Riscos Especializados e Compliance - GECAT.

Abrangência: Todas as unidades da CAIXA ASSET.

ÍNDICE DE MONITORAMENTO DOS LIMITES DE EXPOSIÇÃO A RISCOS

Objetivo - Avaliar a efetividade do controle e monitoramento da exposição de risco dos Fundos em relação aos limites estabelecidos.

Métrica: total de eventos de extrapolação dos limites para exposição a riscos.

Periodicidade de Apuração: Semestral.

Responsável pela apuração: GN Riscos Financeiros - GERAT.

Abrangência: GN Fundos Estruturados - GEFES e unidades vinculadas à SN Gestão de Fundos Líquidos - SUGET.

ÍNDICE DE TRATAMENTO DE EVENTOS DE EXTRAPOLAÇÃO DE LIMITES DE RISCOS

Objetivo - Avaliar o tratamento de eventos de extrapolação quanto a prontidão no enquadramento da exposição aos limites estabelecidos.

Métrica: quantidade de eventos de extrapolação dos limites para exposição a riscos com necessidade de plano de ação dividido pela quantidade de eventos de extrapolação.

Periodicidade de Apuração: Semestral.

Responsável pela apuração: GN Riscos Financeiros - GERAT.

Abrangência: GN Fundos Estruturados - GEFES e unidades vinculadas à SN Gestão de Fundos Líquidos - SUGET.

ÍNDICE DE MATURIDADE DE GESTÃO DE RISCO OPERACIONAL

Objetivo - Qualificar a maturidade da CAIXA ASSET na gestão de risco operacional dos seus processos/subprocessos avaliando se seus processos estão sendo corretamente identificados e avaliados com tratamento e monitoramento adequados.

Métrica: quantidade de unidades da CAIXA ASSET com índice de maturidade superior a 75 pontos dividido pela quantidade de unidades da CAIXA ASSET.

Periodicidade de Apuração: Trimestral.

Responsável pela apuração: GN Governança, Riscos Especializados e Compliance - GECAT.

Abrangência: Todas as unidades da CAIXA ASSET.

ÍNDICE DE QUALIDADE DO PROGRAMA DE CONTINUIDADE DE NEGÓCIOS

Objetivo - Avaliar a eficiência do programa de continuidade quanto a funcionalidade do ambiente de contingência da CAIXA ASSET.

Métrica: quantidade de reporte de teste funcional qualificado como satisfatório dividido pela quantidade de unidades da CAIXA ASSET com necessidade de utilização de ambiente de contingência.

Periodicidade de Apuração: Anual.

Responsável pela apuração: GN Governança, Riscos Especializados e Compliance - GECAT.

Abrangência: Todas as unidades da CAIXA ASSET.

ÍNDICE DE CONTINUIDADE DE NEGÓCIOS

Objetivo - Garantir a manutenção da execução dos processos/subprocessos da CAIXA ASSET classificados como críticos em situações de contingência.

Métrica: quantidade de processos/subprocessos críticos abarcados nos Planos de Contingência Operacional das unidades dividido pela quantidade de processos/subprocessos classificados como críticos.

Periodicidade de Apuração: Anual.

Responsável pela apuração: GN Governança, Riscos Especializados e Compliance - GECAT.

Abrangência: Todas as unidades da CAIXA ASSET.

ÍNDICE DE INCORPORAÇÃO DE PRINCÍPIOS ASG

Objetivo - Avaliar a evolução de incorporação dos princípios ASG no processo de gestão de ativos de terceiros.

Métrica: Sob a ótica de gestão de ativos de terceiros, cumprimento dos requisitos necessários para manutenção da adesão da CAIXAASSET aos Princípios para o Investimento Responsável – PRI.

Periodicidade de Apuração: Anual.

Responsável pela apuração: GN Governança, Riscos Especializados e Compliance - GECAT.

Abrangência: DI Gestão Fundos de Investimento - DITER e unidades vinculadas.

RESPONSABILIDADES

GN RISCO FINANCEIROS - GERAT

Acompanhar e avaliar esta Política, propor alterações cabíveis sempre que necessário, por iniciativa própria ou sob demanda.

Monitorar a implementação desta Política para permitir o gerenciamento e o planejamento de ações e/ou novas estratégias.

Revisar e submeter a Política de Gerenciamento de Riscos para aprovação pela alta administração.

Estabelecer metodologias, modelos, parâmetros, normas e procedimentos para gestão dos riscos dos produtos, processos e serviços para gestão de Ativos de Terceiros conforme suas características.

GN GOVERNANÇA, RISCOS ESPECIALIZADOS E COMPLIANCE – GECAT

Promover a disseminação da Política de Gerenciamento de Riscos.

DEMAIS UNIDADES DA CAIXA ASSET

Observar a Política de Gerenciamento de Riscos, visando assegurar a solvência, liquidez e a sustentabilidade dos produtos, serviços e processos, conforme mandatos sob sua responsabilidade.

Gerenciar os riscos em todas as etapas, atuando como 1ª Linha na implantação de controles, monitoramentos, indicadores e demais responsabilidades decorrentes.

Implantar estratégias de mitigação dos riscos identificados.

Adequar normativos, processos, produtos e serviços à Política de Gerenciamento de Riscos.

Assegurar a precisão dos dados/informações disponibilizados às unidades responsáveis pelo gerenciamento dos riscos.

Disseminar a cultura de Gerenciamento de Riscos no âmbito de sua atuação.

Adotar, no âmbito de suas atividades, mecanismos a fim de evitar a ocorrência de eventos que possam afetar o alcance dos objetivos da CAIXA ASSET como administradora de carteira de valores mobiliários no gerenciamento de riscos.

EMPREGADOS E DIRIGENTES

Conhecer esta Política de Gerenciamento de Riscos e assinar o respectivo Termo de Ciência.

Disseminar, fomentar e cumprir o estabelecido nesta Política e nos normativos correlatos.

Cumprir rigorosamente a regulamentação interna e externa vigentes e os procedimentos estabelecidos, a fim de mitigar riscos e minimizar prejuízos.