



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: 71.590.442/0001-83

Nome do Administrador de Carteira: LASTRO RDV DTVM LTDA

Ano de competência: 2023

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A LASTRO RDV DTVM, nasce em fevereiro de 1991 como uma empresa de Fomento. Posteriormente, tendo o objetivo de atuar na área financeira, solicita autorização ao Banco Central do Brasil para operar como Distribuidora de Títulos de Valores Mobiliários. Em 1993 a autorização é concedida, passando a operar nas áreas de Câmbio Flutuante e de Intermediações Financeiras.

No ano posterior e seguinte (1994 e 1995), a Lastro faz intermediações de CDB's e RDB's de Bancos Emissores, trazendo para o interior paulista muitas instituições financeiras que não possuíam agências ou escritórios de representação, tais como: Bank Boston, Banco Martinelli, Bancesa, Banfort, Cacique, Safra, Banco Boa Vista, Banco Cidade, entre outros, além de títulos e valores mobiliários de bancos tradicionais presentes em nossa região, como Bradesco, Itaú, Unibanco e Banco do Brasil.

Através do Ato Declaratório nº 8.264 de abril de 2005, a CVM (COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS), autoriza a LASTRO RDV DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS a prestar os Serviços de Administração de Carteira de Valores Mobiliários iniciando assim suas operações com Fundos de Investimentos. Em seguida, o Banco Chase Manhattan e o JP Morgan se unem, sendo definidas novas diretrizes para seus Distribuidores. Dentro deste novo formato, a Lastro cria uma família de fundos de cotas, tendo como administrador a LASTRO RDV DTVM e como gestor o Banco Chase Manhattan. Concomitante, a LASTRO inicia a operação de Clube de Investimento em ações, atendendo uma nova demanda do mercado. Em 2006, foi criado o FIDC Lastro Performance Longo Prazo (Fundo de Investimentos em Direitos Creditórios), o qual, além de conceder crédito por meio da compra de recebíveis, também oferece novas alternativas para seus investidores.

Em 2014, inicia-se o processo de credenciamento da LASTRO RDV DTVM a Clearing de Câmbio, junto a BVM&F Bovespa, sendo concluído o processo de certificação em meados de 2015. Para atender as necessidades do credenciamento da BVM&F Bovespa, a empresa se profissionaliza e assina contrato com o principal e maior provedor de tecnologia do setor financeiro do país: a RTM.

Em 05/2020 a LASTRO passa por uma reestruturação em seu "core business" com o fechamento de suas filiais onde atuava com câmbio varejo.

Em 06/2020 inicia o seu Credenciamento junto a CVM para habilitação como Administrador Fiduciário, Custódia e Escrituração para fundos de investimentos, cujas aprovações se deram, respectivamente em 11/11/2020, 18/01/2021 e 04/01/2021.

Além disso, as operações de câmbio passam a ser prioritariamente para fins de comércio exterior e remessas financeiras.

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

N/D

b. Escopo das atividades

Administração de Fundos de Investimentos;

Custódia de Valores Mobiliários;

Escrituração de Valores Mobiliários;

Câmbio;

c. Recursos humanos e computacionais



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

A Lastro tem contrato com a RTM Rede de Telecomunicações Para o Mercado Ltda, para Prestação de Serviços de Gerenciamento de Sistemas e Redes, nossos servidores e todas as informações estão hospedados em Cloud Server com a RTM, os sistemas de gerenciamento e sistemas operacionais estão configurados a estes servidores, onde toda comunicação é feita através de um link seguro com IP dedicado, entre a Lastro até a RTM, mantemos todos nossos servidores virtualizados para uma maior segurança e agilidade com a informação. Todos os computadores estão configurados com antivírus e proteção para instalação de sistemas não autorizados, configurado para que o usuário não tenha permissão para instalação de sistemas e conexões com dispositivos removíveis, entre outros níveis de segurança adotado.

Sistemas utilizados:

Atlas/MARKET RISK: tem como objetivo a gestão de risco de mercado dos portfólios de investimento.

Atlas/LIQUID RISK: destinado para o cômputo de métricas de liquidez, concentração e estresse de fundos de investimento sem a explosão de cotas de fundos, que aplica em ativos domésticos.

ATLAS/PAS: Sistema responsável pelo controle de ativos/passivos bem como o cálculo do Patrimônio e o valor da cota dos Fundos.

ATLAS/TAS: Sistema responsável pelo controle, verificação e atualização das informações de cotistas dos Fundos.

ATLAS BPO - (BusinessProcessOutsourcing): O serviço proposto consiste na valorização diária de fundos de investimentos e carteiras administradas, bem como o cálculo do respectivo valor de cota, através de informações fornecidas pelo Cliente e por agentes de mercado, inclusive a preparação de relatórios periódicos referentes a posição patrimonial dos portfólios, contendo: (i) todos os ativos que compõem os portfólios; (ii) sua quantidade e valor; (iii) fluxo de caixa contendo contas a pagar e a receber; (iv) posição atualizada de ativo e passivo.

BRITECH REC: sistema estruturado de forma a atender as principais áreas funcionais de recebimento de recebíveis.

Principais funções:

- Importação dos arquivos de Remessa;
- Importação dos arquivos de Cobrança;
- Regras de Enquadramento;
- Fechamento dos Fundos;
- Operações Retroativas;
- Provisão para Devedores Duvidosos (PDD);
- Exportação dos arquivos de retorno de Remessa;
- Exportação do arquivo para integração com o sistema de Ativos;
- Conciliação;
- Controle de estoque;
- Posição e Movimento do Fundo;
- Evolução do Fundo;
- Parametrizações para Baixas Automáticas;
- Parametrizações para Baixas Manuais;
- Parametrizações de Layout por tipo de Movimento.

d.Regras, políticas, procedimentos e controles internos

Política de Conformidade (Compliance)

A Política formaliza os seguintes aspectos:

- o Plano de Contingência e Continuidade de Negócios;
 - o Política de Conduta e Ética;
 - o Política de Direito de Exercício de Voto;
 - o Política de Gestão de Riscos para Fundos de Investimento;
 - o Política de Governança e Controles Internos;
 - o Política de PLD;
 - o Política de Negociação de Valores Mobiliários;
 - o Política de Ouvidoria;
 - o Política de Rateio e Divisão de Ordens;
 - o Política de Relacionamento com Clientes;
 - o Política de Responsabilidade Socioambiental;
 - o Política de Segregação de Atividades e Confidencialidade;
 - o Política de Seleção, Contratação e Monitoramento de Prestador de Serviços para Fundos de Investimento;
 - o Política de Sucessão de Administradores;
 - o Política de Suitability;
 - o Política de Treinamento;
 - o Política e Normas de Segurança da Informação e Cibernética;
 - o Política Institucional de Câmbio;
 - o Avaliação de Efetividade;
 - o Avaliação Interna de Risco e Abordagem Baseada em Risco;
 - o Manual de Boas Práticas do uso da Tecnologia da Informação;
 - o Manual de Distribuição de Títulos e Valores Mobiliários;
 - o Manual de Precificação de Ativos;
 - o Manual de Provisionamento de Ativos;
 - o Manuais KYC, KYE, KYP/KYS;
 - o Manual de Monitoramento, Seleção, Análise e Comunicação ao COAF;
- A Política está adequadamente adaptada para atender as exigências trazidas pela Resolução CVM 21 e Resolução CVM 50 pelo Guia de Prevenção à "Lavagem de Dinheiro" e ao Financiamento ao Terrorismo no Mercado de Capitais Brasileiro.



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

3. Recursos Humanos

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

a. Número de sócios:

3

b. Número de empregados:

11

c. Número de terceirizados:

5

CPF	Nome
866.650.148-00	MARCO AURELIO RUSSO
272.815.368-01	ELISANGELA KATIA CAPASSI

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
BDO RCS Auditores Independentes SS	08/06/2018	Exame das demonstrações contábeis, que abrangem o Balanço Patrimonial, Demonstração de Resultados; Demonstração das mutações do Patrimônio Líquido, Demonstrações das Origens e aplicações de recursos e notas explicativas às demonstrações contábeis.

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)



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

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 LASTRO RDV DTVM atuará prioritariamente nos seguintes segmentos:

Administração de Clubes e Fundos de Investimento;

Fundos de Ações, Renda Fixa e Multimercado (ICVM 555);

FIDC / FIDC-NP / FIC-FIDC / FIC-FIDC-NP;

FIP;

FII;

Controladoria e Custódia;

Controladoria e custódia para clubes e fundos de investimento;

Escrituração de valores mobiliários para fundos de investimento, inclusive quotas de clubes e fundos de investimento não listados em mercado organizado;

Distribuição no âmbito de ofertas públicas (Res CVM 160 e Res CVM 173), mas predominantemente no âmbito de ofertas públicas com esforços restritos exclusivamente para fundos de investimentos administrados e/ou geridos pela LASTRO;

Câmbio.

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.)

Fundos de Ações, Renda Fixa e Multimercado (ICVM 555)

FIDC / FIDC-NP / FIC-FIDC / FIC-FIDC-NP;

FIP;

FII;

Clube de Investimento;

Carteira Administrada

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão



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

- Cotas de fundos de investimento registrados com base na ICVM 555/14 -
- Cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento registrados com base na ICVM 555/14
- Cotas de fundos de índice admitidos à negociação em mercado organizado
- Cotas de fundos de investimento destinados exclusivamente a investidores qualificados registrados com base na ICVM 555/14
- Cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento destinados exclusivamente a investidores qualificados registrados com base na ICVM 555/14
- Cotas de Fundos de Investimento Imobiliário - FII
- Cotas de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios - FIDC
- Cotas de Fundos de Investimento em Fundos de Investimento em Direitos Creditórios - FIC-FIDC
- Cotas de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios Não-Padronizados - FIDC-NP;
- Cotas de Fundos de Investimento em Fundos de Investimento em Direitos Creditórios Não-Padronizados - FIC-FIDC-NP;
- Cotas de Fundos Mútuos de Investimento em Empresas Emergentes
- Fundos de Investimento em Participações (FIP) e Fundos de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento em Participações (FIC-FIP)

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

A LASTRO atua prioritariamente nos seguintes seguimentos:

- Controladoria e Custódia para clubes e fundos de investimento.

(Possível conflito: A atividade é física e eletronicamente segregada das atividades de administração, de modo que, não há conflito real entre as atividades)

- Escrituração de Valores Mobiliários para fundos de investimentos, inclusive quotas de clubes e fundos de investimento não listados em mercado organizado.

(Possível conflito: A atividade é física e eletronicamente segregada das atividades de administração, de modo que, não há conflito real entre as atividades)

- Câmbio (remessas financeiras e comércio exterior).

(Possível conflito: Atividade com foco diferenciado, não havendo nenhuma possibilidade de conflito de interesse).

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/D

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	47	0	47



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. Número de investidores, dividido por:	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	24	0	24
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	9	0	9
iii. Instituições Financeiras	1		1
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	13		13
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

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	47	0	47

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 216.473.117,80	R\$ 0,00	R\$ 216.473.117,80

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

R\$ 0,00

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



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

Valor	Nome
R\$ 44.796.633,57	
R\$ 41.364.525,31	
R\$ 36.823.760,63	
R\$ 34.438.091,87	
R\$ 7.510.171,31	
R\$ 6.186.117,02	
R\$ 5.723.490,21	
R\$ 4.903.132,82	
R\$ 3.699.898,02	
R\$ 0,00	

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\$ 57.709.919,74	R\$ 0,00	R\$ 57.709.919,74
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 21.391.402,06	R\$ 0,00	R\$ 21.391.402,06
iii. Instituições Financeiras	R\$ 1.263.394,34		R\$ 1.263.394,34
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\$ 136.108.401,66		R\$ 136.108.401,66
xi. Investidores não Residentes	R\$ 0,00		R\$ 0,00
xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
Total	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
	R\$ 216.473.117,80	R\$ 0,00	R\$ 216.473.117,80

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



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

a. Ações	R\$ 0,00
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\$ 0,00
e. Cotas de fundos de investimento em participações	R\$ 0,00
f. Cotas de fundos de investimento imobiliário	R\$ 0,00
g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R\$ 165.898.282,54
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 0,00
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 50.574.835,26
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 0,00
k. Outros valores mobiliários	R\$ 0,00
l. Títulos públicos	R\$ 0,00
m. Outros ativos	R\$ 0,00
Total	R\$ 216.473.117,80

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

A LASTRO possui contrato com gestores dos mais diversos perfis, sendo que uma parte preponderante desses gestores será focada em fundos estruturados, exclusivos ou destinados a investidores qualificados, profissionais ou um público restrito de investidores.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não existem outras informações que a empresa julgue relevante

7. Grupo Econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
866.650.148-00	MARCO AURELIO RUSSO
00.001.300/4498-96	GILBERTO DELLA VOLPE
00.000.404/3888-09	GINO DELLA VOLPE

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



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

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.

Nenhum arquivo selecionado.

8. Estrutura Operacional e Administrativa

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

a. Atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico

A Sociedade é administrada por uma diretoria, composta por 7 (sete) membros, todos eleitos pelos acionistas, com prazo de mandato de 2 (dois) anos.

A Sociedade contará com as áreas de

- Administração Fiduciária;
- Risco;
- Compliance;
- Custódia;
- Escrituração.

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 de Risco Operacional, Compliance e PLDFT

Objetivo: Comitê de Controles Internos e Compliance, doravante denominado "Comitê", órgão não estatutário de caráter permanente e com poderes deliberativos, tem por objetivo assessorar a Diretoria no desempenho de suas atribuições relacionadas à adoção de estratégias, políticas e medidas voltadas à difusão da cultura de controles internos, mitigação de riscos e conformidade com normas aplicáveis à LASTRO.

Membros: O comitê será composto por até 04 membros e 1 secretário, dentre os quais: Diretor Gerente, Diretor de Custódia; Diretor de Administração; Diretor Riscos e Compliance; e Secretário.

Vigência: Indeterminado.

Frequência: sempre que necessário.

Forma de Registro: Ata.

Comitê: Auditoria.

Objetivo: O Comitê de Auditoria é órgão estatutário de assessoramento vinculado diretamente a Diretoria da instituição. O objetivo desse comitê é: i.) Avaliar a efetividade das auditorias independentes e internas, inclusive quanto à verificação do cumprimento de dispositivos legais e normativos aplicáveis à Sociedade, além de regulamentos e códigos internos; e ii.)

Avaliar o cumprimento, pela administração da Sociedade, das recomendações feitas pelos auditores independentes e/ou internos, bem como recomendar aos acionistas a resolução de eventuais conflitos entre os auditores externos e a Diretoria.

Membros: O Comitê de Auditoria será composto por no máximo 3 (três) membros titulares, todos eleitos pela Assembleia Geral da Companhia.

Vigência: Indeterminado.

Frequência: semestral.

Forma de Registro: Ata.

Comitê: Conduta e Ética.

Objetivo: O Comitê de Conduta e Ética tem por objetivo estabelecer os padrões de conduta éticos, boas práticas mercadológicas, princípios, valores e integridade pessoal exigidos de Diretores, Colaboradores, Funcionários e demais prestadores de serviços, na condução dos interesses da instituição e clientes, como ainda de assuntos e negócios pessoais e financeiros dos seus colaboradores. O Comitê de Conduta e Ética possui as seguintes responsabilidades:

- Deliberar, acompanhar e discutir as estratégias, políticas e medidas adotadas pelo Diretor de Compliance para difundir a cultura de conformidade e controles internos;

- Analisar e discutir efetivos e potenciais conflitos de interesse, assim como eventuais falhas nos controles internos;

- Discutir a exposição a riscos regulatórios e de imagem referentes a novos produtos, operações e clientes;

- Deliberar sobre a aplicação de sanções às violações do Código; e

- Acompanhar as atividades desenvolvidas pela área de Compliance.

Membros: O Comitê de Conduta e Ética será composto por todos os Diretores eleitos pela Assembleia Geral da Companhia.

Vigência: Indeterminado.

Frequência: Sempre que necessário.

Forma de Registro: Ata.

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

A Sociedade é administrada por 7 (sete) Diretores, acionistas ou não, residentes no país, sendo:

- Diretor de Administração Fiduciária: Sr. Marco Aurélio Russo,

- Diretor de Riscos e Controles Interno: Sra. Maria Eduarda de Gáspari Marin

- Diretora de Custódia: Sra Fabiane Bortolança Rosolem

- Diretora de Gestão: Sra. Elisângela Katia Capassi,

- Diretor de Escrituração: Sra Adriana Hernandez

- Diretor de Câmbio: Sr Marcos Henrique Russo

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
-----	------	-------	-----------	-------	---------------	------------------	---------------

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



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 (ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA)	866.650.148-00	MARCO AURELIO RUSSO	67	Administrador de Empresas	Diretor de Administração Fiduciária	02/03/2018	Até reunião de Sócios em 2024	Sócio-Administrador	- Bacharel em Administração de Empresas pela Fundação Armando Alvares Penteado - FAAP; - ABRACAM - Associação Brasileira das Corretoras de Câmbio, Cargo: Suplente de Diretoria, Período: 2014; - ABRACAM - Associação Brasileira das Corretoras de Câmbio, Cargo: Conselheiro Comitê Ética, Período: Abril de 2013 à Julho de 2014; - ABRACAM - Associação Brasileira das Corretoras de Câmbio, Cargo: Membro do Comitê de Negócios,	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

									geral dos negócios.	
8.5 (COMPLIANCE)	338.462.088-76	MARIA EDUARDA DEGÁSPARI MARIN	37	Matemática	Diretora de Riscos, Controles Internos e PLD	05/09/2022	Até reunião de Sócios em 2024	Plano de Continuidade de Negócios, Segurança da Informação	Formação acadêmica em Matemática pela UNESP - Universidade Estadual Paulista e Extensão em Gestão Financeira pela UNICAMP. Somado a isso, também possui certificação ABT2 ABRACAM, CPA-20 Anbima, além de ter participado de diversos treinamentos de Prevenção à Lavagem de Dinheiro, Compliance, Cadastro e Mercado de Câmbio, pela ABRACAM e GMS.	ABRACAM - ABT2 ANBIMA - CPA20



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

8.6 (GESTÃO DE RISCO)	338.462.088-76	MARIA EDUARDA DEGÁSPARI MARIN	37	Matemática	Diretora de Riscos, Controles Internos e PLD	05/09/2022	Até reunião de Sócios em 2024	Plano de Continuidade de Negócios, Segurança da Informação	Formação acadêmica em Matemática pela UNESP - Universidade Estadual Paulista e Extensão em Gestão Financeira pela UNICAMP. Somado a isso, também possui certificação ABT2 ABRACAM, CPA-20 Anbima, além de ter participado de diversos treinamentos de Prevenção à Lavagem de Dinheiro, Compliance, Cadastro e Mercado de Câmbio, pela ABRACAM e GMS.	ABRACAM - ABT2 ANBIMA - CPA20
--------------------------	----------------	-------------------------------	----	------------	--	------------	-------------------------------	--	--	-------------------------------



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

8.7 (DISTRIBUIÇÃO DE COTAS)	293.446.618-39	FABIAN E BORTOLANÇA ROSOLEM	39	Administradora	Diretora de Distribuição de cotas de Fundos de Investimento	05/09/2022	Até reunião de Sócios em 2024	Diretora de Custódia	Graduada em Ciências Contábeis pela Universidade Paulista - UNIP e em Administração, Habilitação em Finanças e Controladora pelo Centro Universitário Anhangueira - UNIFIAN. Possui Pós-Graduação em Administração Financeira e Controladora pelo Instituto Nacional de Pós-graduação - INPG, possui certificação CPA-20 Anbima e cursos de aperfeiçoamento no Mercado Financeiro ofertados pela ANBIMA	ANBIMA - CPA20
--------------------------------	----------------	-----------------------------	----	----------------	---	------------	-------------------------------	----------------------	---	----------------



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 (GESTÃO DE CARTEIRA)	272.815.368-01	ELISANGELA KATIA CAPASSI	45	Contadora	Diretora de Gestão	01/12/2021	Até reunião de Sócios em 2024	N/A	- Bacharel em Ciências Contábeis - Faculdade Integradas de Jau; - Pós Graduação em Mercado de Capitais - Universidade Presbiteriana Mackenzie; - Controles Internos aplicados às Entidades Fechadas de Previdência Complementar, Instituto de Desenvolvimento e Estudos Aplicados a Seguridade - IDEAS; - Seminário Plataformas Eletrônicas de Negociação - Abrapp - Anbima; - Workshops - Securitização - KPMG Auditores Independentes	Cotas do Plano de Benefícios - ANCEP - Associação Nacional dos Contabilistas das Entidades de Previdência; - Seminários Operacionais Estruturadas/Sistemas Bancário Brasileiro Abrapp/ICSS/Sindapp; - Governança Corporativa - Resolução CGPC nº 13/2004 - SPC - KPMG Auditores Independentes; - Risco de Mercado em Carteiras de Renda Fixa - ANBIMAs; - Títulos de Crédito (CRI - CRA - COTA DE FIDC - CCB - CCCB - CCI - CPR - CDCA - CDA - LH
-----------------------------	----------------	--------------------------	----	-----------	--------------------	------------	-------------------------------	-----	---	---



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

									ntes; - Seminário - Segregaçã o Contábil dos Planos de Benefício s	- LCI - LCA) - Uqbar; - WorkSho p - Fundos de Investime ntos Imobiliári os - Uqbar; - Seminário - Mercado de Capitais
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	---

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



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

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída



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

272.815.368-01	ELISANGELA KATIA CAPASSI	Petra Capital Gestora de Recursos Ltda	DIRETOR DE RECURSOS DE TERCEIROS	Diretora estatutária responsável pela Gestão das carteiras de ativos dos fundos (FIMs, FIPs, FIDCs e FIIs), volume aproximado de R\$ 5 bi. Acompanhamen to e monitoramento da carteira dos ativos, analise das suas estruturas e regulamentos visando: - cumprimento fiel do regulamento do fundo de investimento ou contrato previamente firmado com o cliente; - manter atualizada, em perfeita ordem e à disposição do cliente, na forma e prazos estabelecidos em suas regras internas e na regulação, toda a documentação relativa às operações com valores mobiliários integrantes das carteiras sob gestão. Monitorar os prestadores de serviços contratados pelos fundos. Analisar as operações que envolvem compra ou venda de ativos, suas estruturas, documentos que comprovem lastros e garantias, enquadramento	01/01/2018	01/09/2018
----------------	--------------------------------	--	--	---	------------	------------



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

				<p>e adequação a política de investimentos. Análise e monitoramento das operações de crédito alocadas nas carteiras dos fundos. Acompanhamento das disposições legais que envolvem a gestão discricionária dos fundos de investimentos junto aos órgãos competentes - CVM/Anbima. Apuração e acompanhamento das receitas/despesas dos fundos sob gestão. Acompanhamento de atividades de back office - liquidação de operações via sistema de liquidação e custódia (Cetip/Selic). Interface com administradores, consultores especializados, custodiantes e demais prestadores de serviços. Formalização das operações de crédito. Atendimento a investidores. Estruturação de novos produtos. Desenvolvimento de processos e monitoramento no que tange as atividades da instituição. Mapeamento de processos e adequação as políticas e normas da</p>		
--	--	--	--	--	--	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

				instituição.		
--	--	--	--	--------------	--	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

272.815.368-01	ELISANGELA KATIA CAPASSI	Foco DTVM	DIRETOR DE ADMINISTR AÇÃO FIDUCIARIA	Diretora estatutária responsável pela Administração Fiduciária dos fundos (FIs, FIPs, FIDCs e FIIs) e pelas informações perante os cotistas e órgãos reguladores. Estruturação, acompanhament o e monitoramento junto ao departamento jurídico da instituição da constituição dos fundos (FIMs, FIPs, FIDCs e FIIs) analisando suas estruturas e regulamentos visando o cumprimento fiel de seus regulamentos ou contrato previamente firmado com o cliente. Análise das operações que envolvem compra ou venda de ativos, suas estruturas, documentos que comprovem lastros e garantias, enquadramento e adequação a política de investimentos. Análise e monitoramento das operações de crédito alocadas nas carteiras dos fundos. Acompanhamen to das disposições legais que envolvem a gestão discricionária dos fundos de investimentos	01/12/2018	01/04/2019
----------------	--------------------------------	-----------	---	---	------------	------------



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

				<p>junto aos órgãos competentes - CVM/Anbima. Apuração e acompanhamento das receitas/despesas dos fundos sob administração. Análise e acompanhamento do desempenho da área. Gerência sobre a área de controladoria e custódia, revisão de processos e acompanhamento e gerência sobre toda a área operacional das atividades de administração, custódia e controladoria dos Fundos. Atendimento a investidores. Estruturação de novos produtos. Prospecção de novos clientes (gestores e investidores).</p>		
--	--	--	--	---	--	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

272.815.368-01	ELISANGELA KATIA CAPASSI	Munger Investimentos Ltda	DIRETOR DE RECURSOS DE TERCEIROS	Diretora estatutária responsável pela Gestão dos fundos (FIMs, FIPs, FIDCs e FIIs). Acompanhamen to e monitoramento da carteira dos ativos, analise das suas estruturas e regulamentos visando: - cumprimento fiel do regulamento do fundo de investimento ou contrato previamente firmado com o cliente; - manter atualizada, em perfeita ordem e à disposição do cliente, na forma e prazos estabelecidos em suas regras internas e na regulação, toda a documentação relativa às operações com valores mobiliários integrantes das carteiras sob gestão. Monitorar os prestadores de serviços contratados pelos fundos. Analisar as operações que envolvem compra ou venda de ativos, suas estruturas, documentos que comprovem lastros e garantias, enquadramento e adequação a política de investimentos. Análise e	01/10/2019	01/12/2019
----------------	--------------------------------	---------------------------------	--	---	------------	------------



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

				<p>monitoramento das operações de crédito alocadas nas carteiras dos fundos.</p> <p>Acompanhamento das disposições legais que envolvem a gestão discricionária dos fundos de investimentos junto aos órgãos competentes - CVM/Anbima.</p> <p>Apuração e acompanhamento das receitas/despesas dos fundos sob gestão.</p> <p>Acompanhamento de atividades de back office - liquidação de operações via sistema de liquidação e custódia (Cetip/Selic).</p> <p>Interface com administradores, consultores especializados, custodiantes e demais prestadores de serviços.</p> <p>Formalização das operações.</p> <p>Atendimento a investidores.</p> <p>Estruturação de novos produtos.</p> <p>Desenvolvimento de processos e monitoramento no que tange as atividades da instituição.</p> <p>Mapeamento de processos e adequação as políticas e normas da instituição.</p>		
--	--	--	--	--	--	--



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

272.815.368-01	ELISANGELA KATIA CAPASSI	LASTRO RDV DTVM	DIRETORA DE ADMINISTRA ÇÃO FIDUCIÁRIA	DIRETORA DE ADMINISTRA ÇÃO FIDUCIÁRIA	01/11/2020	01/12/2021
272.815.368-01	ELISANGELA KATIA CAPASSI	LASTRO RDV DTVM	DIRETORA DE GESTÃO	DIRETORA DE GESTÃO	01/12/2021	
293.446.618-39	FABIANE BORTOLANÇ A ROSOLEM	Lastro RDV DTVM Ltda	- Gerente Administrativa e Financeira (2018-2021): tesouraria, contas a pagar, conciliação bancária, operações de distribuição de títulos, operações de cessões - Analista de Controladoria de fundos (2021- 2022): registro e execução de informações e procedimentos referente a valores mobiliários, cotas e estoque. - Diretora de Custódia (2022- atual)	- Gerente Administrativa e Financeira (2018-2021): tesouraria, contas a pagar, conciliação bancária, operações de distribuição de títulos, operações de cessões - Analista de Controladoria de fundos (2021- 2022): registro e execução de informações e procedimentos referente a valores mobiliários, cotas e estoque. - Diretora de Custódia (2022- atual)	16/04/2018	
866.650.148-00	MARCO AURELIO RUSSO	LASTRO RDV DTVM	- DIRETOR DE GESTÃO - DIRETOR DE ADMINISTRA ÇÃO FIDUCIÁRIA	- DIRETOR DE GESTÃO - DIRETOR DE ADMINISTRA ÇÃO FIDUCIÁRIA	01/03/1993	



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

338.462.088-76	MARIA EDUARDA DEGÁSPARI MARIN	Lastro RDV DTVM Ltda	- Gerente Financeira e Backoffice (2014-2019): contas a pagar, tesouraria, conciliação bancária, backoffice câmbio - Gerente de Riscos, Controles Internos e PLD (2021-2022)/ Diretora de Riscos, Controles Internos e PLD (2022-atual): envio dos arquivos referente às obrigatoriedades do BCB e CVM, análises cadastrais no que diz respeito à PLD, Cabine CCS/JUD para verificação de indisponibilidade e de bens e requisições judiciais, atualização de políticas e manuais, etc.	- Gerente Financeira e Backoffice (2014-2019): contas a pagar, tesouraria, conciliação bancária, backoffice câmbio - Gerente de Riscos, Controles Internos e PLD (2021-2022)/ Diretora de Riscos, Controles Internos e PLD (2022-atual): envio dos arquivos referente às obrigatoriedades do BCB e CVM, análises cadastrais no que diz respeito à PLD, Cabine CCS/JUD para verificação de indisponibilidade e de bens e requisições judiciais, atualização de políticas e manuais, etc.	01/12/2014	
----------------	--	-------------------------	--	--	------------	--

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

A LASTRO possui uma área de Gestão de Recursos de Terceiros composta por 1 (um) Diretor e 1 (um) analista. As áreas de apoio (jurídico, TI, Risco e Compliance) fazem parte da Estrutura da DTVM como um todo e englobam outras áreas da instituição. Atualmente a Lastro não possui fundos sob gestão.

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

A análise de ativos será realizada com base em métodos quantitativos de acordo com as informações públicas sobre as cotações e movimentações do mercado sobre os ativos. As rotinas e procedimentos serão: obtenção de informações cadastrais, análise setorial, análise econômico-financeira, que consistem em análise das demonstrações financeiras, projeção de fluxo de caixa das empresas, análise do múltiplo EV/EBTIDA de outras empresas do setor, bem como a estrutura de capitais. Adicionalmente, será realizada a análise de Valuation elaborado por terceiros.



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

8.9. 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

3

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A LASTRO possui uma área de Controles Internos composta por 1 (um) Diretor, 1 (um) gerente e 1 (um) assistente, responsáveis por verificar o atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade.

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

A Sociedade conta com auditoria de controles internos realizada por empresa contratada para a avaliação da qualidade e adequação do sistema de controles internos, bem como o cumprimento de dispositivos legais e regulamentares. Compete à área de Controles Internos desenvolver processos para identificar, medir, monitorar e controlar riscos inerentes ao mercado de capitais e financeiros; implantar políticas adequadas de controles internos; e estabelecer uma cultura na organização que enfatize e demonstre, em todos os níveis hierárquicos, a importância desses controles. A área de Controles Internos é a responsável por verificar a adequação das políticas internas às normas legais aplicáveis, bem como por fiscalizar a aplicação destas políticas pelas áreas internas da Sociedade. O sistema de controles internos é composto por programas de pesquisas, além de sistemas em planilha (matriz de risco) para manutenção dos dados. A LASTRO, em relação ao seu programa de prevenção à lavagem de dinheiro, adquiriu licença do software E-Guardian, que realiza pesquisas em listas restritivas no âmbito nacional e internacional, de pessoas físicas e jurídicas. Além disso, adquiriu também a licença do sistema de verificação de Dossiê Reputacional Cedro Technologies.

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

O departamento de Controles Internos e Compliance atua de forma independente, sendo subordinado somente ao diretor de Controles Internos da LASTRO. Todos os documentos e arquivos são armazenados em um diretório específico, com acesso permitido somente aos colaboradores da área. Os demais colaboradores do Grupo não possuem acesso ao referido diretório. Não é admitida sob nenhuma forma, qualquer interferência comercial na área de Controles Internos.

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

a. Quantidade de profissionais *

3

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A LASTRO possui uma área de Gestão de Riscos composta por 1 (um) Diretor, 1 (um) Gerente e 1 (um) assistente, responsáveis por verificar o atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade.

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



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

Lastro conta com auditoria de controles internos realizada por auditor terceiro contratado para a avaliação da qualidade e a adequação do sistema de controles internos e de descumprimentos de dispositivos legais e regulamentares.

Complementarmente, o tratamento do risco operacional é quantitativamente monitorado com base no número de erros operacionais registrados, a probabilidade de ocorrência e o valor de impacto detectado para todas as áreas da Lastro. A partir do mapeamento dos processos, inicia-se a apuração de dados qualitativos, dentre eles, número de clientes, volume de operações, frequência, tempo para execução e seus impactos (impacto financeiro, imagem, legal e outros). O resultado da conjugação destes diversos fatores especificará os níveis de risco operacional para o período analisado. O processo de gestão de riscos operacionais ocorre nas seguintes etapas: mapeamento de processos; identificação dos controles e plano de ação; monitoramento dos controles do plano de ação. A gestão de riscos de mercado e liquidez é feita através dos sistemas: Atlas/MARKET RISK: tem como objetivo a gestão de risco de mercado dos portfólios de investimento.

Atlas/LIQUID RISK: destinado para o cômputo de métricas de liquidez, concentração e estresse de fundos de investimento sem a explosão de cotas de fundos, que aplica em ativos domésticos.

A gestão de risco de crédito, mercado e operacional é feita pelo sistema Risk Driver. O software contém ferramentas de gestão, medição, monitoramento e controle de riscos, atendendo todos os requisitos regulatórios.

Já o sistema For Capital gerencia o capital, considerando o momento atual e projetando uma visão do negócio de médio a longo prazo, resultando num diagnóstico da situação econômico financeira, garantindo que os gestores possuam total controle da alocação de capital, podendo tomar decisões estratégicas e se preparar para possíveis desafios futuros.

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

As atividades de monitoramento de risco são realizadas de forma independente, sem qualquer interferência das áreas de negócios, de gestão ou de administração fiduciária. As tarefas de monitoramento são executadas preferencialmente por meio de modelos matemáticos ou estatísticos de forma a minimizar qualquer impacto operacional.

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

3

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



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

A área de controle e processamento de ativos possui 1 (um) diretor responsável e 2 analistas, sendo responsáveis pela verificação e validação das informações de passivo dos fundos e registro de titularidade das cotas. A Lastro contratou o serviço de processamento de fundos e carteiras (ativo e passivo) da Britech, o BPO (Business Process Outsourcing) cujas principais funções resumidamente, são: valorização diária de fundos de investimentos e carteiras administradas, bem como o cálculo do respectivo valor de cota, através de informações fornecidas pelo Cliente e por agentes de mercado, inclusive a preparação de relatórios periódicos referentes a posição patrimonial dos portfólios, contendo; (i) todos os ativos que compõem os portfólios; (ii) sua quantidade e valor; (iii) fluxo de caixa contendo contas a pagar e a receber; (iv) posição atualizada de ativo e passivo; registro e a manutenção de titularidade de ativos e cotas; controle das posições individualizadas e histórico das movimentações do(s) cotista(s) do(s) fundo(s); controle dos eventos; apuração de tributos do(s) cotista(s) dos fundos; e averbação de gravames que incidam sobre as cotas, quando aplicável.

A área de liquidação é composta por 01 analista, o qual é responsável pelo tratamento das instruções de movimentação recebidas dos gestores e/ou demais pessoas autorizadas legitimadas por contrato ou mandato, sempre verificando a origem das instruções recebidas.

Os sistemas utilizados nas rotinas acima destacadas são:

ATLAS/PAS: Sistema responsável pelo controle de ativos/passivos bem como o cálculo do Patrimônio e o valor da cota dos Fundos.

ATLAS/TAS: Sistema responsável pelo controle, verificação e atualização das informações de cotistas dos Fundos.

ATLAS BPO - (BusinessProcessOutsourcing)

O serviço proposto consiste na valorização diária de fundos de investimentos e carteiras administradas, bem como o cálculo do respectivo valor de cota, através de informações fornecidas pelo Cliente e por agentes de mercado, inclusive a preparação de relatórios periódicos referentes a posição patrimonial dos portfólios, contendo: (i) todos os ativos que compõem os portfólios; (ii) sua quantidade e valor; (iii) fluxo de caixa contendo contas a pagar e a receber; (iv) posição atualizada de ativo e passivo.

BRITECH REC: Sistema estruturado de forma a atender as principais áreas funcionais de recebimento de recebíveis.

Principais funções:

- Importação dos arquivos de Remessa;
- Importação dos arquivos de Cobrança;
- Regras de Enquadramento;
- Fechamento dos Fundos;
- Operações Retroativas;
- Provisão para Devedores Duvidosos (PDD);
- Exportação dos arquivos de retorno de Remessa;
- Exportação do arquivo para integração com o sistema de Ativos;
- Conciliação;
- Controle de estoque;
- Posição e Movimento do Fundo;
- Evolução do Fundo;
- Parametrizações para Baixas Automáticas;
- Parametrizações para Baixas Manuais;
- Parametrizações de Layout por tipo de Movimento.

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

O Diretor responsável pelas atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos é a Sra. Fabiane Bortolança Rosolem.

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

a. Quantidade de profissionais

1

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A LASTRO possui uma área de Distribuição de Cotas de Fundos composta por 1 (um) Diretor. As áreas de apoio (jurídico, TI, Risco e Compliance) fazem parte da Estrutura da DTVM como um todo e englobam outras áreas da instituição. Atualmente a Lastro não faz Distribuição de Cotas de Fundos.

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



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

Não se aplica

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

Não se aplica

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

Não se aplica

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

Não existem demais informações que a empresa julgue relevante

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:

Administração Fiduciária: Taxa de administração baseada em percentual sobre o patrimônio líquido do fundo, quando superior à remuneração mínima estabelecida em contrato, sempre que aplicável.

A tabela a seguir é um indicativo das faixas de valores ou percentuais que serão cobrados pela prestação de serviços:

% Mínimo: 0,10% a.a. sob PL do Fundo.

% Máximo: 0,50% a.a. sob PL do Fundo.

Ou

Valor Mínimo: R\$ 10.000,00 mensais.

Gestão: Taxa de gestão baseada em percentual sobre o patrimônio líquido do fundo, quando superior à remuneração mínima estabelecida em contrato, sempre que aplicável.

A tabela a seguir é um indicativo das faixas de valores ou percentuais que serão cobrados pela prestação de serviços:

% Mínimo: 0,15% a.a. sob PL do Fundo.

% Máximo: 1,00% a.a. sob PL do Fundo.

Ou

Valor Mínimo: R\$ 15.000,00 mensais.

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 (%):

43,26

b. Taxa de performance (%):

0,00

c. Taxa de ingresso (%):

0,00

d. Taxa de saída (%):

0,00

e. Outras taxas (%):

56,74



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

Total (%):

100,00

9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:

Obs: o campo "e. Outras taxas" refere-se às receitas provenientes das taxas cobradas na atividade de câmbio.

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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

A LASTRO possui uma Política de Contratação de Prestadores de Serviços para Fundos de Investimento, a fim de estabelecer, de forma clara e transparente, as regras e procedimentos internos a serem observados no processo de seleção e contratação de empresas para a prestação de serviços aos fundos, permitindo a avaliação da capacidade destes prestadores de serviços no cumprimento das normas legais e da regulação de melhores práticas, conforme aplicáveis. O processo de aprovação dos prestadores de serviço inclui: (a) a realização prévia de processo de due diligence nos terceiros a serem contratados; e (b) o recebimento de questionário de due diligence preenchido pela instituição a ser contratada, com resposta enviada à LASTRO para análise e aprovação, especialmente para gestores e consultores.

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

A Sociedade sempre contratará corretoras de primeira linha, identificando dentre as mais bem posicionadas, preferencialmente àquela que oferece o menor custo.

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

A Sociedade possui um código de ética que aborda a questão de soft dollar, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens, etc. A empresa opõe-se que seus colaboradores, diretamente ou através de terceiros, ofereçam ou aceitem dinheiro, cheque (independente do valor) substâncias ilegais, brindes, viagens, gratificações ou presentes que possam indicar qualquer tipo de favorecimento à empresa ou ao indivíduo, e que possam afetar as decisões nas negociações.

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



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

A LASTRO possui um plano de continuidade dos negócios ("PCN") para garantir a sustentabilidade de seus negócios essenciais, mesmo em situações adversas, utilizando-se dos serviços de Data Center e de hospedagem contratados junto à RTM. O PCN contempla o gerenciamento da recuperação dos negócios em caso de interrupção, e gestão por meio de treinamentos, testes, revisões e manutenções, a fim de garantir que o plano de continuidade de negócios esteja atualizado e operacional. Para fins do PCN, são consideradas situações de emergência:

Prédio inacessível,

- Datacenter inacessível,
- Instalação inacessível,
- Interrupção por falha de energia elétrica,
- Interrupção por falha de comunicação,
- Interrupção por falha de servidor,
- Interrupção por falha na rede interna,
- Interrupção por falha do software aplicativo.

PLANO DE PREVENÇÃO, RESPOSTA E RECUPERAÇÃO

Grupo de Trabalho GT Contingência

É formado pelas seguintes pessoas:

Diretor Compliance;

Gestor de Tecnologia;

As atribuições do Coordenado do GT são:

- Receber informações sobre situações que possam afetar o funcionamento da instituição;
- Avaliar a criticidade e determinar providências para iniciar operações em situação de contingência;
- Acompanhar as providências de correção das falhas;
- Determinar o fim da contingência e acompanhar as providências de recuperação para o retorno à normalidade;
- Aprovar e fazer cumprir o calendário de treinamento e testes; e
- Avaliar o resultado das ações de contingência, propondo correções e melhorias no PCN.

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

De acordo com as diretrizes de negócio da instituição, os fundos que serão administrados pela LASTRO serão quase em sua totalidade fundos de investimento constituídos sob a forma de condomínio fechado, destinados a um único cotista ou grupos bastante restritos de cotistas. A política de liquidez da LASTRO leva em consideração as características específicas dos fundos administrados pela instituição, os quais não apresentam grande pulverização de ativos, tampouco de cotistas, bem como, considera o fato de que o mercado secundário de determinados ativos, são avaliados apenas mensalmente. A Instituição considera o gerenciamento de riscos como um processo dinâmico, contínuo e interativo, que assume duas formas distintas, porém intimamente relacionadas: risco de liquidez de ativos ou de mercado e risco de liquidez de funding ou de fluxo de caixa. Por meio de análise semanal da liquidez das carteiras dos fundos é possível mensurar o risco decorrente da falta de contrapartes em número suficiente ou do interesse do mercado em negociar a quantidade desejada de uma posição, de forma a evitar ou minimizar a volatilidade anormal o seu preço.

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



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

A instituição possui diretrizes internas para verificação e cadastro de investidores, alinhadas às exigências regulatórias sobre o tema, possibilitando assim, a adequada captura, atualização e armazenamento das informações cadastrais dos investidores que aplicam em cotas de fundos administrados pela LASTRO. O cadastro do cotista passa obrigatoriamente por dois processos durante o período em que o mesmo mantiver relacionamento com a LASTRO, sendo: - Inclusão Cadastral; - Atualização Cadastral / Renovação Cadastral, em prazo não superior a 24 (vinte e quatro) meses.

O aporte no(s) Fundo(s) é permitido somente após o recebimento da documentação completa e após análise e aprovação da Área de Compliance. A Sociedade mantém um Programa de Prevenção e Combate à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento ao Terrorismo composto por políticas, processos treinamentos e sistemas específicos para prevenir e/ou detectar a utilização de sua estrutura, produtos e serviços à lavagem de dinheiro e ao financiamento ao terrorismo, conforme segue:

A) A Política Conheça seu Cliente tem como diretrizes básicas:

1. Assegurar a conformidade com a legislação, normas e regulamentos que disciplinam a prevenção e o combate à lavagem de dinheiro e ao financiamento ao terrorismo;
2. Identificar e designar, de modo claro, as responsabilidades e atribuições em todos os níveis;
3. Estabelecer processos e procedimentos visando a desenvolver e promover programas de treinamento e de conscientização do quadro de colaboradores, relacionados à prevenção e combate à lavagem de dinheiro e ao financiamento ao terrorismo;
4. Assegurar que os critérios de conduta ética, profissional e de boa fé estejam sendo observados no tratamento de questões desta natureza.

B) O procedimento de Cadastro contempla as seguintes diretrizes básicas:

1. Garantir que as informações obtidas dos clientes possibilitem relacionamento eficaz com a oferta de produtos e serviços adequados ao seu perfil, conforme diretrizes de Suitability e das demais políticas da instituição,
2. Assegurar que as informações sobre os clientes sejam coletadas e registradas tempestivamente, de forma a permitir a identificação dos riscos de ocorrências relacionadas direta ou indiretamente à lavagem de dinheiro e ao financiamento ao terrorismo.

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.lastro.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 *

Nada a declarar

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Nada a declarar

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

Nada a declarar

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Nada a declarar



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

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

Nada a declarar

11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas no últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que tenha figurado no polo passivo, indicando:

a. Principais fatos

Nada a declarar

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Nada a declarar

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

Nada a declarar

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Nada a declarar

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: 31/03/2023 - 07:25:00

Data de impressão: 25/03/2024

Hora de impressão: 14:02:18