



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 19.005.052/0001-89

Nome do Administrador de Carteira: ATENA CAPITAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Ano de competência: 2023

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A Atena Capital foi constituída em outubro de 2013, no estado e cidade de São Paulo, para fins de gestão profissional de recursos de terceiros e, conta data-base de 31/12/2023, com R\$ 499.132.617,71 sob gestão em fundos no mercado local, e R\$ 35.315.506,10 em um portfólio no exterior, gerindo uma carteira administrada, devidamente registrada em sua jurisdição, totalizando R\$ 534.448.123,81 sob gestão.

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

Não há.

b. Escopo das atividades

Não há.

c. Recursos humanos e computacionais

2024: Desligamento da sócia e Diretora de Compliance, Risco e PLD, Sra. Debora Pasternak, bem como nomeação da atual Diretora de Compliance, Risco e PLD, Sra. Mariana Cabral Malheiro.

2024: Desligamento do sócio e Head de análise, Sr. Felipe Saturino Ikeda Pereira e da sócia Fernanda Pescarin Chamma.

2023: Ingresso do Diretor Comercial, Sr. Paulo Cintra Castilho.

No que se refere aos recursos computacionais, vale indicar que houve alteração do endereço da sede da Sociedade em 2024, contando a gestora com a seguinte infraestrutura tecnológica:

15 computadores;

01 impressora;

Internet: infraestrutura base (Firewall, Switches e Links de Internet), é propriedade do coworking Regus, seguindo os termos contratuais.

Backup: Todos os arquivos são objeto de Backup diariamente às 20:00h.

Este tipo de backup faz com que possamos restaurar os arquivos em outro tenant na MSFT.

O Modelo de armazenamento é Nuvem e a política de retenção de até 90 dias.

Além do Backup em Nuvem, temos o recurso de proteção contra sincronização de arquivos criptografados por software malicioso.

Bloomberg com acesso individual, garantindo que a aplicação fique protegida com as medidas de cada computador.

d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos

A Área de Riscos e Compliance é responsável pela confecção, atualização e implementação das políticas da Atena Capital. Todas as Políticas são revisadas anualmente, garantindo assim, a aderência às normas dos reguladores, leis, bem como as melhores práticas de mercado.

3. Recursos Humanos

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

a. Número de sócios:

10



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 empregados:

4

c. Número de terceirizados:

0

CPF	Nome
301.629.078-26	LIGIA MARIA PORCHAT DE ASSIS

4. Auditores

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

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

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

5. Resiliência Financeira

5.1. Com base nas demonstrações financeiras, ateste:

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

Sim

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

Sim

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

Demonstração Financeira: Não se aplica

Relatório: Não se aplica

6. Escopo das Atividades

6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo



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

Gestão discricionária de fundos de investimentos e carteiras administradas.

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.)

Fundo de Investimento de Renda Fixa Crédito Privado, Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimentos de Renda Fixa Crédito Privado, Fundo de Investimento em Ações, Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Ações, Fundo de Investimento Previdenciário em Cotas de Fundos de Investimentos de Renda Fixa Crédito Privado, Fundo de Investimento Previdenciário de Renda Fixa Crédito Privado e Carteiras administradas no exterior para residentes de outras jurisdições.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Fundos de Investimentos, Títulos Públicos, Títulos Privados, FIDC's, Ações e Derivativos).

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

Não se aplica, na medida em que a Sociedade atua exclusivamente na gestão profissional de recursos de terceiros.

b. Informações sobre as atividades exercidas por sociedades controladoras, controladas, coligadas e sob controle comum ao administrador e os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades

Não se aplica. A Atena Capital não possui sociedades controladores, controladas, coligadas e sob controle comum.

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	2562	0	2562



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	64	0	64
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	3	0	3
iii. Instituições Financeiras	0		0
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0		0
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	0		0
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	0	0	0
vii. Seguradoras	0		0
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	0		0
ix. Clubes de Investimento	0	0	0
x. Fundos de Investimento	1		1
xi. Investidores não Residentes	0		0

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
PCO	2494	0	2494

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	2562	0	2562

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 483.303.886,55	R\$ 0,00	R\$ 483.303.886,55

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

R\$ 35.315.506,10

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\$ 95.659.883,00	
R\$ 82.919.808,00	
R\$ 28.483.646,00	
R\$ 18.978.304,00	
R\$ 5.441.937,00	
R\$ 5.210.809,00	
R\$ 4.647.531,00	
R\$ 4.104.124,00	
R\$ 3.820.920,00	
R\$ 3.774.894,00	

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\$ 84.915.505,87	R\$ 0,00	R\$ 84.915.505,87
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 1.859.170,76	R\$ 0,00	R\$ 1.859.170,76
iii. Instituições Financeiras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
vii. Seguradoras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	R\$ 0,00		R\$ 0,00
ix. Clubes de Investimento	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
x. Fundos de Investimento	R\$ 733.305,20		R\$ 733.305,20
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
PCO	R\$ 395.795.904,72	R\$ 0,00	R\$ 395.795.904,72

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 483.303.886,55	R\$ 0,00	R\$ 483.303.886,55

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\$ 5.360.162,05
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R\$ 229.226.556,13
c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R\$ 54.721.222,06
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\$ 51.276.605,14
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 8.967.381,35
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 55.566.369,27
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 0,00
k. Outros valores mobiliários	R\$ 0,00
l. Títulos públicos	R\$ 146.034.665,79
m. Outros ativos	R\$ 18.077.419,88
Total	R\$ 569.230.381,67

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

Não aplicável

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não há.

7. Grupo Econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
301.629.078-26	LIGIA MARIA PORCHAT DE ASSIS

b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
-	Não Informado

c. Participações da empresa em sociedade do grupo

CNPJ	Nome
-	Não Informado

d. Participações de sociedades do grupo na empresa

CNPJ	Nome
-	Não Informado

e. Sociedades sob controle comum



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

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

Diretoria de Gestão: responsável pela análise e aquisição e seleção dos ativos que irão compor as carteiras dos fundos geridos, observando sempre os regulamentos dos fundos e a regulamentação vigente.

Diretoria de Compliance, PLD e Riscos: responsável por confeccionar, cumprir e fazer cumprir as políticas internas da empresa e a regulamentação vigente aplicável, identificar, mensurar e monitorar os riscos das carteiras, bem como coordenar os procedimentos de prevenção de lavagem de dinheiro.

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

Comitê de Investimentos: reúne-se mensalmente ou com maior frequência, quando necessário. O Comitê é composto, no mínimo, pela Diretora de Gestão, um membro da Equipe de Risco e um Analista de Investimentos, sendo as decisões tomadas consensualmente, tendo a Diretora de Risco poder de veto da operação. O Comitê poderá contar ainda com a participação de membros convidados, tais como assessores jurídicos ou consultores externos, cuja atuação será limitada a comentários e considerações, sem qualquer poder de voto.

As deliberações são registradas de forma sumária em ata, ficando estas e a documentação que as fundamentou arquivadas em pasta própria.

Comitê de Risco e Monitoramento: identificação, monitoramento, acompanhamento e mitigação de possíveis riscos aos quais as carteiras encontram-se expostas, em especial: (i) análise e revisão do consumo de risco de mercado e liquidez dos fundos sob gestão no período; (ii) definição ou alteração de limites de risco para os fundos sob gestão; (iii) discussão sobre ações de enquadramento realizadas no período e seus resultados; (iv) revisão de temas relacionados aos controles internos e risco operacional. Reúne-se trimestralmente, ou em períodos menores, em caráter extraordinário. O Comitê é composto, no mínimo, pela Diretora de Risco e pela Diretora de Gestão, sendo as decisões tomadas pela maioria dos presentes. O Comitê poderá contar ainda com a participação de membros convidados, tais como assessores jurídicos ou consultores externos, cuja atuação será limitada a comentários e considerações, sem qualquer poder de voto.

As atas das reuniões e documentos utilizados pelo Comitê para deliberação são arquivadas.

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

Sócia e Diretora de Gestão: Lígia Maria Porchat de Assis

Diretora de Riscos, PLD e Compliance: Mariana Cabral Malheiro

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:



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	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos
301.629.078-26	LIGIA MARIA PORCHAT DE ASSIS	42	Engenheira	Diretora de Gestão	24/09/2013	Indeterminado	Membro do Comitê de Investimentos e do Comitê de Risco e Monitoramento.
297.583.378-40	MARIANA CABRAL MALHEIRO	40	Administradora de Empresas	Diretora de Compliance, Risco e PLD	15/01/2024	Indeterminado	Membro do Comitê de Risco e Monitoramento.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	301.629.078-26	LIGIA MARIA PORCHAT DE ASSIS	42	Engenheira	Diretora de Gestão	24/09/2013	Indeterminado		Curso: Engenharia Civil Instituição: Universidade de São Paulo (POLI) e University of Applied Sciences - Gießen, Alemanha Data da conclusão: Dezembro/2006	CFG ANBIMA CGA ANBIMA CGE ANBIMA CFA
8.5 (COMPLIANCE)	280.531.628-27	MARIANA CABRAL MALHEIRO	40	Administradora de Empresas	Diretora de Compliance, Risco e PLD	15/01/2014	Indeterminado		Curso: Administradora de Empresas Instituição: Universidade Cidade de São Paulo Data da conclusão: Dezembro/2012	CPA20
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	280.531.628-27	MARIANA CABRAL MALHEIRO	40	Administradora de Empresas	Diretora de Compliance, Risco e PLD	15/01/2014	Indeterminado		Curso: Administradora de Empresas Instituição: Universidade Cidade de São Paulo Data da conclusão: Dezembro/2012	CPA20

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
301.629.078-26	LIGIA MARIA PORCHAT DE ASSIS	Atena Capital Gestão de Recursos Ltda.	Diretora de Gestão	Gestão profissional de recursos de terceiros.	24/09/2013	
280.531.628-27	MARIANA CABRAL MALHEIRO	Atena Capital Gestão de Recursos Ltda	Head de Operações	Head de Operações	01/06/2021	15/01/2024
280.531.628-27	MARIANA CABRAL MALHEIRO	Lerosa Investimentos	Middle Office/Backoffice	Middle Office/Backoffice	03/01/2011	01/05/2020
280.531.628-27	MARIANA CABRAL MALHEIRO	Atena Capital Gestão de Recursos Ltda	Diretora de Risco, compliance e PLD	Diretora de Risco, compliance e PLD	15/01/2024	

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

a. Quantidade de profissionais

8

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Análise de títulos e valores mobiliários disponíveis no mercado, subsidiando a tomada de decisão pela Diretora de Gestão.

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

A Sociedade utiliza os sistemas Bloomberg e Broadcast como ferramentas de apoio na Gestão.

A tomada de decisão é criteriosa e fundamentalista, passando por cinco fases:

FASE I: "Pesquisa/Fonte". A equipe de gestão utiliza planilhas chamadas security-screen criadas internamente. Os critérios para seleção dos ativos são colocados e definidos pela equipe de gestão. Exemplos de critérios: múltiplos de mercado (P/L), indicadores de alavancagem, pagamento de dividendos, ratings de Agência de Risco etc. O processo de investimento é o chamado análise bottom-up.

FASE II: "Seleção". Com base nas planilhas acima mencionadas, surgem os ativos 'vencedores', ou seja, ativos que passaram por uma série de critérios e que serão analisados com mais profundidade.

FASE III: "Análise Aprofundada". Os ativos acima selecionados serão estudados de maneira mais customizada e criteriosa. Exemplo: Na análise de uma determinada ação (empresa), faz-se o estudo aprofundado do Balanço Patrimonial, Demonstrações Financeiras e Fluxo de Caixa, criando um modelo proprietário (em excel) com as projeções financeiras da companhia. Além disso, a equipe interna da companhia entra em contato com a empresa-alvo através de reuniões presenciais, assim como acompanha os resultados trimestrais (teleconferências). Realização de um comitê de investimentos qualitativo para discussão e entendimento do modelo de negócios antes do comitê quantitativo seguido da decisão do investimento.

FASE IV: "Aprovação/Execução. Ao decidir pela inclusão de determinado ativo - respeitando o mandato e o regulamento dos fundos sob gestão - é determinado o percentual da alocação, considerando a relação risco/retorno do ativo nas carteiras. Todas as decisões são tomadas pela Diretora de Gestão em linha com os alinhamentos feitos nos Comitês de Investimentos e registradas em ata.

FASE V: "Monitoramento". É dinâmica, ou seja, acontece de maneira contínua e diária. Para o auxílio no monitoramento das posições, são utilizadas planilhas criadas internamente, baseadas em critérios diversos, tais como: atingimento de preço-alvo, relação futura Preço/Lucro específica, entre outros. Existe uma revisão periódica realizada no Comitê de Riscos, anualmente ou sob demanda.



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

2

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

1 (uma) diretora responsável por Riscos e Compliance

1 (um) analista de Risco

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

Elaboração, atualização e coordenação da implementação dos procedimentos internos; acompanhamento e fornecimento de informações periódicas e eventuais solicitadas à Sociedade por órgãos reguladores e autorreguladores, bem como parceiros em processos de due diligence; monitoramento dos procedimentos de segurança da informação; verificação da conduta dos colaboradores em relação à confidencialidade das informações e princípios éticos.

São utilizadas planilhas proprietárias desenvolvidas em Excel, notadamente a Agenda de Compliance com mapeamento das obrigações regulatórias e autorregulatórias.

Todas as rotinas e procedimentos de Compliance constam expressamente do Manual de Compliance.

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

A Diretora de Compliance, Risco e PLD possui autonomia no exercício de suas atividades, possuindo poder de veto em relação à tomada de decisão em sua área, não havendo qualquer subordinação à equipe de gestão de recursos

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

a. Quantidade de profissionais *

2

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

1 (uma) diretora responsável por Riscos e Compliance

1 (um) analista de Risco, Compliance e PLD.

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

Bloomberg, bem como modelos proprietários de risco.

A área de Risco envia diariamente para a equipe de Gestão relatórios que auxiliam no controle e na tomada de decisão. Os relatórios de risco são elaborados por carteira sob administração e são compostos pelas seguintes informações:

Rentabilidade acumulada da cota do fundo e do benchmark e comparativo mês a mês;

Alocação da carteira por ativo de renda variável;

Cálculo de Liquidez de 50%, 80% e 100% da carteira em dias úteis;

Análise de Liquidez de Ativos x Passivos dos fundos em percentual do PL; também utilizamos como balizador a matriz de probabilidade da Anbima

Dispersão de cotas do Passivo;

Atribuição de Performance (dia, mês, ano e desde o início do fundo);

VaR diário com 99% de intervalo de confiança;

Volatilidade anualizada para 22, 126 e 252 dias úteis;

Dados Estatísticos (max drawn up, max drawn down, média móvel das rentabilidades de 3, 6 e 12 meses, rentabilidade máxima e mínima nos mesmos intervalos);

Índices (Ibovespa, CDI, PTAX, etc)

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

A Diretora de Compliance, Risco e PLD possui autonomia no exercício de suas atividades, possuindo poder de veto em relação à tomada de decisão em sua área, não havendo qualquer subordinação à equipe de gestão de recursos.

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

a. Quantidade de profissionais

0

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

Não aplicável.

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

Não aplicável.

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

a. Quantidade de profissionais

0

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Não aplicável.

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 aplicável.

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

Não aplicável.

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

Não aplicável.

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

Não aplicável.

9. Remuneração da Empresa

9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 2.1. do anexo 15-I, indicar as principais formas de remuneração que pratica:

A principal forma de remuneração da Atena Capital é a taxa de administração dos fundos.

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 (%):

92,20

b. Taxa de performance (%):

7,80

c. Taxa de ingresso (%):

0,00

d. Taxa de saída (%):

0,00

e. Outras taxas (%):

0,00

Total (%):

100,00

9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:

Não aplicável

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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



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

No âmbito da sua atividade de gestão de recursos e em nome dos veículos de investimento sob sua gestão, os únicos prestadores de serviços objeto da Política são as corretoras de títulos e valores mobiliários.

A seleção e contratação é um processo conduzido de forma conjunta pela Diretoria, em linha com a Política de Seleção e Contratação de Prestadores de Serviços da Sociedade.

Após a contratação, a Sociedade realizará o monitoramento contínuo das atividades exercidas pelos Terceiros contratados, até o término do prazo da contratação. O monitoramento será de responsabilidade da Diretora de Compliance, Risco e PLD.

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

O custodiante dos fundos monitora se os valores pagos em cada operação correspondem aos percentuais de evolução de corretagens cadastrados e definidos nos contratos. Além disso a área de Compliance e Riscos faz a conferência da nota de corretagem e armazena através de planilha os valores pagos para cada corretora.

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

O eventual recebimento de serviços adicionais não será fator determinante no processo de seleção de corretoras de títulos e valores mobiliários. Qualquer vantagem neste sentido será utilizada em benefício das carteiras administradas pela Sociedade, sendo outorgada ampla transparência ao investidor sobre os serviços adicionais eventualmente recebidos.

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

O plano de continuidade de negócios consiste na manutenção de equipamentos em um ambiente alternativo capazes de processar e realizar as operações em situações de contingência. Com isto, a equipe de gestão está apta a acessar os dados e informações armazenadas, através de local diverso de sua sede que permite a ativação e continuidade do processamento de suas atividades.

O plano de recuperação de desastres visa a restauração das funcionalidades afetadas que suportam o processo de tomada de decisões de investimentos, a fim de restabelecer o ambiente e suas condições originais de operação, no menor tempo possível. Com o modelo de nuvem integrada, a recuperação torna-se imediata.

Após o retorno à normalidade, na tentativa de evitar incidentes da mesma qualidade, será elaborado um perfil completo da crise, apontando suas razões, percentual do sistema afetado, tempo de indisponibilidade e seus impactos financeiros.

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

A Sociedade adota Política de Gestão de Riscos de Liquidez, conforme disponível em seu site. De forma resumida, segue a metodologia adotada:

Ativos dos Fundos: o cálculo do tempo para liquidação dos ativos considera o seu volume negociado diariamente, de acordo com informações providas pela B3 e pela ANBIMA. O tempo (em dias) para liquidação corresponderá ao volume existente na carteira dividido por 20% do volume médio negociado nos últimos 3 meses para ativos "à vista", opções e futuros, acrescido do tempo entre a operação e efetivo crédito financeiro (haircut).

Passivos do Fundo: o passivo dos fundos é avaliado das seguintes formas:

a) Grau de dispersão da propriedade das cotas: é segregado em dois segmentos: (i) maior cotista; e (ii) 10 maiores cotistas. Ademais, o passivo é classificado em categorias em função da expectativa de resgate, incluindo o grau de concentração de alocadores, distribuidores e/ou outros gestores, permitindo a verificação da dispersão da propriedade das cotas e acompanhamento do risco de liquidez.

b) Histórico de resgates: são utilizados três métricas para resgates históricos: (i) 1 (um), 2 (dois), 3 (três), 4 (quatro), 5 (cinco), 21 (vinte e um), 42 (quarenta e dois), 63 (sessenta e três) dias úteis; (ii) 99º percentil dos resgates diários; (iii) e maior resgate histórico (excluindo capital interno) nos últimos 252 dias úteis.

c) Prazo para liquidação de resgates;

d) Matriz de Probabilidade de Resgate divulgada pela ANBIMA mensalmente.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

10.6. 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

Não aplicável.

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.atenacapital.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 *

Não aplicável.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável.

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

Não aplicável.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável.

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

Suporte Jurídico para apoio nas análises de crédito privado.

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

Não aplicável.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável.



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

11.5. 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

Não aplicável.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável.

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

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

Marcado

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

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

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: 27/03/2024 - 14:31:00

Data de impressão: 03/04/2024

Hora de impressão: 16:52:11