FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA DA
BAHIA AM RENDA FIXA LTDA.

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2021)

ADMINISTRADORES DE CARTEIRAS DE VALORES MOBILIÁRIOS	
1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário	
1.1. Declarações dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e desta Instrução, atestando que:	Vide Anexo 1.1. abaixo.
a. reviram o formulário de referência	
b. o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa	
2. Histórico da empresa[1]	
2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa	A instituição possui a solidez e a tradição do Grupo Bahia. A Gestora foi criada em 2011 com a finalidade de otimizar as práticas operacionais do grupo e o atendimento a questões de ordem regulatória (transparência) através da segregação das atividades de gestão de recursos de terceiros. Atualmente, a Gestora é responsável pela gestão de recursos de terceiros e atua de maneira específica dentro de determinados mercados - principalmente nos mercados de juros, taxas de câmbio, índices de preços e derivativos, mas não se restringindo a estes. A Gestora oferece serviços financeiros de qualidade, através de quadros de profissionais experientes e qualificados, tendo no modelo de partnership uma importante ferramenta de alinhamento para o sucesso do negócio. Em 02 de março de 2017, foi alterada a razão social da Sociedade, de BBM II Gestão de Recursos Ltda. para Bahia AM Renda Fixa Ltda. Em 03 de novembro de 2020 foi alterado o endereço da sede da Praça Pio X, 98, 10° andar (parte), Centro, CEP: 20091-040, na Cidade e Estado do Rio de Janeiro para a Avenida

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

	Barão de Tefé, 34, 19º andar (parte), Saúde, CEP: 20220-460, na Cidade e Estado do Rio de Janeiro.
2.2. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo:	
a. os principais eventos societários, tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário	Nos últimos 5 (cinco) anos, não ocorreram operações de reorganização societárias com relação à Gestora: tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário. Contudo, ocorreram algumas mudanças relevantes nesse período: (I) Em 02 de março de 2017, a alteração da denominação social da Gestora de BBM II Gestão de Recursos Ltda. para Bahia AM Renda Fixa Ltda.; (II) Em 01 de setembro de 2017, a entrada do Sr. Diogo Guttman Mariani como sócio e sua nomeação como Diretor de Risco e Compliance ; (III) Em abril de 2019, iniciamos o projeto Saber+ com o objetivo de compartilhar nosso conhecimento com o mercado e investidores. Tomás Brisola era o responsável pelo desenvolvimento do projeto. Em decorrência dessa modificação, Luiz Maciel assumiu a posição de Economista-chefe Brasil e Pedro Saud a posição de Economista-chefe Internacional. No entanto, em julho de 2020, o projeto não atingiu as métricas previstas e decidimos conjuntamente descontinuá-lo. Dessa forma, Tomás optou por buscar novas oportunidades; (IV) Em 06 de dezembro de 2019, o Comitê Executivo aprovou a abertura de filial no Leblon, a qual está em funcionamento; (V) A partir de 01 de julho de 2020, Alexandre Soriano assumiu a Diretoria da área de pesquisa Macroeconômica; (VI) Em novembro de 2019, Marcelo Mendes deixa o posto de Diretor de Gestão e assumiu a área de Estratégia de Médio/Longo prazo do Bahia Asset Management; (VII) Também, em novembro de 2019, Thiago Mendez, no grupo desde 2006, sócio sênior e atual gestor das estratégias de juros, assumiu as operações das mesas de Renda Fixa, posteriormente se tornando o novo Diretor de Gestão; (IX) Em 17 de agosto de 2020, Tomás Brisola foi desligado da Gestora; e (X) No final de 2020, foi encerrada a participação societária de Marcelo Mendes. A nomeação do Diretor de Risco e Compliance mencionada no item (II) visou favorecer a sinergia e a conjunção de esforços

	do Grupo Econômico, nos termos do art. 4º, §4º da Resolução ICVM nº 21, de 25 de fevereiro de 2021.
b. escopo das atividades	Não houve mudanças.
c. recursos humanos e computacionais	Com relação a recursos humanos houve um aumento do quadro de colaboradores de 40 colaboradores em dezembro 2017 para 45 no final de 2018, 51 em dezembro de 2019, novamente 51 em dezembro de 2020 e, por fim, 51 em 2021. No que se refere a recursos computacionais cabe ressaltar que a instituição constantemente investe em infraestrutura, segurança e recursos de contingência. Desde a sua constituição, investimos também em desenvolvimento interno de softwares e contratação de terceiros a fim de assegurar e controlar o fluxo operacional de informações Front-to-Back. Destacamos as seguintes mudanças nos últimos anos: No ano de 2015, a substituição do parque de servidores e da tecnologia de segurança de WebFilter, upgrade do link de internet. No ano de 2016, a substituição da solução de telefonia na área de Gestão de Recursos, upgrade de versão de todos os sistemas operacionais dos servidores, inclusão de camada de IPS (antivírus), criação de ambiente de contingência via Terminal Server, e contratação de um Sistema para gestão de Compliance, denominado Compliasset, o qual disponibiliza uma agenda de atividades regulatórias atualizada, controles internos e testes de aderência para cumprimento das normas de regulação e autorregulação aplicáveis à Gestora. No ano de 2017, fizemos upgrade de firmware dos firewalls, possibilitando a implementação de novas funcionalidades de segurança, upgrade da versão do sistema central de proteção Symantec, substituição do sistema de gravação de telefonia interna, criação de nova funcionalidade de transmissão de streaming nas consoles de telefonia, implementação da nova versão do sistema de Risco, e revisão das atualizações do parque de servidores, implementação de ajustes de configurações de segurança após análises de vulnerabilidades em conjunto com testes de penetração de perímetro em parceria com empresa especializada. No ano de 2018, a Gestora realizou diversas melhorias: implementação da nova ferramenta de vídeo conferência, upgrade da versão do sistema central de proteção, reorganização das regras de firewall, migração da solução de software de gravação de telefonia, implementação da ferramenta de segurança de e-mail com o intuito de aumentar a segurança dos dados, testes internos de '*phishing*', implementação da ferramenta de monitoração de tráfego de redes, monitoramento da qualidade da internet, implementação de QoS, implementação da sala de vídeo conferência, implementação da TV digital, registro de

	chamados do service desk, implantação de sincronização online do Active Directory com e-mail, implantação e acesso condicional no serviço de E-mail. Também em 2018, contratamos os serviços de consultoria da KPMG segurança da informação visando a avaliação e diagnóstico das vulnerabilidades dos ambientes interno e externo. O relatório final da consultoria inclui recomendações para tratar as vulnerabilidades identificadas. Vale destacar que obtivemos um ótimo retorno sobre a aderência dos controles de Cibersegurança do BAHIA Asset Management com o Guia de Cibersegurança da ANBIMA. No ano de 2019 desenvolvemos novas camadas de segurança no ambiente da empresa como duplo fator de autenticação para o serviço de e-mail, implantação de MDM, classificação de arquivos e regras de proteção de dados baseadas na classificação de arquivos, monitoramento de saída de informação para e-mails pessoais. No ano de 2020 fizemos a renovação do parque de infraestrutura interna, disponibilizamos maior *throughput* nas instalações internas de rede, atualização dos *hardwares* de segurança, novos mecanismos de controle de perímetro, renovação dos servidores e equipamentos de controle de estabilização de energia e a substituição dos mecanismos de transmissão de áudio e vídeo. Realizamos também a implementação: ▪ de *software* de vídeo conferência, aumento da disponibilidade do acesso remoto, aumento de estabilidade e redução de latência dos links de comunicação e implementação de telefonia virtual; ▪ de ferramenta de assinatura digital de documentos, "DOCUSIGN"; e ▪ ferramentas que facilitam a colaboração e planificação de trabalho remoto das diversas equipes como o Planner da Microsoft. Vale destacar que as atividades da Gestora continuaram funcionando normalmente durante a implementação de trabalho remoto para a maioria dos colaboradores. No ano de 2021, substituímos o controle de MFA por nova tecnologia, aumento da disponibilidade dos recursos de autenticação de acesso remoto, substituição e atualização do firewall, substituição de provedores de acesso ao data center. Implementação de novas camadas de controle e segurança de acesso por localidade. Ampliação do uso de ferramentas de proteção de dados.

d. regras, políticas, procedimentos e controles internos	Aplicação da Política de Negociação de Valores Mobiliários à todos Colaboradores, por meio, inclusive, de monitoramento das operações realizadas pelos Colaboradores nas corretoras parceiras da Gestora. Realizamos monitoramentos do processo de rateio de ordens agrupadas. Em 2018 foi desenvolvida a Política de Cibersegurança e a Política de Seleção, Contratação e Supervisão de Terceiros contratados em nome dos fundos que, por sua vez, tem como base a metodologia ABR (Abordagem Baseada em Risco), descrita no item 10.1. Utilização do sistema Compliasset, para gestão de Compliance, conforme mencionado no item 2.2.c, acima. Em 2019, foram realizadas ações visando a melhoria dos processos internos e governança, entre eles destacamos a inclusão dos Comitês da Gestora no Contrato Social e o aprimoramento da utilização da ferramenta de monitoramento da Bloomberg. Em 2019, iniciamos a auditoria externa das demonstrações contábeis da empresa. No ano de 2020, 3 (três) novas políticas foram desenvolvidas, são elas: A Política Extraordinária de Prevenção ao COVID-19 que estabelece medidas preventivas ao COVID-19, visando a segurança e o bem-estar de todos os Colaboradores e o menor impacto possível às atividades da Gestora, assim como, o cumprimento das normas oficiais determinadas pelas esferas nacional, estadual e municipal. A Política de Privacidade e Tratamento de Dados, que tem o objetivo de atender as obrigações da Lei Geral de Proteção de Dados, descreve as principais regras sobre o tratamento de dados, incluindo dados pessoais, no âmbito dos serviços prestados por meio de nossos ambientes físicos e virtuais. A Política de Prevenção a Lavagem de Dinheiro e Financiamento ao Terrorismo e a Proliferação de Armas de Destruição em Massa foi reformulada, visando atender a Resolução CVM nº 50, de 31 de agosto de 2021, estabelece regras, procedimentos e controles internos que devem ser observados por todos os colaboradores para a devida prevenção, detecção, análise e reporte de eventos suspeitos de lavagem de dinheiro e financiamento ao terrorismo (“LDFT”) e outras atividades suspeitas. Também em 2020 iniciamos a implementação de área de ESG. Porém, foi em 2021 que terminamos de estruturar a área

	contratando duas analistas dedicadas ao tema e aderimos ao PRI (Principles for Responsible Investment).
3. Recursos humanos[2]	
3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:	
a. número de sócios	22 (vinte e dois) pessoas físicas e 1 (uma) pessoa jurídica
b. número de empregados	33 (trinta e três)
c. número de terceirizados	2 (dois)
d. lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e que atuem exclusivamente como prepostos, empregados ou sócios da empresa	Sr. Thiago de Pinna Mendez, CPF [redacted], Diretor de Gestão, conforme denominado no item 2.2.a., acima, responsável pela gestão da carteira de valores mobiliários da Gestora desde 17 de fevereiro de 2020.
4. Auditores	
4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:	
a. nome empresarial	BDO RCS AUDITORES INDEPENDENTES SOCIEDADE SIMPLES
b. data de contratação dos serviços	Iniciamos o serviço de auditoria externa das demonstração contáveis do exercício findo em 2019 e continuamos contratando para os exercícios seguintes desde então. Em 12 de julho de 2021 contratamos para o exercício findo em 2021.
c. descrição dos serviços contratados	A Gestora contratou a prestação de serviços de auditoria das demonstrações contábeis referentes ao exercício finalizado em 31 de dezembro de 2021. Estes trabalhos contemplam o exame das demonstrações contábeis preparadas em conformidade com as práticas contábeis adotadas no Brasil, com aplicação de procedimentos técnicos, que tem por objetivo a emissão de opinião de auditores independentes, de acordo com as legislações específicas dos órgãos reguladores, para demonstrações contábeis do exercício finalizado em 31 de dezembro de 2021, de acordo com normas específicas estabelecidas pelo IBRACON – Instituto dos Auditores Independentes do Brasil, em conjunto com o CFC – Conselho Federal de Contabilidade.

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

5. Resiliência financeira	
5.1. Com base nas demonstrações financeiras, ateste:	Vide Anexo 5.1. abaixo.
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	
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)	
5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução[3]	N/A – A Gestora é credenciada exclusivamente como "gestora de recursos", motivo pelo qual não é necessária a comprovação de capital mínimo exigido pelo Artigo 1º, §2º, Inciso II da Resolução CVM nº 21, de 25 de fevereiro de 2021.
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.)	Gestão Discricionária.
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 Investimento, nos termos da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014.
c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão	Cotas de fundos de investimentos, contratos futuros, de opções e outros derivativos, cujos ativos subjacentes sejam

[3]A apresentação destas demonstrações financeiras e deste relatório é obrigatória apenas para o administrador registrado na categoria administrador fiduciário de acordo com o inciso II do § 2º do art. 1º.

	valores mobiliários, outros contratos derivativos, independentemente dos ativos subjacentes, títulos públicos. Os ativos listados acima são objeto de investimento no Brasil e no exterior.
d. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor	N/A - A Gestora não atua na distribuição de cotas de fundos de investimento.
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; e	N/A - A Gestora não desenvolve outra atividade que não seja administração de carteiras de valores mobiliários na categoria de gestor de recursos.
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.	A Aleutas S.A., controladora da empresa, e as empresas Ravenala S.A. e Évora S.A, sob controle comum, tem como objeto social a participação no capital social de outras sociedades. A Bahia AM Renda Variável Ltda., também sob controle comum, desenvolve atividades diferentes e individualizadas em relação à Gestora, quais sejam, a prestação de serviços de gestão de carteira de títulos e valores mobiliários especificamente no mercado de renda variável. Não obstante a atuação e gestão independentes de cada uma das empresas, a Gestora e a Bahia AM Renda Variável Ltda. visando a sinergia e a conjunção de esforços do Grupo Econômico, nos termos do art. 4º, §4º da Resolução ICVM nº 21, de 25 de fevereiro de 2021, estão subordinadas ao mesmo Diretor de Risco e Compliance. A Bahia AM Alocação Ltda., sob mesmo controle, está em processo de reestruturação e, portanto, encontra-se em estado não operacional. Não há conflitos de interesses entre as atividades de nenhuma das empresas, pois cada uma delas possui estratégia e âmbito de atuação próprios. Ressaltamos a relação de fidúcia e lealdade em relação aos clientes, motivo pelo qual a Gestora sempre irá alertar previamente sobre a existência de potenciais conflitos de interesse.
6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos[4] e carteiras administradas geridos pela empresa, fornecendo as seguintes informações:	

[4]Se for o caso, fornecer informações apenas dos investidores dos fundos **feeders**, e não do fundo **master**.

a.	número de investidores (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)	Número de Investidores **qualificados:** 394 Número de Investidores **não qualificados:** 20.228 Total de investidores: 20.622
b.	número de investidores, dividido por:	
i.	pessoas naturais	Qualificadas: 48 Não qualificadas: 83
ii.	pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)	Qualificadas: 3 Não qualificadas: 15
iii.	instituições financeiras	0
iv.	entidades abertas de previdência complementar	6
v.	entidades fechadas de previdência complementar	15
vi.	regimes próprios de previdência social	Qualificadas 0 Não qualificadas 0
vii.	seguradoras	1
viii.	sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil	0
ix.	clubes de investimento	Qualificadas: 0 Não qualificadas: 0
x.	fundos de investimento	181
xi.	investidores não residentes	1
xii.	outros (especificar)	Clientes Conta e Ordem (qualificados): 139 Clientes Conta e Ordem (não qualificados): 20.130
c.	recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)	Recursos financeiros de investidores apenas **qualificados** R$ 5.056.720.543 Recursos financeiros de investidores apenas **não qualificados** R$ 1.456.601.982 Total recursos financeiros sob administração R$ 6.513.322.525

d. recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior	R$ 1.240.134.575 A totalidade dos recursos informados neste item 6.3.d, são geridos em conjunto com outras gestoras
e. recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)	1º R$ 592.959.871 2º R$ 230.401.187 3º R$ 220.560.144 4º R$ 212.039.655 5º R$ 211.461.656 6º R$ 204.124.856 7º R$ 149.805.820 8º R$ 138.700.884 9º R$ 99.075.561 10º R$ 98.142.165
f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:	
i. pessoas naturais	Qualificadas R$ 924.547.028 Não qualificadas R$ 34.202.570
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)	Qualificadas R$ 223.507.199 Não qualificadas R$ 99.836.742
iii. instituições financeiras	R$ 0
iv. entidades abertas de previdência complementar	R$ 39.595.003
v. entidades fechadas de previdência complementar	R$ 253.437.830
vi. regimes próprios de previdência social	Qualificadas R$ 0 Não qualificadas R$ 0
vii. seguradoras	R$ 1.282.136
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil	R$ 0
ix. clubes de investimento	Qualificadas R$ 0 Não qualificadas R$ 0

x. fundos de investimento	R$ 3.450.166.186
xi. investidores não residentes	R$ 7.785.004
xii. outros (especificar)	Clientes Conta e Ordem (qualificado): R$ 156.400.157 Clientes Conta e Ordem (não qualificado): R$ 1.322.562.670
6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:	
a. ações	R$ 215.359.394 Os valores aqui descritos consideram também as posições short.
b. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras	R$ 0
c. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R$ 0
d. cotas de fundos de investimento em ações	R$ 0
e. cotas de fundos de investimento em participações	R$ 0
f. cotas de fundos de investimento imobiliário	R$0
g. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R$ 0
h. cotas de fundos de investimento em renda fixa	R$ 0
i. cotas de outros fundos de investimento	R$ 1.240.134.575
j. derivativos (valor de mercado)	R$ 13.379.874
k. outros valores mobiliários	R$ 0
l. títulos públicos	R$ 6.003.520.029
m. outros ativos	Outros ativos FA Compromissadas R$ -961.562.035 Outros ativos FA Despesas R$ -10.562.032 Outros ativos FA Contas Pagar/Receber R$ 13.052.720

6.5. Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária	N/A.
6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes	• A parcela de recursos informados neste item 6 que são geridos em conjunto com outras gestoras corresponde a R$ 6.352.737.927. • Para prestação das informações solicitadas no item 6.4, foram considerados os ativos dos fundos máster, quando aplicável. • O preenchimento do item 6.4, alínea m, engloba: (i) caixa/compromissada; (ii) despesas e (iii) contas a pagar e receber (inclusive dividendos e fluxo de bolsa) para demonstração do Patrimônio Líquido.
7. Grupo econômico	
7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:	
a. controladores diretos e indiretos	**CONTROLADORES DIRETOS:** Aleutas S.A. **CONTROLADORES INDIRETOS:** Ângela Mariani Bittencourt Carlos Mariani Bittencourt Eduardo Mariani Bittencourt Filipe Eduardo Moreau Glória Maria Mariani Bittencourt Diogo Guttman Mariani Joana Guttman Mariani Pedro Henrique Mariani Bittencourt
b. controladas e coligadas	Nenhuma sociedade controlada e/ou coligada.
c. participações da empresa em sociedades do grupo	Nenhuma participação em sociedades do grupo.
d. participações de sociedades do grupo na empresa	Aleutas S.A.
e. sociedades sob controle comum	Ravenala S.A., Évora S.A., Bahia AM Renda Variável Ltda. e Bahia AM Alocação Ltda.
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 item 7.1.	Vide Anexo 7.2. abaixo.

8. Estrutura operacional e administrativa[5]	
8.1. Descrever a estrutura administrativa da empresa, conforme estabelecido no seu contrato ou estatuto social e regimento interno, identificando:	
a. atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico	**Comitê Executivo:** O Comitê Executivo tem as seguintes atribuições: (i) definir o orçamento anual; (ii) definir a destinação dos resultados, deliberar sobre distribuição dos dividendos desproporcionais e a aprovação de custos, investimentos e aspectos financeiros em geral; (iii) deliberar sobre a entrada e saída de sócios; (iv) bem como deliberar sobre questões comerciais, operacionais e outras relevantes para a condução dos negócios da Sociedade. **Comitê de Contrapartes:** O Comitê de Contrapartes tem o objetivo de discutir e propor a metodologia de limites de crédito com as contrapartes, bem como a metodologia de classificação de risco aplicável. **Comitê de Risco:** O Comitê de Risco tem os objetivos de: (i) discutir e monitorar as principais fontes de risco operacional, de mercado, de crédito e de liquidez; (ii) aprovar e monitorar a aplicação de planos de mitigação para os principais riscos identificados; (iii) validar os modelos quantitativos utilizados para cálculo das medidas de risco; e (iv) analisar e definir os cenários de estresse; (v) aprovar as políticas e exposições máximas esperadas de risco; e (vi) aprovar as propostas do Comitê de Contrapartes, quando aplicável. **Comitê de Compliance:** O Comitê de Compliance tem por objetivo apoiar a Diretoria de Compliance 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 Gestora, assim como auxiliar a estabelecer as diretrizes de prevenção à lavagem de dinheiro. **Departamento Técnico:** *Área de Pesquisa Macroeconômica* A área de Pesquisa Macroeconômica é responsável por analisar detalhadamente a conjuntura econômica e política do Brasil, das demais economias emergentes e dos países

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

	desenvolvidos, com ênfase em temas específicos das respectivas áreas de atuação. A abordagem é quantitativa, com ênfase no acompanhamento exaustivo de dados através de diversos modelos desenvolvidos internamente. São analisados temas específicos como inflação, atividade econômica, contas públicas e balanço de pagamentos dos países do G-7 e emergentes. Além da própria equipe de Pesquisa, a empresa conta com a colaboração de consultores externos para as áreas política e econômica, que realizam apresentações periódicas, restritas aos membros internos.
b. em relação aos comitês, sua composição, frequência com que são realizadas suas reuniões e a forma como são registradas suas decisões	**Comitê de Contrapartes:** Periodicidade: anual ou extraordinário. Composição: gerente da área de Risco, gerente da área de Compliance, Analista de Bolsa -bancos, representante do Sócio Controlador, gerente de Risco do Sócio Controlador e Diretor responsável pela área de Pesquisa Macroeconômica. Coordenador: Diretor da área de Risco e Compliance Formalização: por meio de ata. **Comitê de Risco:** Periodicidade: trimestral ou extraordinário, quando da mudança do cenário básico. Participantes: Gerente e analista da área de Risco; head das áreas de Pesquisa Macroeconômica Brasil e Internacional e Diretor responsável pela área de pesquisa Macroeconômica e Gerente de Risco do Controlador. Coordenador: Diretor da área de Risco e Compliance Formalização: por meio de ata. **Comitê de Compliance:** Periodicidade: trimestral ou extraordinário. Participantes: Gerente da área de Compliance e Jurídico, Analista de Compliance, Analista Jurídico e Representante do Sócio Controlador. Coordenador: Diretor da área de Risco e Compliance Formalização: por meio de ata. **Comitê Executivo** Periodicidade: quinzenal ou extraordinário.

	Participantes: Diretor responsável por RI, Produtos e Alocação; Diretor de Renda Variável; Diretor de Renda Fixa, Diretor responsável por Pesquisa Macroeconômica. Coordenador: Diretor da área de Risco e Compliance *Formalização:* por meio de ata. Em circunstâncias excepcionais, os Comitês podem ocorrer virtualmente.
c. em relação aos membros da diretoria, suas atribuições e poderes individuais	**Thiago de Pinna Mendez**: Sócio, Gestor responsável pelas estratégias de Renda Fixa e Moedas. Responsável perante a CVM pela administração de recursos de terceiros da Gestora. **Alexandre Soriano de Alencar:** Sócio e Diretor Responsável pela área de pesquisa Macroeconômica. **César Santiago Lima de Aragão:** Sócio e Diretor Responsável por Produtos, Alocação e Relações com Investidores. **Diogo Guttman Mariani**: Sócio e Diretor de Risco e Compliance. Responsável perante a CVM (i) pelo cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos da Sociedade, nos termos do art. 4º, IV, da Resolução CVM nº 21, de 25 de fevereiro de 2021; (ii) pela gestão de risco, nos termos do art. 4º, V, da Resolução CVM nº 21; e (iii) pela prevenção à "lavagem" de dinheiro e ocultação de bens, direitos e valores, nos termos da legislação vigente, especialmente a Resolução CVM nº 50, de 31 de agosto de 2021, denominado Diretor de Risco e Compliance, conforme item 2.2. a, acima.
8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 8.1.	N/A.
8.3. Em relação a cada um dos diretores de que tratam os itens 8.4, 8.5, 8.6 e 8.7 e dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar, em forma de tabela:	Vide Anexo 8.3. abaixo.
a. nome	
b. idade	

c. profissão	
d. CPF ou número do passaporte	
e. cargo ocupado	
f. data da posse	
g. prazo do mandato	
h. outros cargos ou funções exercidos na empresa	
8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer:	Vide Anexo 8.4. abaixo
a. currículo, contendo as seguintes informações:	
i. cursos concluídos;	
ii. aprovação em exame de certificação profissional	
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	
• nome da empresa	
• cargo e funções inerentes ao cargo	
• atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	
• datas de entrada e saída do cargo	
8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e desta Instrução, fornecer:	Vide Anexo 8.5. abaixo.
a. currículo, contendo as seguintes informações:	
i. cursos concluídos;	

ii. aprovação em exame de certificação profissional	
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	
• nome da empresa	
• cargo e funções inerentes ao cargo	
• atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	
• datas de entrada e saída do cargo	
8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:	
a. currículo, contendo as seguintes informações:	
i. cursos concluídos;	
ii. aprovação em exame de certificação profissional	
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	
• nome da empresa	
• cargo e funções inerentes ao cargo	
• atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	Vide Anexo 8.6. abaixo.
• datas de entrada e saída do cargo	
8.7. Em relação ao diretor responsável pela atividade de distribuição de cotas de	

fundos de investimento, caso não seja a mesma pessoa indicada no item 8.4, fornecer:	N/A – Não exerce a atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento.
a. currículo, contendo as seguintes informações:	
i. cursos concluídos;	
ii. aprovação em exame de certificação profissional	
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	
• nome da empresa	
• cargo e funções inerentes ao cargo	
• atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	
• datas de entrada e saída do cargo	
8.8. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:	
a. quantidade de profissionais	A área de gestão é composta por dois setores principais: Equipe de Gestão: 12 Equipes de Pesquisa Macroeconômica e Micro: 14
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes	Gestão e desenvolvimento de estratégias para evolução dos fundos de renda fixa e multimercado atuando de maneira específica no mercado de juros e de câmbio.
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	Sistemas de informação: Bloomberg, Bloomberg DataLicense, Broadcast Agência Estado, Accenture Risk Control, Quantum, Inoa, Refinitiv (Reuters Eikon e Reuters DataStream), Macrobon, Eviews, ValorPro, Wind, jornais, relatórios de research e sistemas desenvolvidos internamente. A área de gestão de recursos é responsável pela construção dos portfolios através de uma gestão ativa. As estratégias adotadas:

	▪ Estão sujeitas a ajustes em função de mudanças nas conjunturas macroeconômicas internas e externas, ocorrência real ou potencial de crises, mudanças na legislação em vigor e/ou outros fatores de instabilidade. ▪ Permitem a realização de ajustes de forma rápida e eficiente, pois preservam ativos de alta liquidez nas atividades de trading e de estratégias de casamento de ativos/passivos em valor e prazo. ▪ Surgem a partir da geração de cenários e de ideias que são apresentados, discutidos e estabelecidos baseados em histórico de preços e volatilidade, crises de mercado, instabilidade política, fatores macroeconômicos e de liquidez de mercado. Os principais Foros de discussão são: 1 – Reunião de Trading – Avalia resultado das posições, potenciais cenários e suas implicações, discute estratégias e avalia riscos de mercado, crédito e liquidez associados as posições. 2 – Reunião de Abertura de Mercado – A área de Pesquisa Macroeconômica informa os temas relevantes do dia e discute os cenários com a área de Gestão. 3 – Reunião de Macro Brasil e Reunião Macro Internacional - A pauta das duas reuniões é conduzida de forma a serem abordadas as principais variáveis que podem afetar os preços dos ativos.
8.9. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:	
a. quantidade de profissionais	3 (três) Conforme supracitado, a Gestora é parte do Grupo econômico Bahia Asset Management e, nesse contexto, os profissionais das áreas de Risco e Compliance, sob gestão do Diretor de Risco e Compliance, podem atuar em mais de uma empresa do grupo.
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes	Garantir a conformidade com as legislações aplicáveis e melhores práticas de mercado, mapeando os riscos incorridos e objetivando minimizá-los, com base na definição e monitoramento de novos controles.
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	Sistema: Compliasset - Software que disponibiliza uma agenda de atividades regulatórias atualizada, controles internos e testes de aderência para cumprimento das normas de regulação e autorregulação aplicáveis à Gestora.

	A Gestora adota as seguintes rotinas/procedimentos, sem prejuízo do disposto na Política de Compliance e Controles Internos: ▪ Verificar a conformidade das operações de acordo com as legislações vigentes e melhores práticas; ▪ Analisar operações atípicas e emitir parecer justificado no âmbito legal; ▪ Realizar KYP - Know Your Partner; ▪ Realizar KYE - Know Your Employee; ▪ Informar as autoridades competentes quando houver indício de lavagem de dinheiro; ▪ Analisar previamente novos produtos e serviços sobre a ótica de prevenção a lavagem de dinheiro e respeitando a governança corporativa; ▪ Monitorar / Revisar as políticas e manuais elaborados; ▪ Elaborar e atualizar Manuais Corporativos específicos para suas atividades; ▪ Criar/Realizar procedimentos internos que assegurem o adequado monitoramento e elaboração de controles específicos; ▪ Revisão de relatórios Due Diligence quando necessário; ▪ Emitir decisão formal sobre quaisquer ocorrências que abordem os temas: Compliance e lavagem de dinheiro; e ▪ Monitoramento de operações dos Colaboradores como pessoa física. ▪ Periodicamente, proporcionar treinamentos de Prevenção a Lavagem de Dinheiro, Prevenção ao Insider Trading e Anticorrupção aos colaboradores. Para maiores informações, vide a Política de Compliance e Controles Internos no website da Gestora.
d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor	A área de Compliance é uma área segregada da área de gestão, e se reporta diretamente ao Diretor de Risco e Compliance, que não está subordinado ao Diretor de Gestão. Também contamos com o Comitê de Compliance, órgão de caráter permanente e com poderes deliberativos, que apoia a Diretoria de Compliance no desempenho de suas atribuições relacionadas à questões regulatórias, monitoramentos, riscos mapeados em contratos, possíveis descumprimentos de regras, conflito de interesse e etc.
8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de riscos, incluindo:	
a. quantidade de profissionais	4 (quatro) Conforme supracitado, a Gestora é parte do Grupo econômico Bahia Asset Management e, nesse contexto, os profissionais das áreas de Risco e Compliance, sob gestão do Diretor de

	Risco e Compliance, podem atuar em mais de uma empresa do grupo.
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes	Identificar, medir e informar os riscos, bem como assegurar que os parâmetros operacionais sejam observados.
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	O monitoramento e o controle de risco de mercado são baseados no cálculo do VaR com 95% de confiança em um horizonte de investimento de um dia e na análise de cenários, complementar ao VaR, que estima a perda de cada fundo diante de situações de stress no mercado. A instituição utiliza o software Accenture RiskControl como ferramenta base para gerenciamento de risco. Utiliza também o Bloomberg DataLicense como fonte de dados em suas rotinas. As rotinas são as seguintes: ▪ Cálculo e controle da exposição dos instrumentos aos fatores de risco, cujos principais grupos são renda fixa, renda variável, moedas e commodities; ▪ Aferição da contribuição marginal de cada operação para o risco consolidado; ▪ Análises de risco incrementais; ▪ Cálculo e controle do impacto da análise de cenários no resultado; ▪ Aferição das volatilidades e o VaR dos fatores e grupos de risco; ▪ Controle de liquidez da carteira; ▪ Controle de novos produtos; ▪ Controle de risco de contrapartes; Para maiores informações, veja as Políticas relativas ao gerenciamento de Risco no website da Gestora.
d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor	A estrutura de controle do risco se reporta diretamente ao Diretor de Risco e Compliance. As definições dos parâmetros de gerenciamento de risco são discutidas e elaboradas pelo Comitê de Risco. Ressaltamos que não há participação do Diretor de Gestão e tampouco de nenhum integrante da equipe de gestão, visando garantir a independência das decisões tomadas.
8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas, incluindo:	N/A - a Gestora é credenciada exclusivamente como “gestora de recursos”, e não exerce a atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas.
a. quantidade de profissionais	

b. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	
c. a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade	
8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:	N/A - a Gestora não exerce a atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento.
a. quantidade de profissionais	
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes	
c. programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas	
d. infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição	
e. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	
8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes	N/A
9. Remuneração da empresa	
9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 6.1, indicar as principais formas de remuneração que pratica	Taxa de administração e taxa de performance dos fundos geridos.
9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total auferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente, durante o mesmo período, dos clientes em decorrência de:	
a. taxas com bases fixas	74,16%
b. taxas de performance	25,84%

c. taxas de ingresso	Não houve receita desta natureza.
d. taxas de saída	Não houve receita desta natureza.
e. outras taxas	Não houve receita com outras taxas.
9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes	Não há outras informações relevantes.
10. Regras, procedimentos e controles internos	
10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços	Segregamos a Política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços em dois tipos, são eles: os serviços contratados para a Gestora e os serviços contratados pela Gestora em nome dos fundos de investimento. Para os serviços contratados para a Gestora, adotamos a verificação de alguns critérios objetivos como orçamento e outros critérios subjetivos, como a negociação e avaliação do prestador de serviço pela área demandante. Com relação aos serviços contratados pela Gestora em nome dos fundos é aplicável a metodologia de Abordagem Baseada em Risco (ABR), apresentada em maiores detalhes na Política de Seleção, Contratação e Supervisão de Terceiros. A Abordagem Baseada em Risco é uma metodologia para análise das contrapartes na perspectiva de Compliance, visando os aspectos: risco legal, risco regulatório, risco reputacional, risco operacional e ESG (Enviromental, Social and Governance) .
10.2. Descrever como os custos de transação com valores mobiliários são monitorados e minimizados	A Gestora busca o melhor preço e execução para as transações dos clientes. Com base no conceito de "*Best Execution*", a execução das operações é feita com o melhor preço líquido considerando todas as circunstâncias relevantes. São feitas as seguintes avaliações: 1 – Avaliação inicial de cada corretora; 2 – Avaliações constantes feitas pelos traders; 3 – Avaliações periódicas feitas pela Área de Controle.
10.3. Descrever as regras para o tratamento de **soft dollar**, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens etc.	Os Colaboradores não podem aceitar ou enviar presentes, brindes, passeios ou viagens, gratificações ou favorecimentos, cujos valores sejam superiores a R$ 500,00 (quinhentos reais) por ano, de pessoa ou empresa com a qual Gestora possui relação comercial sem aprovação prévia da área *Compliance*. É responsabilidade do gestor de cada área notificar o *Compliance* na ocorrência de presentes ou brindes acima desse valor. Em qualquer hipótese e, independentemente do valor, o envio e recebimento de Brindes só é permitido se não estiver relacionado a Agentes Públicos e não violar em nenhuma

		hipótese as disposições do Código de Conduta e Ética e a Política de Combate a Corrupção. Os acordos de *soft dollars* são celebrados de acordo com os princípios de lealdade e fidúcia que a Gestora deve observar no desempenho de suas atividades e, portanto, não vinculam nem criam nenhuma obrigação para o Bahia Asset Management operar junto às corretoras que concedem os benefícios.
10.4.	Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados	A estratégia de continuidade da Gestora consiste em mapear cenários e estabelecer contingências baseadas na gravidade e probabilidade de ocorrência do evento. As medidas de contingência consistem em garantir que os Colaboradores possam realizar seus processos independentemente de estarem fisicamente na instituição, através de acesso remoto ao computador do escritório e, consequentemente, a todo o seu conteúdo. A Gestora mantém sistemas de contenção que preservam a continuidade dos processos em situações de inoperância de recursos técnicos, como, por exemplo, geradores de energia que mantenham o funcionamento das máquinas em caso de queda de luz. Durante o período de pandemia, utilizamos basicamente o acesso remoto.
10.5.	Descrever as políticas, práticas e controles internos para a gestão do risco de liquidez das carteiras de valores mobiliários	A gestão de risco de liquidez é realizada diariamente através do monitoramento de indicadores, como: i) monitoramento da liquidez dos ativos em carteira ii) estimativa do tempo de zeragem das carteiras dos fundos, de forma individual e conjunta, considerando prazos operacionais e volumes financeiros praticados no mercado iii) estimativa do custos de liquidação das carteiras de ativos dentro do prazo de resgate de cada fundo iv) simulações de cenários de estresse de fluxo de caixa, previamente discutidos nos comitês de risco, com o intuito de garantir a capacidade dos fundos de honrar seus passivos v) controle do fluxo de caixa das operações, aplicações e resgates dos fundos. Cabe à área de Risco acompanhar estes indicadores. Para maiores informações, veja a Política de Gerenciamento de Risco de liquidez no website da Gestora.
10.6.	Descrever as políticas, as práticas e os controles internos para o cumprimento das normas específicas de que trata o inciso I do art. 30, caso decida atuar na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor	N/A – A Gestora não atua na distribuição de cotas de fundos de investimento.
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	http://www.bahiaasset.com.br/institucional/politica-e-codigos/bahia-am-renda-fixa/

11. Contingências[6]	
11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, que sejam relevantes para os negócios da empresa, indicando:	A Gestora não figura no polo passivo de processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, e/ou que sejam relevantes para os negócios da Gestora.
a. principais fatos	
b. valores, bens ou direitos envolvidos	
11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem sua reputação profissional, indicando:	O Diretor de Gestão não figura no polo passivo de processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, e/ou que sejam relevantes para sua reputação profissional.
a. principais fatos	
b. valores, bens ou direitos envolvidos	
11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores	Não há.
11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que a empresa tenha figurado no polo passivo, indicando:	Não há condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que a empresa tenha figurado no polo passivo.
a. principais fatos	N/A
b. valores, bens ou direitos envolvidos	N/A
11.5. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo e tenha afetado seus	Não há 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 de Gestão tenha figurado no polo passivo e tenha afetado seus negócios ou sua reputação profissional.

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

negócios ou sua reputação profissional, indicando:	
a. principais fatos	
b. valores, bens ou direitos envolvidos	
12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, informando sobre:	
a. 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	Vide Anexo 12 abaixo.
b. 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	
c. impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa	

d.	inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito	
e.	inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado	
f.	títulos contra si levados a protesto	

ANEXO 1.1. ao Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

DECLARAÇÃO DAS PESSOAS RESPONSÁVEIS PELO CONTEÚDO DO FORMULÁRIO

THIAGO DE PINNA MENDEZ, brasileiro, casado, economista, inscrito no CPF/ME sob o nº [redacted], portador da Cédula de Identidade RG nº [redacted] expedida pelo [redacted], residente e domiciliado na Cidade do Rio de Janeiro, Estado do Rio de Janeiro, na Avenida Barão de Tefé, 34, 19° andar (parte), CEP 20.220-460, na qualidade de Diretor de Gestão da **BAHIA AM RENDA FIXA LTDA.**, sociedade com sede na Cidade do Rio de Janeiro, Estado do Rio de janeiro, na Avenida Barão de Tefé, 34, 19° andar (parte), CEP 20.220-460, inscrita no CNPJ/ME sob o nº 13.151.244/0001-17 ("Gestora"), e, **DIOGO GUTTMAN MARIANI**, brasileiro, casado, economista, inscrito no CPF sob o nº [redacted], portador da Cédula de Identidade RG nº [redacted] expedida pelo [redacted], residente e domiciliado na Cidade Rio de Janeiro, Estado do Rio de Janeiro, na Avenida Barão de Tefé, 34, 19° andar (parte), CEP 20.220-460, na qualidade de diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e pela Gestão de Risco da Gestora e da Resolução CVM nº 21, de 25 de fevereiro de 2021, atestam que:

(i) Reviram o formulário de referência; e

(ii) O conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela Gestora.

Rio de Janeiro, 11 de março de 2022

_____
Nome: Thiago de Pinna Mendez
Cargo: Diretor de Gestão

_____
Nome: Diogo Guttman Mariani
Cargo: Diretor de Risco e Compliance

ANEXO 5.1. ao Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

DECLARAÇÃO - RESILIÊNCIA FINANCEIRA

Com base em suas demonstrações financeiras, o **BAHIA AM RENDA FIXA LTDA.**, sociedade com sede na Cidade do Rio de Janeiro, Estado do Rio de janeiro, na Avenida Barão de Tefé 34,19º andar (parte), CEP 20.220-460, inscrita no CNPJ/ME sob o nº 13.151.244/0001-17 ("Gestora"), atesta que:

(i) a receita em decorrência de taxas com bases fixas a que se refere o item 9.2.a do Formulário de Referência é suficiente para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários; e

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

Rio de Janeiro, 11 de março de 2022

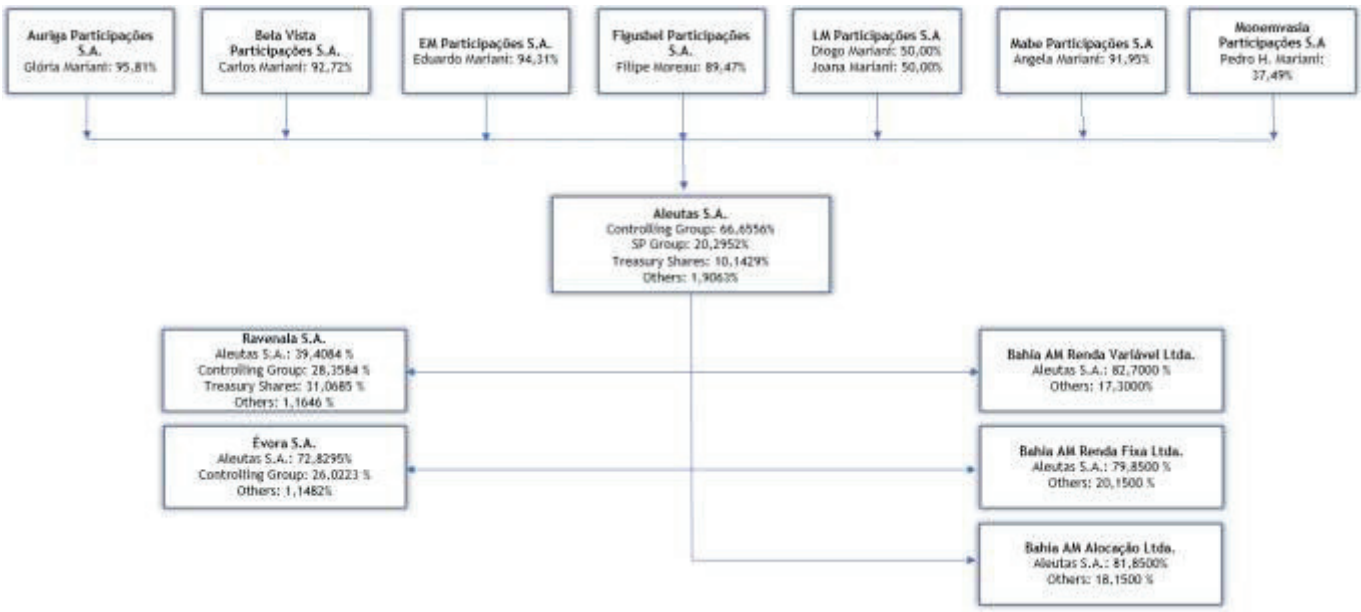
_____

BAHIA AM RENDA FIXA LTDA

Por: Thiago de Pinna Mendez
Cargo: Diretor de Gestão

Por: Diogo Guttman Mariani
Cargo: Diretor de Risco e Compliance

ANEXO 7.2. ao Formulário de Referência - Pessoa Jurídica



- Data base: 08/02/2022.

ANEXO 8.3. ao Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

RELAÇÃO DOS DIRETORES E MEMBROS DE COMITÊS

Diretor responsável pela Administração de Carteira de Valores Mobiliários	
Nome	**Thiago de Pinna Mendez**
Idade	36
Profissão	Economista
CPF	[redacted]
Cargo	Diretor de Gestão e Sócio
Data de posse	17/02/2020
Prazo do Mandato	Indeterminado
Outros Cargos ou funções exercidas na empresa	Membro do Comitê Executivo

Diretor responsável pela Implementação e Cumprimento de Regras, Políticas e Procedimentos Internos e Gestão de Risco (*Compliance e Risk Officer*)	
Nome	**Diogo Guttman Mariani**
Idade	44
Profissão	Economista
CPF	[redacted]
Cargo	Diretor de Risco e Compliance e Sócio
Data de posse	01/09/2017
Prazo do Mandato	Indeterminado
Outros Cargos ou funções exercidas na empresa	Diretor responsável pela gestão de risco e pela prevenção à lavagem de dinheiro. Membro dos Comitês Executivo, de Compliance, de Risco e de Contrapartes

Membro de Comitê Executivo, de Risco e de Contrapartes	
Nome	**Alexandre Soriano de Alencar**
Idade	50
Profissão	Engenheiro
CPF	[redacted]
Cargo	Sócio
Data de posse	08/05/2020
Prazo do Mandato	Indeterminado
Outros Cargos ou funções exercidas na empresa	Diretor responsável por Pesquisa Macroeconômica do Bahia Asset Management

Membro de Comitê Executivo	
Nome	**César Santiago Lima De Aragão**
Idade	51
Profissão	Engenheiro
CPF	[redacted]
Cargo	Sócio
Data de posse	05/12/2019
Prazo do Mandato	Indeterminado
Outros Cargos ou funções exercidas na empresa	Responsável por RI, Produtos e Alocação

Membro de Comitê de Risco e Comitê de Contrapartes	
Nome	Rodrigo Azevedo de Castro Botelho
Idade	38
Profissão	Engenheiro Elétrico
CPF	[redacted]
Cargo	Sócio
Data de posse	23/06/2016
Prazo do Mandato	Indeterminado
Outros Cargos ou funções exercidas na empresa	Gerente de TI, Risco e Controle

Membro do Comitê de Compliance	
Nome	Victor Anderson Rocha de Souza
Idade	36
Profissão	Advogado
CPF	[redacted]
Cargo	Advogado
Data de posse	16/11/2020
Prazo do Mandato	Indeterminado
Outros Cargos ou funções exercidas na empresa	Gerente Jurídico e de Compliance

Membro do Comitê de Compliance	
Nome	Andre Philippe Mattias Lindner Krepel
Idade	53
Profissão	Administrador
CPF	[redacted]
Cargo	Representante do Sócio Controlador
Data de posse	18/03/2019
Prazo do Mandato	Indeterminado
Outros Cargos ou funções exercidas na empresa	Representante do Sócio Controlador

ANEXO 8.4. ao Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CURRÍCULO PROFISSIONAL DO DIRETOR RESPONSÁVEL PELA ADMINISTRAÇÃO DE CARTEIRA DE VALORES MOBILIÁRIOS

THIAGO DE PINNA MENDEZ

Bahia Asset Fevereiro 2020 – atual
Diretor de Renda Fixa
Gerir a carteira de renda fixa da Sociedade; Responsável pela prestação de serviços de administração de carteira de valores mobiliários de terceiros perante à CVM; Elaboração, análise e execução de estratégias no mercado; Acompanhamento de performance dos fundos.

Bahia Asset Janeiro 2012 – Fevereiro 2020
Responsável - Juros Brasil e Internacional
Estratégias abrangendo o mercado de juros do Brasil e Internacional
Participação relevante em todo o processo de investimento

Bahia Asset Novembro 2010 - Janeiro 2012
Operador de Juros Brasil
Área especializada no mercado de juros e inflação do Brasil

Bahia Asset Junho 2010 - Novembro 2010 Operador de Moedas Internacionais
Experiência com operações de futuros, opções simples e exóticas

Banco BBM Abril 2009 - Junho 2010 Operador de Juros Internacional
Focado no mercado de juros do México, Chile, África do Sul e Europa Central

Banco BBM Dezembro 2007 - Abril 2009 Analista – Controle Gerencial
Responsável pela apuração dos resultados, custódia e risco das operações da tesouraria
Desenvolvimento de ferramentas para o acompanhamento do resultado e risco de opções, swaps e de-rivativos exóticos

Banco BBM Abril 2006 - Dezembro 2007 Estagiário – Controle Gerencial
Conferir e divulgar resultados, custódia e risco das operações da tesouraria
Educação / Certificações
Bacharelado em Economia - Pontifícia Universidade Católica do RJ (PUC-RJ) 2004-2007. Bolsa de Estudos (méritos acadêmicos e atleta de futebol da instituição)

Ensino Médio - Colégio São Vicente de Paulo Niterói - RJ - Conclusão 2003

Certificação de Gestores da ANBIMA - CGA ANBIMA - 2010

Idiomas
Inglês Fluente

ANEXO 8.5. e 8.6 ao Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CURRÍCULO PROFISSIONAL DO DIRETOR RESPONSÁVEL PELA IMPLEMENTAÇÃO E CUMPRIMENTO DE REGRAS, POLÍTICAS, PROCEDIMENTOS E CONTROLES INTERNOS E PELA GESTÃO DE RISCO (COMPLIANCE AND RISK OFFICER)

DIOGO GUTTMAN MARIANI

EDUCAÇÃO

MESTRADO PROFISSIONAL EM ADMINISTRAÇÃO DE EMPRESAS – PUC/RIO – ABR/2014

Ênfase em Finanças. Dissertação: "Como abordar incertezas na avaliação de *startups*. Estudo de Caso"

CERTIFICATE IN BUSINESS ADMINISTRATION (CBA) – HARVARD BUSINESS SCHOOL – JUN/2002

BACHAREL EM CIÊNCIAS ECONOMICAS – PUC-RIO – JUN/2001

CURSOS

VENTURE CAPITAL EXECUTIVE PROGRAM – BERKELEY – set/2013

Sólida experiência no mercado financeiro com diversos enfoques: asset management, captação de novos negócios, atuação como Diretor de Risco e Compliance; coordenação das áreas de BackOffice, entre outros.
Amplo conhecimento de finanças corporativas, contabilidade e administração em geral.
Prática intensiva de melhoria de processos e redução de custos.
Reconhecida habilidade de liderança e desenvolvimento de equipes.
Atuação em empresas de variados portes.

PRINCIPAIS EXPERIÊNCIAS PROFISSIONAIS

BAHIA AM RENDA VARIÁVEL LTDA. e BAHIA AM RENDA FIXA LTDA.
Principal atividade da empresa: Gestão de Fundos de Investimento

(06/2017 a atual)

Principal atividade: Diretor de Risco e Compliance
Diretor controlador responsável pelas áreas de risco e compliance da empresa. Responsável pela gestão e aprimoramento dos controles de risco, compliance, além do acompanhamento das áreas de orçamento e departamento de pessoal. Membro dos comitês executivo, de compliance, de risco e de contrapartes.

ALEUTAS S.A.
Principal atividade da empresa: Participação no capital social de outras sociedades

(06/2015 a atual)

Principal atividade: Diretor de BackOffice,

Diretor controlador responsável pela gestão da empresa, bem como pelas áreas financeira e departamento de pessoal.

(06/2014 a 05/2015)

Principal atividade: Diretor de Novos Negócios;
Responsável pela prospecção, avaliação e acompanhamento de novos negócios. Membro do conselho de administração da MMB Agropecuária, tendo como objetivo de desenvolver a área agriculturável, e integração agropecuária, além de controle orçamentário aprimorado e governança.

RESERVA

Principal atividade da empresa: comércio de varejo e atacado de roupas, artigos de vestuário, calçados, acessórios e móveis, prestação de serviços de criação, estilo, programação visual e desenvolvimento de coleções no segmento de roupas, vestuário, calçados, acessórios e móveis, bem como prestação de serviços de promoção de eventos sem a utilização de atores, cantores ou outros artistas.

(Jan/2011 a Dez/2013)

Principal atividade: Sócio, Diretor de TI, Diretor executivo,
Responsável pela gestão, desenvolvimento e aprimoramento da área de TI, além da seleção e implantação do sistema ERP.

(Jan/2007 a Dez/2010)

Principal atividade: Diretor Administrativo Financeiro.
Responsável pela gestão, desenvolvimento e aprimoramento das áreas de tesouraria, orçamento, fluxo de caixa, crédito, resultados, entre outras. Geração de relatórios de previsão de vendas, controle de custos, todas as áreas, visando maximizar o resultado financeiro do negócio.

BRASIL TELECOM

(2002)
Trainee da Brasil Telecom; selecionado dentre mais de 14 mil candidatos em todo o Brasil, para a área de planejamento estratégico.
Projeto de Trainee de capacitação da força de vendas “Parceiros de Valor” premiado no programa Gente em destaque, na categoria relacionamento com terceiros.

ANEXO 12 ao Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

DECLARAÇÃO DIRETOR RESPONSÁVEL PELA ADMINISTRAÇÃO

THIAGO DE PINNA MENDEZ, brasileiro, casado, economista, inscrito no CPF/ME sob o nº [redacted], portador da Cédula de Identidade RG nº [redacted] expedida pelo [redacted], na qualidade de diretor responsável pela administração das carteiras de títulos e valores mobiliários da **BAHIA AM RENDA FIXA LTDA.**, sociedade com sede na Cidade do Rio de Janeiro, Estado do Rio de Janeiro, na Avenida Barão de Tefé, 34, 19º andar (parte), CEP 20220-460, inscrita no CNPJ/ME sob o nº 13.151.244/0001-17 ("Gestora"), **DECLARO** que:

a) não existem contra mim 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, bem como não estou inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos;

b) não existem contra mim 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;

c) não estou impedido de administrar meus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa;

d) não estou incluído no cadastro de serviços de proteção ao crédito;

e) não estou incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado; e

f) não tenho contra mim títulos levados a protesto;

Rio de Janeiro, 11 de março de 2022.

_____

Nome: Thiago de Pinna Mendez
Cargo: Diretor de Gestão