

MANUAL DE PRECIFICAÇÃO DE ATIVOS
DA
CONVEST CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA

Vigência: janeiro/2023

Versão: 01/23



Convest

Consultoria de Investimentos Ltda

Sumário

| | | |
|----|--------------------------------------|---|
| 1. | Objetivo | 3 |
| 2. | Metodologia de Apreçamento de Ativos | 3 |
| 3. | Vigência e Atualização | 4 |

1. OBJETIVO

Este Manual de Precificação foi elaborado para formalizar os procedimentos de precificação de ativos nos relatórios das carteiras administradas desenvolvidos pela Convest Consultoria de Investimentos (“Gestora”) para uso interno e para o envio aos seus clientes.

O objeto do presente Manual de Precificação é apresentar os mecanismos de coleta de informações, processos e procedimentos adotados pela Gestora, assim como metodologias aplicadas pela justa avaliação e reavaliação dos ativos.

O processo decisório de avaliação e precificação dos ativos baseia-se na utilização de metodologias, fontes e processos para a tomada de decisão, seguindo os fluxos, diretrizes e procedimentos definidos neste Manual, levando-se em conta a natureza, porte, complexidade e modelo de negócio da Gestora.

Os Administradores possuem suas próprias metodologias de precificação e devem seguir as diretrizes divulgadas pela Anbima.

Os critérios definidos neste manual foram elaborados pela área de Risco e aprovados em reunião interna.

2. METODOLOGIA DE APREÇAMENTO DE ATIVOS

Como regra geral, um dos mecanismos de coleta de informações se baseia em fontes de informações, podendo ser primárias ou alternativas/secundárias, conforme definidas abaixo.

Fonte Primária:

A Fonte Primária é a primeira fonte para a obtenção de preços de mercado – *Bloomberg*.

- Fundo, Fundo Imobiliário, Ação, Derivativo, Título Público, Debênture (com liquidez).

Fontes Secundárias:

As Fontes Secundárias são opções de fontes para a obtenção de preços e taxas para a marcação a mercado de títulos e/ou ativos integrantes nas carteiras em momentos de crise ou de acordo com critérios objetivos definidos por operação.

As Fontes Secundárias utilizadas na coleta de preços são:

- Securitizadoras e Agentes Fiduciários para preços de curva de CRA e CRI;
- Anbima para preços a mercado de CRA, CRI e Debêntures de baixa liquidez ou não disponíveis na *Bloomberg*;
- Preços de Curva Calculados por Sistema próprio de acordo com as taxas: CDB, LC, LCA, LCI, LF, LIG;
- Tesouro Direto para preços a mercado de títulos públicos não disponíveis na *Bloomberg*;
- CVM cotas para fundos não disponíveis na *Bloomberg*.

Fontes Terciárias:

Preços e/ou cotas de Fundos, CRA, CRI e Debêntures não disponíveis nas fontes primárias e secundárias – buscamos nos extratos dos parceiros.

Outros Ativos:

Caso ativos não contemplados neste manual sejam adquiridos eles serão apreçados inicialmente pela taxa da operação até que seja definido internamente o modelo de apreçamento.

3. VIGÊNCIA E ATUALIZAÇÃO

Esta política será revisada anualmente, e sua alteração acontecerá caso seja constatada necessidade de atualização do seu conteúdo. A presente política poderá ainda ser alterada a qualquer tempo em razão de circunstâncias que demandam tal providência.