

Política de classificação de escala de risco das Classes dos FIFs



SUMÁRIO

1.	DADOS GERAIS	3
2.	INTRODUÇÃO	3
3.	DEFINIÇÕES	3
4.	ABRANGÊNCIA.....	3
5.	METODOLOGIA PARA ESCALA DE RISCO	4
6.	CLASSIFICAÇÃO DAS CLASSES DE FIF ANBIMA.....	4
7.	DISPOSIÇÕES GERAIS.....	5
8.	HISTÓRICO DE ALTERAÇÕES.....	5

1. DADOS GERAIS

CONFIDENCIALIDADE: PÚBLICO	ÁREA: RISCO
ÚLTIMA REVISÃO: ABR/2024	PRÓX. REVISÃO: ABR/2026
AUTOR: RISCO	APROVADOR: DIRETORIA DE RISCO

2. INTRODUÇÃO

As Gestoras controladas pela Trinus Co. entendem que a identificação, o monitoramento e o controle dos diversos riscos relevantes às carteiras de valores mobiliários e à organização como um todo é essencial para dar transparência aos investidores, bem como para potencializar a alocação eficiente de recursos.

A escala de risco das classes dos fundos de investimento financeiro tem por objetivo estabelecer normas e procedimentos para classificação das classes dos FIF, de acordo com uma escala de risco, conforme exigido pelas Regras e Procedimentos de Administração e Gestão de Terceiros da Anbima, observando o risco envolvido na estratégia de investimento de cada classe do FIF.

3. DEFINIÇÕES

Alta administração: Responsáveis deliberativos por decidir e orientar quanto ao propósito do negócio e por fiscalizar a gestão das empresas Trinus Co., englobando assim CEOs e diretorias.

Companhia: Junção de todas as empresas controladas pela Trinus Co. Participações S.A.

CVM: Comissão de Valores Mobiliários. Entidade autárquica vinculada ao Ministério da Economia responsável por disciplinar, fiscalizar e desenvolver o mercado de valores mobiliários no Brasil.

Gestoras: Todas as gestoras de valores mobiliários controladas pela Trinus Co.

Trinus Co.: Holding da Companhia, que dá o nome ao conglomerado.

4. ABRANGÊNCIA

Esta Política deve ser atendida por todos os integrantes das Gestoras, inclusive seus sócios e diretores.

5. METODOLOGIA PARA ESCALA DE RISCO

As Gestoras adotam como parâmetro a metodologia para escala de risco orientada pela Anbima nas Regras e Procedimentos de Administração e Gestão de Terceiros, a qual considera fatores de risco como:

- a) Risco de taxa de juros;
- b) Risco de índices de preços;
- c) Risco de câmbio;
- d) Risco de bolsa;
- e) Risco de crédito;
- f) Risco de liquidez; e
- g) Risco de commodities.

6. CLASSIFICAÇÃO DAS CLASSES DE FIF ANBIMA

Conforme elucidado anteriormente, as Gestoras adotarão a Classificação das Classes de FIF sugerida pela Anbima, a qual seira:

Classificação das Classes de FIF ANBIMA	Escala de Risco
Renda Fixa Simples	1
Renda Fixa Indexados	1
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	1
Renda Fixa Duração Baixo Grau de Investimento	1
Renda Fixa Duração Baixo Crédito Livre	2
Renda Fixa Duração Média Soberano	1,5
Renda Fixa Duração Média Grau de Investimento	1,5
Renda Fixa Duração Média Crédito Livre	2,5
Renda Fixa Duração Alta Soberano	2,5
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	2,5
Renda Fixa Duração Alta Crédito Livre	3
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	2
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	3
Ações Indexados	4
Ações Índice Ativo	4
Ações Valor/Crescimento	4
Ações Small Caps	4
Ações Dividendos	4
Ações Sustentabilidade/Governança	4
Ações Setoriais	4

Ações Livre	4
Fundos de Mono Ação	4
Multimercados Balanceados	2
Multimercados Dinâmico	2
Multimercados Capital Protegido	2
Multimercados Long and Short – Neutro	2,5
Multimercados Long and Short – Direcional	3
Multimercados Macro	3
Multimercados Trading	3,5
Multimercados Livre	3,5
Multimercados Juros e Moedas	2,5
Multimercados Estrat. Específica	3
Cambial	4

7. DISPOSIÇÕES GERAIS

A presente Política vigorará por prazo indeterminado e deverá ser revisada com periodicidade mínima bienal ou quando mudanças significativas ocorrerem nas normativas ou nos controles internos das Gestoras, para assegurar a sua contínua relevância, conformidade e aplicabilidade.

Esta Política entra em vigor na data de sua divulgação e revoga quaisquer documentos em contrário.

Quaisquer dúvidas poderão ser direcionadas ao e-mail risco@tgcore.com.br ou aos membros da Área de Risco.

8. HISTÓRICO DE ALTERAÇÕES

Data	Autor	Descrição
abr/2024	Risco	Criação Política.