



FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA QUANTITAS GESTÃO DE RECURSOS 2021

Este Formulário de Referência foi estruturado de acordo com o ANEXO 15-II da Instrução CVM nº 558/2015.

As informações prestadas referem-se aos dados de 31 de dezembro de 2021.

Data: 31/03/2022



SUMÁRIO

2. Histórico da empresa.....	3
3. Recursos humanos	6
4. Auditores	7
5. Resiliência financeira	8
6. Escopo das atividades.....	9
7. Grupo econômico	14
8. Estrutura operacional e administrativa	15
9. Remuneração da empresa.....	27
10. Regras, procedimentos e controles internos	28
11. Contingências	41
12. Declarações	42



2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

- A Quantitas é uma gestora de fundos de investimentos, baseada em um modelo partnership, em que seus executivos responsáveis pela condução do negócio também são também sócios da empresa.
- A Quantitas iniciou suas atividades em gestão de recursos em agosto de 2011, a partir de um contrato de terceirização de atividades de gestão de recursos firmado com uma instituição financeira, sendo seus sócios fundadores todos executivos com experiência em gestão de recursos.
- A partir de 2014, a Quantitas iniciou um movimento comercial visando capturar benefícios a partir de sua elevada escala e qualificação da equipe de gestão, criando produtos de investimento destinados a públicos até então não atendidos diretamente pela empresa - como pessoas físicas, family offices e fund of funds, através de distribuição própria. Adicionalmente aos produtos abertos, diversos investidores são atendidos pela Quantitas através de produtos exclusivos, em uma estrutura flexível que assegura acesso a todos os mercados dentro de necessidades específicas dos investidores.
- Em 2018, visando se aproximar de clientes e fornecedores de serviços, a Quantitas inaugurou escritório em São Paulo. Também iniciou a distribuição dos fundos em plataformas digitais, assim como aprimorou a experiência de clientes que desejam investir diretamente através do site.
- Em 31/12/2021, a Quantitas apresenta-se com o seguinte perfil:
 - - Em torno de R\$ 4,213 bilhões sob gestão;
 - - Diversificação em termos de receita, dividida de forma semelhante entre clientes institucionais, plataformas, alocadores e family offices e pessoas físicas qualificadas;
 - - Em torno de 29.645 cotistas ativos;
 - - Em torno de 25 plataformas distribuindo os fundos da Quantitas;
 - - Capacidade de entregar performance com volumes elevados e crescentes de recursos sob gestão;
 - - Histórico positivo de rentabilidade em momentos de volatilidade dos mercados;

- - Compromisso na execução de mandatos exclusivos, com rígido controle de riscos e enquadramentos normativos.

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.

Em junho/17, a Quantitas decidiu vender a totalidade de ações de uma subsidiária integral chamada Quantitas Assessoria Financeira S.A., empresa focada em assessoria financeira, reestruturação de dívidas e fusões e aquisições, para focar-se exclusivamente na atividade de gestão de recursos e distribuição de seus fundos. A Quantitas Participações, holding que controlava ambos os negócios, foi incorporada pela Quantitas Gestão de Recursos em outubro de 2017.

b. Escopo das atividades

A Quantitas realiza a gestão e distribuição de cotas de fundos de investimentos, nos termos da Instrução CVM nº 558/2015. Passou a distribuir cotas de fundos de investimento a partir da possibilidade prevista na referida Instrução.

c. Recursos humanos e computacionais

A Quantitas, ao longo destes anos, realizou as seguintes alterações relevantes no seu quadro de Pessoal:

- 2014: O Wagner F. Salaverry assumiu como Diretor de gestão dos portfólios de renda variável e diretor responsável pelas áreas de análise de ações e crédito da empresa.
- 2014: O Marcos Fritzen foi eleito como diretor responsável pelas áreas de operações, incluindo relacionamento com clientes, compliance, riscos, administrativo, financeiro e produtos da asset, deixando a função de Diretor Responsável na CVM.
- 2014: o Rogério Braga, diretor responsável pela gestão de renda fixa e multimercados, também assumiu como diretor responsável na CVM.
- 2017: o Marcos Fritzen renunciou ao cargo de Diretor, sendo eleito em seu lugar o Marcel Kussaba.

- 2019: a Daniela Alliatti assume a diretoria de operações, administração, risco e compliance e o Marcel Kussaba passa a ser responsável pela gestão de renda variável, junto com Wagner Salaverry, e pela análise de crédito.

d. Regras, políticas procedimentos e controles internos

A Quantitas possui a estrutura de políticas e regras vigentes, a saber:

- Plano de Continuidade de Negócios
- Política de Compras e Contratação de Serviços
- Política Conheça seu Cliente e PLDFT
- Política de Decisão de Investimentos
- Política de Rateio de Ordens
- Política de Gestão de Riscos
- Política de Gestão de Liquidez
- Política de Suitability
- Política de Voto
- Política para Aquisição e Monitoramento de Crédito Privado
- Manual de Segurança e Sigilo das Informações
- Política de Responsabilidade Socioambiental
- Manual de Procedimentos de Compliance
- Política de Segurança Cibernética
- Regulamento de Conduta da Quantitas
- Política de Investimentos Pessoais
- Regulamento de Meios e Procedimentos de Execução de Ordens
- Regulamento do Comitê de Riscos e Compliance



3. Recursos humanos

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

a. Número de sócios

A empresa possui 10 sócios.

b. Número de empregados

A Quantitas possui 26 empregados.

c. Número de terceirizados

A Quantitas possui 7 serviços terceirizados

d. Lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e atuam exclusivamente como prepostos ou empregados da empresa

- Rogério S. Braga (Diretor Responsável na CVM) – CPF 946.135.400-20
- Wagner F. Salaverry – CPF 895.065.100-91



4. Auditores

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

a. Nome empresarial

Não possuímos auditor independente.

b. Data de contratação dos serviços

Não aplicável.

c. Descrição dos serviços contratados

Não aplicável.



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, é suficiente.

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, representa mais que 0,02% e também é maior que R\$ 300.000,00.

5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução

A Quantitas não realiza a atividade de administração fiduciária, estando dispensada, portanto, de apresentar suas Demonstrações Financeiras conforme o § 5º do Artigo 1º da Instrução.



6. Escopo das atividades

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

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

A Quantitas presta serviços de gestão discricionária de fundos de investimento, além da distribuição de fundos de investimento sob sua gestão.

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.)

Atualmente a Quantitas tem sob gestão somente fundos de investimento regidos pela ICVM nº 555. A empresa oferece soluções customizadas e especializadas sob a forma de produtos de renda fixa, multimercados e ações, para os diversos públicos no Brasil, como instituições financeiras, fundos de pensão, seguradoras, previdência privada, distribuidores, *family offices*, *fund of funds* e investidores pessoas físicas. Atua com uma diversa gama de mandatos para cada perfil de investidor, utilizando produtos exclusivos, restritos a um grupo econômico, ou produtos abertos, para os investidores em geral.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

A empresa atua preponderantemente com a gestão de risco de mercado na geração de retornos, utilizando instrumentos de renda fixa, renda variável e câmbio, nos mercados à vista e de derivativos. Em renda fixa, são utilizados, preponderantemente, títulos públicos federais, emissões financeiras (letras financeiras, depósitos a prazo, depósitos a prazo com garantia especial) e emissões corporativas (debêntures e notas promissórias emitidas por companhias de capital aberto). Em renda variável, são utilizadas ações, fundos de índice, além de derivativos.

d. Se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor

A empresa atua na distribuição de alguns fundos sob sua gestão.



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

A Quantitas não realiza outras atividades além das descritas no item anterior.

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 atividade

Não se aplica.

6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos e carteiras administradas geridos pela empresa, fornecendo as seguintes informações:

a. Número de investidores (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados – Base 31/12/2021)

- Total = 29.645

- Investidores Qualificados = 116
- Investidores Não Qualificados= 29.529

b. Número de investidores, dividido por:

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
a. Número de Investidores	116	29.529	29.645
b. Número de investidores, dividido por:	116	29.529	29.645
i. Pessoas Naturais	61	34	95
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	10	29.495	29.505
iii. Instituições financeiras	4	-	4
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0	-	0
v. Entidades Fechadas de Previdência	11	-	11

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Complementar			
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	30	-	34
xi. Investidores não residentes	0	-	0
xii. Outros	0	0	0
Total	116	29.529	29.645

c. Recursos financeiros sob administração

- Total: R\$ 4.213.643.109,41

- Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados: R\$ 2.931.132.446,32
- Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados: R\$ 1.282.510.663,09

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

0,00

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

	VALOR
1	R\$ 1.214.715.258,96
2	R\$ 471.427.352,57
3	R\$ 209.686.089,74
4	R\$ 186.197.932,02
5	R\$ 166.516.248,17

6	R\$ 87.986.541,59
7	R\$ 86.803.119,66
8	R\$ 61.396.031,17
9	R\$ 50.147.491,24
10	R\$ 49.797.021,76

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\$ 267.625.981,02	R\$ 34.572.834,00	R\$ 302.198.815,02
ii. Pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 14.835.558,11	R\$ 1.247.937.829,09	R\$ 1.262.773.387,20
iii. Instituições Financeiras	R\$ 1.033.827.622,50	R\$ 0,00	R\$ 1.033.827.622,50
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
v. Entidades Fechadas de Previdência complementar	R\$ 1.316.802.761,71	R\$ 0,00	R\$ 1.316.802.761,71
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\$ 298.040.522,98	-	R\$ 298.040.522,98
xi. Investidores não Residentes	R\$ 0,00	-	R\$ 0,00

xii. Outros	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
Total	R\$ 2.931.132.446,32	R\$ 1.282.510.663,09	R\$ 4.213.643.109,41

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

- a. Ações: R\$ 355.845.319,90
- b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras: R\$ 939.977.930,16
- c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras: R\$ 988.657.782,47
- 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\$ 25.988.943,77
- g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios: R\$ 56.494.207,77
- h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa: R\$ 0,00
- i. Cotas de outros fundos de investimento: R\$ 0,00
- j. Derivativos (valor de mercado): -R\$ 554.398.529,80
- k. Outros valores mobiliários: R\$ 0,00
- l. Títulos públicos: R\$ 1.769.713.754,30
- m. Outros ativos: R\$ 28.036.377,87

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

A empresa trabalhava com os seguintes administradores em 31/12/2021:

- Intrag DTVM

7. Grupo econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

CPF / CNPJ	Nome
946.135.400-20	Rogério Sebastião Braga
895.065.100-91	Wagner Faccini Salaverry
006.831.649-61	Marcel Mitsuo Kussaba
018.922.680-35	Matheus Vacaro Gallina
026.000.537-19	Ivo Chermont Prochnik Lessa de Vasconcellos
019.146.490-28	João Souza Fernandes
836.288.860-15	Vinicius Piccinini
024.831.500-55	Lucas da Silva Monteiro
011.432.190-66	Daniela de Almeida Alliatti
861.948.870-87	Louise Gabrielle Scheid

b. Controladas e coligadas

Não aplicável

c. Participações da empresa em sociedades do grupo

Não aplicável

d. Participações de sociedades do grupo na empresa

Não aplicável

e. Sociedades sob controle comum

Não aplicável

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.



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

O Comitê Executivo delibera e é responsável pela administração da empresa.

O Comitê de Riscos e Compliance tem como principais atribuições:

- Deliberar sobre as políticas e manuais da Quantitas, sua implementação e revisão;
- Definir as políticas, controles e diretrizes a serem seguidas pela área de riscos e compliance;
- Discutir e avaliar os modelos de risco e os controles internos, discutir os resultados obtidos pelos backtests realizados e os cenários de stress vigentes; e
- Avaliar a efetividade e conformidade do Gerenciamento de Riscos voltado à gestão de carteiras, propondo e aprovando limites de riscos de mercado, de liquidez, de crédito e operacional.

O Comitê de Investimentos em Crédito Privado terá as seguintes atribuições:

- Deferir limites de concentração de risco global para instituições financeiras e outros emissores não-financeiros, principalmente, no mercado de capitais;
- Avaliar e aprovar isoladamente operações, simples ou estruturadas, se assim o comitê desejar;
- Propor alçadas e deferir limites a serem obedecidos na realização das operações em tela;
- Acompanhar os créditos concedidos e aprovados anteriormente e deliberar sobre ajustes, revisões, eventuais fatos relevantes e assim por diante.

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

O Comitê Executivo é composto pelos 04 (quatro) diretores e é reunido sempre que algum dos participantes julgar necessário. Suas decisões são registradas em ata assinada pelos membros presentes.

O Comitê de Riscos e Compliance é composto pelo diretor da Área de Operações, Administração, Riscos e Compliance, um segundo diretor, de Gestão de Recursos, e um

membro da Área de Riscos e Compliance, podendo também ser convidados o diretor de Distribuição e Suitability, o Economista-Chefe e/ou um membro da Área de Análise de Investimentos. É reunido semestralmente ou, extraordinariamente, sempre que ocorrer alguma mudança relevante no cenário básico ou demandado por algum de seus participantes. Suas decisões são registradas em ata assinada pelos membros presentes.

O Comitê de Crédito Privado é composto por 3 Diretores Executivos e pelo Analista de Investimentos responsável pela análise do ativo em pauta. Ele é reunido sempre que um novo ativo de crédito privado é analisado, pois a empresa não negocia ativos desta natureza sem prévia definição de limite. Suas decisões são registradas em ata assinada pelos membros presentes.

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

A Administração será exercida por no mínimo 02 (dois) e no máximo 04 (quatro) administradores, sócios ou não sócios, observadas as disposições dos artigos 1061 e 1062 do Código Civil, eleitos por Reunião de Sócios, com a designação de Diretor salvo se outra lhe for conferida no ato da eleição. O prazo de gestão e a remuneração serão fixados no ato de eleição. Os administradores são dispensados de prestar qualquer garantia, real ou fidejussória, para assumir a gestão, mas respondem individualmente perante a Sociedade por ato doloso no desempenho de sua função.

Compete a cada Diretor individualmente e a todos em conjunto a prática dos atos de gestão e fiscalização das atividades sociais, traçando as diretrizes dos negócios e da administração da Sociedade. Qualquer Diretor terá a atribuição de fazer cumprir as diretrizes dos negócios e administração da Sociedade e sua política econômico-financeira. Em caso de renúncia ao cargo de Administrador, deverá ser comunicada em Reunião de Administradores por documento escrito, e após, submetida a reunião de sócios. O administrador eleito permanecerá no exercício de suas funções até a data em que seu substituto assuma o cargo.

Os Diretores, nomeados para exercer as funções por prazo indeterminado são:

- Rogério Sebastião Braga - Responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários
- Wagner Faccini Salaverry - Responsável pela atividade de Distribuição de cotas de fundos investimentos
- Marcel Mitsuo Kussaba - Responsável pela área de pesquisa de ações e crédito nos fundos de investimento dos quais a Sociedade seja gestora.

- Daniela de Almeida Alliatti - Responsável pelo cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e pela gestão de risco.

A sociedade será representada:

- por um único diretor:
 - a) quando em juízo;
 - b) perante quaisquer repartições públicas, autarquias, empresas públicas ou mistas, salvo quando os contratos firmados com tais entidades sejam de natureza comercial, hipótese que deverão obedecer a representação disposta abaixo;
 - c) para firmar correspondências que não importem em obrigação ou liberação de obrigação em relação à sociedade;
 - d) para endossar títulos para efeito de cobrança ou depósito em conta de titularidade da sociedade;
 - e) para contratar operações com instituições financeiras e equiparadas representando cliente da sociedade.
- por dois diretores, ou um diretor e um procurador:
 - a) para contratar financiamentos e outras operações em nome próprio com instituições financeiras e equiparadas;
 - b) para aquisição e venda de imóveis, locação de imóveis, inclusive contratos de arrendamento mercantil (leasing) e a alienação fiduciária em garantia e assinatura de contratos de compromisso para tais operações;
 - c) para firmar contratos e acordos comerciais e qualquer outro ato não especificado no contrato social que implique em responsabilidade ou obrigação da sociedade, ou em exoneração de responsabilidade de terceiros perante a sociedade;
 - d) para movimentação de valores, emissão e endosso de título de crédito, receber e dar quitação; e
 - e) para a outorga de quaisquer garantias a terceiros, a qual dependerá de prévia aprovação por reunião de sócios.

8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item anterior.

8.3. Em relação a cada um dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar:

CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da Posse	Prazo do Mandato	Outros Cargos
946.135.400-20	Rogério Sebastião Braga	40	Empresário	Diretor	09/10/2014	Não tem	-
895.065.100-91	Wagner Faccini Salaverri	42	Empresário	Diretor	16/09/2016	Não tem	-
006.831.649-61	Marcel Mitsuo Kussaba	39	Empresário	Diretor	23/06/2017	Não tem	-
011.432.190-66	Daniela de Almeida Alliatti	31	Administradora de Empresas	Diretora	10/12/2019	Não tem	-
836.288.860-15	Vinicius Piccinini	30	Administrador de Empresas	Analista de Investimento	01/01/2019	Não tem	-
029.038.440-03	Felipe Pastore Bernardi	23	Engenheiro Civil	Analista de Risco e Compliance	20/09/2019	Não tem	-

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

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da Posse	Prazo do Mandato	Outros Cargos	Cursos Concluídos	Certificação Profissional
- Gestão de Carteira	946.135.400-20	Rogério Sebastião Braga	40	Empresário	Diretor	09/10/2014	Não tem	-	-	Isento CGA por ser administrador de carteira CVM
- Gestão de Carteira - Distribuição de Cotas	895.065.100-91	Wagner Faccini Salaverri	42	Empresário	Diretor	16/09/2016	Não tem	-	-	* CPA 20
- Gestão de Carteira	006.831.649-61	Marcel Mitsuo Kussaba	39	Empresário	Diretor	23/06/2017	Não tem	-	-	* CNPI da Apimec * CFA charterholder
- Compliance - Gestão de Risco	011.432.90-66	Daniela de Almeida Alliatti	31	Administradora de Empresas	Diretora	14/01/2020	Não tem	-	-	* CPA 20

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

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade Principal	Data de Entrada	Data de Saída
011.432.190-66	Daniela de Almeida Allianti	Paim Comunicação	Coordenadora Administrativa	Coordenar setor administrativo e responsável pela controladoria	09/2010	10/2013
		Ethilla	Administradora	Administração da Empresa	10/2014	10/2018
		Quantitas Gestão de Recursos Ltda	Analista Administrativo / Controladoria Jr.	Responsável pelo Administrativo	01/2018	01/2020
		Quantitas Gestão de Recursos Ltda.	Diretora	Responsável pelo cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e pela gestão de risco.	01/2020	
006.831.649-61	Marcel Mitsuo Kussaba	Gerdau Banco	Assessor Financeiro	Assessor Financeiro	01/2004	06/2007
		Votorantim Banco	Gerente Comercial	Gerente Comercial	07/2007	04/2008
		Sicredi Banco	Analista de Investimentos Senior	Analista de Investimentos Senior	01/2008	08/2011
		Quantitas Gestão de Recursos Ltda	Sócio Diretor	Diretor responsável pelo risco, compliance, chefe de	05/2011	01/2020
		Quantitas Gestão de Recursos Ltda	Sócio Diretor	Diretor responsável pela gestão de renda variável	01/2020	
946.135.400-20	Rogério Sebastião Braga	Ernst & Young,	Auditoria Externa	Auditoria Externa	01/2000	11/2001
		Banco Sicredi	Portfolio Manager	Portfolio Manager	07/2002	08/2011
		Quantitas Gestão de Recursos Ltda.	Sócio Diretor	Responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários	08/2011	
895.065.100-91	Wagner Faccini Salaverly	Geração Futuro	Analista de Investimentos	Analista de Investimentos na Geração Corretora de Valores	01/1999	
		Geração Futuro	Gerente da Equipe de Análise de Investimentos e, posteriormente, sócio e diretor	Gerente da Equipe de Análise de Investimentos	07/2002	
		Geração Futuro	Sócio e Diretor	Administração de Recursos	01/2006	
		Geração Futuro	Sócio e Diretor	Banco de Investimentos	07/2007	
		Quantitas Gestão de Recursos	Sócio e Diretor	Diretor responsável pela gestão de renda variável e distribuição de produtos da Quantitas	07/2012	

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

a. Quantidade de profissionais: 15

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

- **Análise Econômica**: Tem a responsabilidade de produzir análises de cenários econômicos, em avaliações qualitativas e quantitativas, projetando variáveis macroeconômicas a partir de modelos econométricos proprietários. Dentre as principais

variáveis projetadas, destacam-se os principais índices de inflação e indicadores de atividade econômica, as taxas de câmbio e de juros, nacionais e internacionais.

▪ **Análise de Investimentos:** A área é responsável tanto pelas análises de empresas com objetivo de alocação tanto em ações como em emissores de dívida.

Equity/Ações: a equipe de Análise de Investimentos é responsável pela avaliação de investimento em ações, com a finalidade de produzir recomendações, relatórios de acompanhamento e estudos que auxiliem no processo de tomada de decisão de investimento.

Entre as principais atividades desenvolvidas pela área de Análise de Investimentos podemos citar:

- Análise das Demonstrações Contábeis e Financeiras;
- Análise de índices de retorno e performance;
- Análise de índices de liquidez e capacidade de pagamento;
- Avaliação de Custo de Capital, Estrutura de Capital e Alavancagem; e
- Desenvolvimento de Modelos de Precificação de ações.

Crédito: A equipe de Análise de Investimentos também é responsável por prover todas as informações, pela avaliação dos emissores de dívida e das estruturas de garantias de operações de dívida e parecer técnico no que tange as emissões de crédito privado para o Comitê de Investimentos em Crédito Privado Quantitas.

O parecer técnico é formalizado em relatório de pesquisa enviado eletronicamente para os membros participantes, com pelo menos 24 horas de antecedência à reunião do Comitê. O analista responsável estará à disposição do Comitê para explicações ou questionamentos.

Em eventuais dúvidas jurídicas em relação à emissão ou suas garantias, a Área de Análise de Investimentos poderá requisitar auxílio do assessor jurídico da Quantitas, que emitirá parecer a ser anexado no material.

O relatório de pesquisa produzido tem por objetivo resumir o trabalho de crédito como um todo. Deve ser redigido em linguagem clara, apontando os riscos e o parecer de crédito da Área de Análise de Investimentos. O trabalho de crédito envolve um processo de entrevistas com a administração do emissor, do estruturador (se pertinente), análise qualitativa e quantitativa.

São considerados os seguintes aspectos na avaliação das operações abaixo:

- Ativos com risco de crédito de instituição financeira;
- Ativos emitidos por empresas não financeiras;

Gestão de Renda Fixa Multimercados: fundamentada na produção técnica e modelagem das áreas de Análise Econômica e Análise de Investimentos, é responsável pela decisão de investimento dos fundos de renda fixa e multimercados, além de realizar o monitoramento, proposição e execução de operações e estratégias para os Fundos de Renda Fixa e Multimercados.

A gestão possui foco em ativos de elevada liquidez e baixo risco de crédito. As alocações são fundamentadas nos cenários e análises geradas pelas áreas de análise de investimentos, econômica e modelagem quantitativa. Em cada segmento, Renda Fixa e Multimercados, somente são utilizados ativos e derivativos permitidos pelos normativos legais e regulamentos dos produtos.

Gestão de Renda Variável: estruturada a partir do trabalho da área de Análise de Investimento, que realiza o acompanhamento contínuo do desempenho em bolsa das principais companhias de capital aberto negociadas na Bovespa, avaliando seus resultados trimestrais, notícias e informações divulgadas ao mercado, projetando resultados futuros a partir de premissas fundamentalistas de investimento, utilizando também a produção técnica e modelagem produzida pela área de Análise Econômica da Quantitas, a Gestão de Renda Variável é responsável pelas decisões de investimento dos portfólios de renda variável, além de monitorar e realizar operações e estratégias para os portfólios Multimercados geridos pela Quantitas.

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

São utilizados os seguintes sistemas de informação no apoio à Gestão: Bloomberg, Agência Estado, Wall Street Journal, Financial Times, Valor Econômico, Estadão, Zero Hora, Economática, Eurasia e Up2data.

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: 6

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

No que tange ao atendimento às normas legais e regulamentares e fiscalização dos serviços de terceiros, a área de compliance monitora o enquadramento de todas as normas legais e regulamentares através de processos rotineiros desenvolvidos através de sistemas informacionais e ferramentas auxiliares.

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

Utilizamos o sistema PHIBRA em paralelo aos sistemas dos administradores para geração diária de relatórios de compliance de fundos e carteiras sob gestão da Quantitas. Além disso, utilizamos ferramentas proprietárias adicionais como forma de *double check* dos relatórios de compliance.

Envio destes relatórios para as equipes de gestão, atuando junto destas, demandando os enquadramentos quando necessário.

Acompanhamento periódico pela equipe das novas normas legais e regulamentares emitidas pelos órgãos correspondentes.

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

A Área de Riscos, Compliance e Middle Office está sob a Diretoria de Operações, Administração, Riscos e Compliance, segregada das Diretorias de Gestão. A área possui equipe que responde somente à sua diretoria.

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

a. Quantidade de profissionais: 6

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Geração de relatórios de risco de mercado dos fundos e monitoramento dos limites de riscos de cada um destes respectivamente.

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

Utilizamos sistema proprietário para geração diária de relatórios de risco de mercado do fundos e carteiras sob gestão da Quantitas. Além disso, utilizamos ferramentas proprietárias adicionais como forma de *double check* dos relatórios de risco de mercado.

Também possuímos uma ferramenta interna para simular o risco de possíveis operações, auxiliando a gestão na tomada de decisão.

Diversos relatórios são enviados diariamente para as equipes de gestão, acompanhando alerta em caso de desenquadramento. Os relatórios enviados são:

- **Mapa de Enquadramento:** este documento monitora a aderência dos fundos com a legislação vigente e a política de investimento, incluindo alavancagem operacional, prazo médio dos fundos e posições bloqueadas em margem de garantia. O relatório verifica se os fundos estão enquadrados de acordo com seus regulamentos, além de verificar se cada fundo está observando o limite por emissor conforme estipulado em seu regulamento e pelo Comitê de Crédito Privado.

- **Risco de Mercado:** este relatório apresenta os valores calculados por meio dos modelos proprietários utilizados para a quantificação do risco de mercado ao qual os fundos e carteiras de investimento estão expostos. Todos os modelos são calculados para os horizontes de tempo de 1 e 21 dias úteis. Sendo eles:

- Value at Risk: paramétrico e histórico com 95% e 99% de intervalo de confiança;
- Stress Test: simulação histórica, desde 01/01/2007;
- Tracking Error.

O relatório inclui, também, a distribuição destas métricas de risco calculadas para o fundo, nas suas estratégias e sub-estratégias. Desta forma, está indicado para a equipe de gestão quais são as posições que estão contribuindo para o aumento ou a diminuição do risco em uma posição e no total do fundo.

O risco de mercado é apresentado em valores financeiros, e também como percentual do limite definido para cada carteira, indicando o consumo atual dos limites atribuídos para os fundos e para as suas estratégias.

- **Limite de Liquidez:** Este relatório apresenta o posicionamento dos fundos em cada ativo do segmento BMF em relação aos limites de liquidez diária divulgados pela B3.

Adicionalmente, a área de riscos monitora ativos ao qual não necessariamente há posição em carteira, gerando os seguintes relatórios:

- Monitor de Risco: Apresenta o cálculo das métricas de risco de mercado para ativos de interesse da equipe de gestão.
- Controle de Aluguéis: Estipula uma lista de ativos do mercado à vista, no qual está vedada a venda à descoberto, segundo critérios internos estabelecidos referentes a liquidez.

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

A Área de Riscos, Compliance e Middle Office está sob a Diretoria de Operações, Administração, Riscos e Compliance, segregada das Diretorias de Gestão. A área possui equipe que responde somente à sua diretoria.

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 atividade

Não aplicável.

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

a. Quantidade de profissionais: 3

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A Área de distribuição é responsável pela prospecção, relacionamento e manutenção de investidores para os produtos geridos pela Quantitas. Essencialmente, o foco do trabalho reside junto a investidores de perfil qualificado, notadamente pessoas físicas ou jurídicas consideradas investidores qualificados pela legislação vigente, family offices, fund of funds e investidores institucionais.

A natureza de suas atividades reside, em linhas macro, à:

- A prestação adequada de informações sobre os fundos de investimento e as posições do investidor, esclarecendo suas dúvidas e recebendo reclamações;

- O fornecimento dos documentos dos fundos, termo de adesão e/ou demais documentos obrigatórios;
- O controle e manutenção de registros internos referentes à compatibilidade entre as movimentações dos recursos dos clientes e sua capacidade financeira e atividades econômicas, nos termos das normas de proteção e combate à lavagem de dinheiro ou ocultação de bens e direitos;
- O atendimento aos requisitos da legislação e da regulação e melhores práticas em relação à adequação dos investimentos recomendados (suitability);
- Atender a padrões mínimos de informações aos investidores de acordo com o canal utilizado;

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

Anualmente, serão realizados treinamentos referentes, especificamente, à PLDFT e à Política Suitability.

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

Os profissionais da Área de Distribuição contam com a seguinte infraestrutura para apoio às suas atividades:

- Computadores;
- Tablet;
- Smartphone com acesso à internet e e-mails corporativos, para garantir o imediato atendimento aos clientes;
- Softwares específicos, abaixo relacionados;

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

A equipe envolvida na Distribuição utiliza os seguintes sistemas:

- PHIBRA, para cadastro interno dos investidores, registro das operações e acompanhamento gerencial das posições dos investidores, bem como para a geração de relatórios.
- NetBol, sistema disponibilizado pelo administrador para boletagens das operações dos investidores e cadastro dos clientes junto aos administradores.
- Economatica: para acompanhamento do mercado e de outros fundos.

- Pipedrive: CRM utilizado pelo comercial.
- Data Engine: para verificação das informações cadastrais dos cotistas.

As rotinas e procedimentos incluem, quando da aplicação de um novo investidor, a confecção das fichas cadastrais e procedimentos exigidos pelos administradores dos fundos.

Periodicamente, a área efetua as aplicações e resgates dos investidores de acordo com solicitações formalizadas por e-mail, bem como encaminha relatórios e extratos das posições dos mesmos, de acordo com as demandas e periodicidades acordadas.

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 empresa trabalha, essencialmente, com taxas de gestão, incidentes sobre o patrimônio líquido do fundo e taxas de performance.

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 dos clientes, durante o mesmo período, em decorrência de:

- a. Taxas com bases fixas: 56,68%
- b. Taxa de performance: 43,32%
- c. Taxa de ingresso: 0%
- d. Taxa de saída: 0%
- e. Outras taxas: 0%
- f. Total: 100%

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

Não aplicável.

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

A Quantitas possui contratos com cada corretora com que negocia valores mobiliários, onde estão disciplinados os descontos de corretagem.

Todos os custos de transação são incorporados aos resultados de cada estratégia e de cada trader. Portanto, uma vez que o objetivo é maximizar os resultados, cada trader e gestor possuem o incentivo de buscar operar com os menores custos de transação.

Por fim, através de sistema proprietário e com redundância via sistema PHIBRA, a Área de Compliance concilia diariamente os custos de corretagem cadastrados nos sistemas com aqueles lançados pela clearing e pelo administrador dos fundos. Havendo divergência, é identificada a causa e são tomadas as providências para correção dos problemas.

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

Presentes em dinheiro, em qualquer montante, não podem ser aceitos.

- Presentes com valor estimado de até R\$ 500,00 (quinhentos reais) ou menos podem ser aceitos, caso o fato de recusar o presente prejudique o relacionamento, e as circunstâncias sejam apropriadas quando os fatores de conflito de interesse enumerados acima são levados em consideração.

- Presentes com valor estimado superior a R\$ 500,00 (quinhentos reais) não podem ser aceitos pelo funcionário. O presente deverá ser encaminhado à Diretoria, para que seja sorteado entre os membros da equipe.

Em nenhuma hipótese, entretanto, os funcionários podem receber presentes ou qualquer coisa de valor de clientes ou fornecedores atuais ou em perspectiva se houver uma intenção de corrupção.

Os funcionários estão proibidos, em nome da Quantitas, de dar, oferecer ou prometer qualquer coisa de valor a um funcionário de outra instituição financeira ou de natureza diversa com relação à realização de qualquer negócio se houver uma intenção de corrupção.

O único tipo de soft dollar que a área de gestão aceita em nome da empresa são os sistemas de informação e trading DMA, que podem ser pagos pelos brokers, dependendo do tipo de mercado e estratégia (quantitativa, por exemplo) que é utilizada. Neste caso, a empresa objetiva sempre buscar o melhor retorno possível para os seus clientes/cotistas.

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

Para fins de definição, considera-se “incidentes internos” falhas ou problemas relacionados a: e-mails, energia elétrica, dados de rede e sinal internet e telefone. Para cada um desses itens a Quantitas desenvolveu e/ou contratou medidas que visam mitigar os impactos e controlar os riscos, conforme abaixo.

- E-mail: A Quantitas possui seus e-mails hospedados em nuvem, possibilitando um maior nível de segurança e possibilidade de acesso pelos funcionários em qualquer localidade.
- Energia Elétrica: A Quantitas possui um Nobreak HP10000 -10kva TI em seu próprio CPD, protegendo de uma possível queda de energia que possa ocorrer. Em caso de falta na energia elétrica, a área de TI orienta a equipe de quais computadores devem ser desligados, permanecendo ligados apenas o servidor e os computadores das áreas essenciais para a operação, com o intuito de maximizar o tempo de autonomia do Nobreak.
- Dados de rede: A Quantitas realiza backup diário de todas as informações que constam no servidor. O backup é realizado em fitas e em HDs externos. O último backup do mês é armazenado em local externo ao escritório da empresa. Além disso, a Quantitas possui backup em tempo real em nuvem, com o intuito de garantir que maiores problemas no escritório não prejudiquem os dados da empresa, além de permitir acesso imediato de qualquer localização.

- Internet e telefone: A Quantitas possui redundância na contratação de serviços de internet e telefone, com o objetivo de permanecer em operação caso algum dos fornecedores fique com o serviço indisponível. A empresa possui 2 provedores de telefone e 3 de internet.

Em caráter extraordinário e a qualquer momento, em razão de ocorrência de indisponibilidade ou desastre no local de trabalho, a Quantitas dará início imediatamente ao plano de contingência, com a utilização do site de contingência secundário. Em situações de eventuais epidemias e/ou pandemias, que possam desencadear uma quarentena ou cuidados especiais, a Quantitas implementará o trabalho home office.

A responsabilidade pela operacionalização do Plano de Continuidade de Negócios será do Diretor do Administrativo, Risco e Compliance, da área de TI e da Inftech (empresa terceirizada).

Utilização do site de contingência secundário

Para as situações em que a sede da Quantitas esteja indisponível, será utilizado o site de contingência, situado na Av. Protásio Alves, 3111, sala 205, em Porto Alegre, que conta com a seguinte infraestrutura:

- Posições de trabalho;
- Internet;
- Telefone;
- Material de escritório em geral.

Toda a infraestrutura de sistemas, serviços e recursos de tecnologia devem ser ativadas no site de contingência secundário como forma de prover um ambiente tecnológico parecido com o original. O sistema Bloomberg deve ter prioridade na ativação. Além disso, ele já está instalado nos notebooks de reserva da empresa.

Caberá à área Administrativa e de Controladoria comunicar a equipe sobre a ativação do site de contingência, para que os colaboradores possam se deslocar no menor prazo possível, e ao fornecedor do site de contingência (Inftech) sobre a necessidade de ativação, solicitando que inicie os procedimentos de liberação do local.

As áreas mais sensíveis, com menor tempo de recuperação de desastres e relevância dentro do objeto fim da empresa, e, portanto, com prioridade para fins de restabelecimento de



suas operações em site secundário são: Gestão de Renda Fixa e Multimercado e Gestão de Renda Variável.

As demais áreas não necessitarão deslocar-se a site secundário de contingência e trabalharão em *home office*, bastando possuir como insumos: celular, computador e acesso à internet.

A restauração da infraestrutura física visa recuperar as instalações da Quantitas para o retorno à normalidade de suas operações. Para isto, um levantamento da situação da infraestrutura após o incidente deverá ser feito para que sejam avaliadas a extensão do incidente e para que se recuperem todos os itens danificados. As cópias de registros como plantas, desenhos, projetos e esquemas elétricos, hidráulicos e logísticos são arquivadas fora do ambiente da empresa para que possam ser recuperados em caso abalos à estrutura física.

O plano de continuidade somente poderá ser desativado quando todos os colaboradores estiverem alocados e executando todas as suas tarefas no site original de trabalho. O mesmo Comitê que ativou o plano irá verificar a normalidade da situação e depois disso irá aprovar a desativação, dando início novamente à árvore de chamada para informar a todos os membros da cascata sobre o retorno à normalidade.

Utilização do trabalho home office

Em situações de eventuais epidemias e/ou pandemias, que possam desencadear uma quarentena ou cuidados especiais, a Quantitas implementará o trabalho home office. O acesso remoto será habilitado, de forma que as pessoas consigam acessar todos os arquivos da rede, além dos sistemas existentes. As ligações telefônicas serão transferidas para os celulares e as reuniões serão realizadas através de um servidor criado em plataforma de comunicação. A equipe de TI prestará toda a assistência de forma a garantir o efetivo funcionamento do plano.

Todos os custos adicionais dos funcionários gerados pelo trabalho home office serão arcados pela Quantitas. Os funcionários deverão preencher o relatório de reembolso, anexar o comprovante da despesa e enviar para que o Administrativo possa efetuar o pagamento;

Após o término do período de quarentena, a Diretoria avaliará a desativação do plano de contingência e comunicará imediatamente a equipe da decisão. Após desativado, o acesso remoto será desabilitado e o trabalho na estrutura física será restabelecido.

Treinamento, teste e revisão do plano

De forma preventiva, visando simular uma situação real, recomenda-se semestralmente a realização de um teste de contingência e obrigatoriamente uma vez ao ano.

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

A Quantitas prioriza investimentos em ativos líquidos com o intuito de diminuir o risco de liquidez de mercado no encerramento das posições, além de propiciar maior agilidade nas mudanças de posições e a consequente proteção nos períodos de maior volatilidade.

O controle e gerenciamento de liquidez das carteiras dos Fundos de Investimento consiste na definição de diretrizes para a composição das carteiras dos fundos, de forma a assegurar a geração de caixa a partir dos ativos existentes na carteira, de acordo com as necessidades de cada fundo de investimento, sem o comprometimento da respectiva rentabilidade.

Os controles realizados e relacionados ao gerenciamento do risco de liquidez são:

- i) Controle da Liquidez dos fundos – verificação se a liquidez dos ativos dos fundos está acima do requerimento mínimo de liquidez e se o fundo está enquadrado em todos os vértices estipulados na Política de Gestão de Liquidez;
- ii) Controle de Liquidez de Ativos de Crédito Privado - com base em métodos de manual disponibilizado pela ANBIMA, é monitorada a liquidez dos ativos de crédito privado sob gestão da Quantitas;
- iii) Controle de Fluxo de Caixa - é definido um valor mínimo de caixa que cada fundo deverá manter para pagar resgates e despesas, e sempre que em D+1 / D+2 / D+3 / D+4 / D+5 a projeção do caixa estiver inferior a este valor, a mesa de operações é alertada para que esteja a par da situação e garanta que o fundo tenha condições de atender aos seus compromissos (o valor mínimo não se trata de uma restrição do fundo, mas sim um valor de segurança utilizado para gerar um alerta);
- iv) Consumo do Limite de Posição Diária B3 - a partir do arquivo disponibilizado pela B3, é acompanhado diariamente quanto do limite de derivativos estipulado pela B3 a Quantitas possui posição, a fim de evitar excesso de concentração e também excesso de chamada de margens por parte da B3 (o que poderia comprometer a liquidez do fundo);

- v) Controle de Venda a Descoberto de Ações - diariamente é gerado um arquivo que, com base nas informações disponibilizadas pelas corretoras, determina ações que, por falta de liquidez, não poderão ser vendidas a descoberto.

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

Formalização cadastral

Com a finalidade de garantir a integridade das operações segundo os padrões éticos requer-se a seguinte documentação mínima:

a) se pessoa física:

- Nome completo, sexo, data de nascimento, naturalidade, nacionalidade, estado civil, filiação, nome do cônjuge ou companheiro, ocupação profissional e entidade para a qual trabalha;
- Endereço eletrônico para correspondência;
- Cópia do documento de identificação, Cadastro de Pessoas Físicas (CPF) e comprovante de residência. Os mesmos documentos são aplicáveis caso existam procuradores;
- Informações acerca dos rendimentos e da situação patrimonial;
- Consulta a banco de dados externo da Data Engine, contemplando:
 - o Dados cadastrais completos;
 - o OFAC – crimes mundiais;
 - o Mídia negativa;
 - o BNMP – Banco Nacional de Mandado de Prisão;
 - o Pessoa Politicamente Expostas relacionadas;
 - o Localizar empresas vinculadas a partir do CPF;
 - o Processos judiciais e administrativos;
 - o Pessoa Politicamente Exposta;
 - o Trabalho escravo;
- Ficha cadastral e de informações Fiscais - PF;
- Declaração de Pessoa Politicamente Exposta ou Investidor Estrangeiro, se aplicável;
- Declaração de Investidor Qualificado ou Profissional;

- Questionário de Perfil do Investidor (Suitability);
- Termo de Adesão; e
- Declaração de Incompatibilidade, quando aplicável.

b) se pessoa jurídica:

- Denominação ou razão social;
- Nomes dos controladores, administradores e procuradores;
- Cópia do Número de identificação do registro empresarial (NIRE), Cadastro Nacional de Pessoa Jurídica (CNPJ), comprovante de endereço;
- Informações acerca da situação patrimonial e financeira;
- Número de telefone e endereço eletrônico para correspondência;
- Atividade principal desenvolvida;
- Cópia do documento de identificação, Cadastro de Pessoas Físicas (CPF) e comprovante de residência do(s) Representante(s);
- Denominação ou razão social de pessoas jurídicas controladoras, controladas ou coligadas;
- Consulta a banco de dados externo da Data Engine, contemplando:
 - o Dados completos;
 - o Processos judiciais e administrativas da PJ;
 - o Quadro de sócios e administradores, incluindo análise completa de cada um;
 - o Mídia negativa da PJ;
 - o Receita federal online;
 - o Ações judiciais datajus;
 - o Trabalho escravo;
- Ficha cadastral e de informações Fiscais;
- Declaração de Investidor Qualificado ou Profissional;
- Questionário de Perfil do Investidor (*Suitability*);
- Cópia do Contrato/Estatuto Social Consolidado, Balanço Patrimonial (referente aos últimos 12 meses), Ata da Eleição da atual Diretoria e Instrumento público ou particular de Procuração com poderes específicos (se houver).
- Termo de Adesão; e
- Declaração de Incompatibilidade, quando aplicável.

No caso de investidores não residentes, o cadastro deve conter, adicionalmente:

- os nomes e respectivos números de CPF/MF das pessoas naturais autorizadas a emitir ordens no Brasil e, conforme o caso, dos administradores da instituição ou responsáveis pela administração da carteira; e
- os nomes e respectivos números de CPF/MF do representante legal e do responsável pela custódia dos seus valores mobiliários no Brasil.

O cadastro dos cotistas ativos devem ser renovadas em intervalos não superiores a 24 meses. Caso a renovação não seja concluída neste prazo, novos aportes nos fundos ficam bloqueados, até que a situação seja regularizada.

Conforme IN CVM nº 301, todos os documentos cadastrais e todos os registros das movimentações deverão ser conservados, à disposição da CVM, durante o período mínimo de 5 (cinco) anos, a partir do encerramento da conta ou da conclusão da última transação realizada em nome do respectivo cliente. Esse prazo pode ser estendido indefinidamente se existir investigação comunicada formalmente pela CVM à pessoa ou instituição.

Conferência das Informações

A documentação e as informações enviadas pelo investidor são validadas, utilizando-se banco de dados externos (Data Engine). Além disso, essa plataforma verifica se há processos em nome da PF ou da PJ, se há mídia negativa vinculada, se é pessoa politicamente exposta, entre outras informações.

Nota: Terá direito ao veto do relacionamento o Diretor de Risco e Compliance, o qual avaliará a exposição ao risco de lavagem de dinheiro e financiamento do terrorismo. Esta avaliação será feita através dos documentos pertinentes ao cadastro do cotista e deve levar em consideração, no mínimo, os seguintes critérios:

- Localização geográfica;
- Tipo de atividade/profissão; e
- Se Pessoa Politicamente Exposta ou Investidor Estrangeiro

Avaliação Interna de Risco - Classificação dos Fundos de Investimento e Canais de Distribuição

Os fundos de investimento possuem um processo de aporte ou resgate de recursos que exige dos clientes uma transferência bancária realizada diretamente de uma conta com mesma titularidade. Nos aportes, o procedimento é concluído se a titularidade da conta em que os

recursos foram transferidos for a mesma cadastrada no administrador. Caso a transferência seja realizada de outro CPF ou CNPJ, os recursos não são aplicados e são estornados para conta de origem. Já para os resgates, os recursos são transferidos para a conta corrente do titular devidamente cadastrada no administrador. Levando em consideração essa característica do fundo de investimento e, adicionalmente, o fato de serem verificadas a compatibilidade financeira entre o aporte realizado e os patrimônio do cotista, consideramos que o risco de LDFT dos produtos fundos de investimentos é baixo.

Quanto aos canais de distribuição utilizados pelos fundos geridos pela Quantitas, a distribuição é realizada de duas formas: direta (feita pela própria Quantitas) e através de plataformas de investimento (via conta e ordem). Levando em consideração o primeiro formato citado, o qual está sob responsabilidade da Quantitas, o risco de LDFT é considerado entre baixo e alto, de acordo com o perfil do cliente, conforme classificação abaixo.

Avaliação Interna de Risco - Classificação dos Clientes

Os clientes que possuem vínculo através da distribuição direta da Quantitas são classificados quanto ao risco de LDFT conforme descrito abaixo:

- Baixo risco de LDFT:
 - Pessoa física que realize movimentações que sejam inferiores a 50% do seu patrimônio declarado em um horizonte de 6 meses ou o equivalente a 50% da sua renda anual em um horizonte de 12 meses;
 - Instituições financeiras;
 - Fundos de investimento abertos.
- Médio risco de LDFT:
 - Pessoa física que realize movimentações que ultrapassem 50% do seu patrimônio declarado em um horizonte de 6 meses ou o equivalente a 50% da sua renda anual em um horizonte de 12 meses;
 - Pessoa jurídica;
 - Fundos de investimento exclusivos;
 - Investidor não residente.
- Alto risco de LDFT:
 - Pessoa Politicamente Exposta
 - Pessoa física vinculada à Pessoa Politicamente Exposta
 - Organização sem Fins Lucrativos

Dependendo do nível de risco de LDFT, alguns controles adicionais devem ser realizados, visando mitigá-los. Para os clientes que possuem baixo risco, são adotados os procedimentos padrões.

Quanto aos clientes que possuem médio risco, em alguns casos, há necessidade de identificar o beneficiário final da operação (vide item 0). Além disso, deve ser realizado acompanhamento detalhado das movimentações com volumes expressivos.

Já os clientes que possuem alto risco de LDFT necessitam ter seu cadastro encaminhado para avaliação do Comitê Executivo. O Comitê, por sua vez, analisará toda a documentação, evidências e pesquisas realizadas pela área Comercial, emitindo um parecer se o cadastro poderá prosseguir ou se será vetado em razão dos riscos envolvidos. Além disso, todas as movimentações realizadas envolvendo PEP serão comunicadas aos devidos órgãos reguladores, conforme estipulado pela legislação.

Identificação do Beneficiário Final

As informações cadastrais relativas a pessoas jurídicas ou fundos de investimento registrados na CVM devem abranger as pessoas naturais autorizadas a representá-los, todos seus controladores, diretos e indiretos, e as pessoas naturais que sobre eles tenham influência significativa, até alcançar a pessoa natural caracterizada como beneficiário final. Excetua-se da obrigação de identificar pessoa natural como beneficiária final as situações previstas na IN CVM 617. Caracteriza-se controle direto ou indireto a participação mínima de 25% (vinte e cinco por cento) da participação.

Acompanhamento

Os responsáveis comerciais monitorar continuamente todas as operações e situações, além de observar possíveis atipicidades, devendo dispensar atenção às seguintes circunstâncias:

- Operações cujos valores se afigurem objetivamente incompatíveis com a ocupação profissional, os rendimentos e/ou a situação patrimonial/financeira de qualquer das partes envolvidas, tomando-se por base as informações cadastrais respectivas;
- Resistência ao fornecimento de informações necessárias para o início de relacionamento ou para a atualização cadastral, oferecimento de informação falsa ou prestação de informação de difícil ou onerosa verificação;

- Informação de mesmo endereço comercial por diferentes pessoas jurídicas ou organizações, sem justificativa razoável para tal ocorrência;
- Informação de mesmo endereço residencial ou comercial por pessoas naturais, sem demonstração da existência de relação familiar ou comercial;
- Solicitação de não observância ou atuação no sentido de induzir funcionários da instituição a não seguirem os procedimentos regulamentares ou formais para a realização de uma aplicação ou resgate em contas de fundos;
- Operações que evidenciem oscilação significativa em relação ao volume e/ou frequência de negócios de qualquer das partes envolvidas;
- Operações cujos desdobramentos contemplem características que possam constituir artifício para burla da identificação dos efetivos envolvidos e/ou beneficiários respectivos;
- Operações cujas características e/ou desdobramentos evidenciem atuação, de forma contumaz, em nome de terceiros;
- Situações em que não seja possível identificar o beneficiário final; e
- Operações que evidenciem mudança repentina e objetivamente injustificada relativamente às modalidades operacionais usualmente utilizadas pelo(s) envolvido(s).

O processo de análise de clientes/transações levará em consideração ainda, além das circunstâncias acima, a reincidência do desenquadramento de perfil histórico de transações.

Qualquer colaborador que suspeitar ou identificar evento conforme natureza acima deverá comunicar imediatamente ao Diretor Risco e Compliance. Este por sua vez deverá analisar e comunicar aos órgãos responsáveis, dentro do prazo estabelecido em normativa, mantendo a confidencialidade sobre o processo.

Responsabilidades

a) O diretor de risco e Compliance é responsável por:

- Implantar e fazer cumprir as regras, procedimentos e controles internos previstos nesta política, com o apoio da Área de Controles Internos, Riscos e Compliance;
- Comunicar quaisquer irregularidades aos órgãos fiscalizadores;

- Implantar e manter programa de treinamento de administradores, empregados e colaboradores que tenham acesso a informações confidenciais, participem de processo de decisão de investimento ou participem de processo de distribuição de cotas de fundos de investimento.
- Avaliar a exposição ao risco de lavagem de dinheiro e financiamento do terrorismo na aprovação de produtos/serviços, parcerias e demais relacionamentos.

b) A área de controles internos, risco e Compliance é responsável por:

- Encaminhar à Administração, até o último dia útil do mês de abril de cada ano, relatório relativo ao ano civil imediatamente anterior à data de entrega, contendo:
 - Identificação e análise das situações de risco de LDFT, considerando as respectivas ameaças, vulnerabilidades e consequências;
 - Tabela com informações relativas ao período anterior, contendo:
 - Número consolidado das operações e situações atípicas detectadas;
 - Número de análises realizadas;
 - Número de comunicações realizadas referentes a operações suspeitas;
 - Verificação se o processo estabelecido está sendo aplicado de forma adequada e se está atingindo seu objetivo;
 - As recomendações a respeito de eventuais deficiências, com o estabelecimento de cronogramas de saneamento, quando for o caso;
 - A manifestação do diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários ou, quando for o caso, pelo diretor responsável pela gestão de risco a respeito das deficiências encontradas em verificações anteriores e das medidas planejadas, de acordo com cronograma específico, ou efetivamente adotadas para saná-las;
- Comunicar à administração sobre a ocorrência de eventos ou mudança de procedimentos de prevenção à lavagem de dinheiro;
- Preparar e ministrar treinamento de prevenção à lavagem de dinheiro;
- Aplicar avaliação de exposição ao risco de lavagem de dinheiro e financiamento do terrorismo na aprovação de produtos/serviços e parcerias;
- Monitorar controles estabelecidos por esta política.

c) Os acionistas, administradores e colaboradores são responsáveis por:

- Desempenhar suas atividades, independente de cargo ou função que exerça, em conformidade com as diretrizes previstas neste documento e no Regulamento de conduta e investimentos pessoais dos Stakeholders da Quantitas, estando ciente das sanções previstas;
- Participar dos treinamentos elaborados pela Área de Controles Internos, Riscos e Compliance.

d) A área de distribuição é responsável por:

- Manter atualizados os modelos de fichas cadastrais e demais fichas utilizadas no processo;
- Cadastrar os clientes nos sistemas, após disponibilizadas as fichas e documentos completos;
- Arquivar os documentos dos clientes na sede da empresa;
- Verificar se o cliente é pessoa politicamente exposta;
- Assegurar que o questionário suitability seja mantido atualizado e seja respeitado na indicação de possíveis aplicações;
- Informar ao setor de Compliance qualquer suspeita de lavagem de dinheiro.

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.quantitas.com.br



11. Contingências

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:

Não há processos em que a empresa figure no polo passivo.

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:

Não há processos em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários figure no polo passivo.

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

Não há contingências.

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:

Não há condenações judiciais, administrativas ou arbitrais contra a empresa.

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:

Não há condenações judiciais, administrativas ou arbitrais contra o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários.



12. Declarações

12.1. Declaração do administrador, atestando

- Que reviu o formulário de referência
- 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)

12.2. Declarações adicionais do administrador, 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

Nada a declarar.

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

Nada a declarar.

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

Nada a declarar.

d. Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

Nada a declarar.



- e. Inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado

Nada a declarar.

- f. Títulos contra si levados a protesto

Nada a declarar.

Porto Alegre, 31 de março de 2022.