

RIO PERFORMANCE GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

(“Sociedade”)

Formulário 15-II

(data-base: 31/12/2019)

1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário:

1.1. O Diretor responsável pela Administração da Carteira de Valores Mobiliários, Sr. Cristiano Rodriguez Pinelli, e o Diretor Responsável pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos, Sr. Felipe e Faria Neves, declaram, por meio desta, que:

a) reviram o formulário de referência objeto do Anexo 15-II à Instrução CVM nº 558; e

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.

Rio de Janeiro, 31 de dezembro de 2019

Cristiano Rodriguez Pinelli,

Felipe e Faria Neves

2. Histórico da Empresa:

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa:

Fundada em maio de 2006 por profissionais com ampla experiência no mercado financeiro, com foco na administração de carteiras de fundos de investimento em ações e multimercados.

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:

- Entrada de sócios: Delano Octávio Jorge Franco e Roberto de Oliveira Hargreaves em nov/14. Carlos Eduardo Olinto em ago/15.

Em nov/14 a Sociedade incorporou a Target Gestão de Recursos Ltda.

b) escopo das atividades:

Não houve alteração no escopo das atividades da Sociedade nos últimos 5 (cinco) anos.

c) recursos humanos e computacionais:

N/A

d) regras, políticas, procedimentos e controles internos:
Elaboração e revisão dos seguintes manuais e políticas internas: Código de Ética e Conduta; Manual de Compliance; Política de Prevenção e Combate à Lavagem de Dinheiro; Manual de Gestão de Riscos; Manual de Gerenciamento do Risco de Liquidez; Metodologia de Suitability; Política de Cadastro e Conheça seu Cliente (KYC); Política de Investimentos Corporativos e Pessoais; Política de Rateio e Divisão de Ordens; Política de Seleção de Prestadores de Serviço; Política de Tomada de Decisão, Seleção e Alocação de Ativos e Plano de Contingência.
3. Recursos Humanos:
3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:
a) número de sócios:
12
b) número de empregados:
01
c) número de terceirizados:
02
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:
Helio Vieira Braz Neto - CPF: 027.593.636-86; Delano Octavio Jorge Franco - CPF: 018.595.677-70 Cristiano Rodriguez Pinelli - CPF: 021.399.547-69 Andre Luiz Querne Peçanha - CPF: 013.881.977-74 Cristiano Cordeiro Ribeiro Moura - CPF: 016.511.197-67
4. Auditores:
4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:
a) nome empresarial:
N/A. A Sociedade não possui empresa de Auditoria contratada diretamente. As empresas de Auditoria são contratadas pelos fundos de investimento geridos.
b) data de contratação dos serviços:
N/A. A Sociedade não possui empresa de Auditoria contratada diretamente. As empresas de Auditoria são contratadas pelos fundos de investimento geridos.
c) descrição dos serviços contratados:
N/A. A Sociedade não possui empresa de Auditoria contratada diretamente. As empresas de Auditoria são contratadas pelos fundos de investimento geridos.
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, as receitas são suficientes 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):

Sim.
5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução:
N/A. A Sociedade atua exclusivamente na categoria de gestor de recursos.
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 Sociedade se dedica exclusivamente à atividade de 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 multimercado, fundos de investimento em cotas de fundos de investimento multimercado e fundos de investimento em ações.
c) tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão:
Ações, derivativos, títulos públicos e títulos privados.
d) se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor:
A Sociedade atua na distribuição de cotas dos fundos sob 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:
N/A
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:
N/A. A Sociedade não possui sociedades controladoras, controladas, coligadas ou sob controle comum.
6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos¹ 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):
Número de investidores total: 1040 Número de investidores em Fundos destinados a investidores qualificados: 7 Número de investidores em Fundos destinados a investidores não qualificados: 1033
b) número de investidores, dividido por:
(i) pessoas naturais: 1019 (ii) pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais): 8 (iii) instituições financeiras: 0 (iv) entidades abertas de previdência complementar: 0 (v) entidades fechadas de previdência complementar: 0 (vi) regimes próprios de previdência social: 0 (vii) seguradoras: 0

¹ Se for o caso, fornecer informações apenas dos investidores dos fundos **feeders**, e não do fundo **master**.

(viii) sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil: 0

(ix) clubes de investimento: 0

(x) fundos de investimento: 13

(xi) investidores não residentes: 0

(xii) outros (especificar): 0

c) recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados):

Recursos sob gestão: R\$ 196.209.147,73

Fundos destinados a investidores qualificados: R\$ 11.368.984,2

Fundos destinados a investidores não qualificados: R\$ 184.840.163,53

d) recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior:

Não existem recursos financeiros sob administração aplicados em ativos no exterior.

e) recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes):

Cliente 1: R\$ 12.428.791,6

Cliente 2: R\$ 9.315.545,00

Cliente 3: R\$ 8.786.888,61

Cliente 4: R\$ 7.375.390,88

Cliente 5: R\$ 6.613.519,83

Cliente 6: R\$ 5.017.218,54

Cliente 7: R\$ 4.592.905,61

Cliente 8: R\$ 4.089.200,2

Cliente 9: R\$ 4.018.677,3

Cliente 10: R\$ 3.439.674,95

f) recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

(i) pessoas naturais: R\$ 160.991.021,19

(ii) pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais): R\$ 13.294.546,4

(iii) instituições financeiras: 0

(iv) entidades abertas de previdência complementar: 0

(v) entidades fechadas de previdência complementar: 0

(vi) regimes próprios de previdência social: 0

(vii) seguradoras: 0

(viii) sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil: 0

(ix) clubes de investimento: 0

(x) fundos de investimento: R\$ 21.923.580,14

(xi) investidores não residentes: 0

(xii) outros (especificar): 0

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

a) ações: R\$ 77.927.934,18

b) debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras: 0

c) títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras: 0,00

d) cotas de fundos de investimento em ações: 0

e) cotas de fundos de investimento em participações: 0

- f) cotas de fundos de investimento imobiliário: 0
g) cotas de fundos de investimento em direitos creditórios: 0
h) cotas de fundos de investimento em renda fixa: R\$ 0,00
i) cotas de outros fundos de investimento: R\$ 118.281.213,55 (Fundos Multimercados)
j) derivativos (valor de mercado):
k) outros valores mobiliários: 0
l) títulos públicos: 0
m) outros ativos: 0

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. A Sociedade não atua como administradora fiduciária.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não existem outras informações relevantes.

7. Grupo Econômico:

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

a) controladores diretos e indiretos:

N/A. A empresa não se insere em nenhum grupo econômico. Formam o bloco de controle da Sociedade os sócios Cristiano Rodriguez Pinelli, André Luis Querne Peçanha, Cristiano Cordeiro Ribeiro Moura e Felipe e Faria Neves.

b) controladas e coligadas:

N/A. A empresa não se insere em nenhum grupo econômico.

c) participações da empresa em sociedades do grupo:

N/A. A empresa não se insere em nenhum grupo econômico.

d) participações de sociedades do grupo na empresa:

N/A. A empresa não se insere em nenhum grupo econômico.

e) sociedades sob controle comum:

N/A. A empresa não se insere em nenhum grupo econômico.

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.:

N/A. A empresa não se insere em nenhum grupo econômico.

8. Estrutura operacional e administrativa:

8.1. Descrever a estrutura administrativa da empresa, conforme estabelecido no seu contrato ou estatuto social e regimento interno, identificando:

a) atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico:

Diretoria: responsável pela representação da Sociedade e execução das deliberações havidas pela Reunião de Sócios.

Departamento Técnico de Gestão: análise de títulos e valores mobiliários a fim de identificar oportunidades de investimento, subsidiando a tomada de decisão e a recomendação de investimentos e operações.

Área Comercial: responsável pela distribuição de quotas dos fundos sob gestão e relacionamento com investidores.

Comitê semanal de gestão e estratégia dos fundos de ações (*stock picking*): avaliação de análises elaboradas internamente e de terceiros sobre as ações cobertas pela área de análise da Sociedade.

Comitê semanal de gestão e estratégia dos fundos macro: discussão com maior profundidade dos cenários econômicos domésticos e externos.

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

Comitê semanal de gestão e estratégia dos fundos de ações (*stock picking*): André Querne, Cristiano Pinelli e Cristiano Moura. Este comitê possui exceção para o fundo Target Rio FIA, conforme previsto na Política de Tomada de Decisão Seleção e Alocação de Ativos.

Comitê semanal de gestão e estratégia dos fundos macro: Carlos Olinto e Delano Franco

Todos os documentos e informações relevantes para o processo de análise e decisão de investimentos são arquivados, em meio eletrônico ou meio físico, nos servidores da Sociedade, pelo prazo mínimo de 5 (cinco) anos.

c) em relação aos membros da diretoria, suas atribuições e poderes individuais:

Cristiano Rodriguez Pinelli: supervisão direta e responsabilidade sobre as atividades de gestão profissional de recursos de terceiros, na qualidade de Diretor de Gestão .

Felipe e Faria Neves: supervisão direta e responsabilidade pelas atividades atinentes à gestão de risco e cumprimento de regras, políticas, procedimento e controles internos e das normas de prevenção e combate à lavagem de dinheiro, na qualidade de Diretor de Risco, Compliance e PLD.

Felipe da Costa Pessanha Silva: supervisão direta e responsabilidade pela distribuição de cotas de fundos de investimento sob gestão da Sociedade e pelo cumprimento das normas de verificação da adequação dos produtos, serviços e operações ao perfil do cliente, na qualidade de Diretor de Distribuição e Suitability.

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:

Nome: Cristiano Rodriguez Pinelli

Idade: 47

Profissão: empresário

CPF: 021.399.547-69

Cargo Ocupado: Diretor de Gestão

Data da Posse: 25/05/2006

Prazo do Mandato: indeterminado

Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: membro de comitês internos.

Nome: Felipe e Faria Neves
Idade: 47
Profissão: Engenheiro
CPF: 023.418.547-37
Cargo Ocupado: Diretor de Controles Internos, Risco e PLD
Data da Posse: 10/05/2016
Prazo do Mandato: indeterminado
Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: membro de comitês internos.
Nome: Delano Octavio Jorge Franco
Idade: 46
Profissão: Bacharel em Ciências Econômicas
CPF: 018.595.677-70
Cargo Ocupado: Sócio
Data da Posse: 30/10/2014
Prazo do Mandato: indeterminado
Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: membro de comitês internos.
Nome: André Luis Querne Peçanha
Idade: 50
Profissão: Engenheiro Civil
CPF: 013.881.977-74
Cargo Ocupado: Diretor
Data da Posse: 25/05/2006
Prazo do Mandato: indeterminado
Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: membro de comitês internos.
Nome: Roberto de Oliveira Hargreaves
Idade: 43
Profissão: Bacharel em Administração
CPF: 028.203.707-13
Cargo Ocupado: Sócio
Data da Posse: 30/10/2014
Prazo do Mandato: indeterminado
Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: Não há
Nome: Cristiano Cordeiro Ribeiro Moura
Idade: 43
Profissão: Bacharel em Ciências Econômicas
CPF: 016.511.197-67
Cargo Ocupado: Sócio
Data da Posse: 01/06/2018
Prazo do Mandato: indeterminado
Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: membro de comitês internos.
Nome: Carlos Eduardo Olinto
Idade: 52

Profissão: Bacharel em Ciências Econômicas
CPF: 004.050.767-03
Cargo Ocupado: Sócio
Data da Posse: 04/08/2015
Prazo do Mandato: indeterminado
Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: membro de comitês internos.
Nome: Felipe da Costa Pessanha da Silva
Idade: 31
Profissão: Administrador
CPF: 123.319.897-10
Cargo Ocupado: Diretor de Distribuição e Suitability
Data da Posse: 19/12/2017
Prazo do Mandato: indeterminado
Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: membro de comitês internos.
8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer:
(i) cursos concluídos:
N/A
(ii) aprovação em exame de certificação profissional:
Isento CGA
(iii) principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
Nome da Empresa:
Sócio fundador da Rio Performance Gestão de Recursos Ltda, onde atua desde maio de 2006.
Cargo e funções inerentes ao cargo:
Diretor responsável pela atividade de gestão: análise de oportunidades de investimento, seleção e alocação de ativos nas carteiras dos fundos sob gestão.
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Gestão profissional de recursos de terceiros.
Datas de entrada e saída do cargo:
Cristiano Rodriguez Pinelli – sócio fundador, atua na Rio Gestão desde 05/2006.
8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos, fornecer currículo, contendo as seguintes informações:
(i) cursos concluídos:
Felipe e Faria Neves é formado em Engenharia de Produção pela Universidade Gama Filho.
(ii) aprovação em exame de certificação profissional:
Não há.
(iii) principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
Nome da Empresa:
Rio Performance Gestão de Recursos Ltda.
Cargo e funções inerentes ao cargo:
Diretor responsável pelos Controles Internos, Risco e PLD: elaboração, manutenção e monitoramento das rotinas e procedimentos internos visando a mitigação de riscos operacionais, de imagem,

regulatórios e das carteiras.
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Gestão profissional de recursos de terceiros.
Datas de entrada e saída do cargo:
Sócio, atua na Rio Gestão desde 05/2006
8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer currículo, contendo as seguintes informações:
(i) cursos concluídos:
Idem 8.5
(ii) aprovação em exame de certificação profissional:
Idem 8.5
(iii) principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
Nome da Empresa:
Idem 8.5.
Cargo e funções inerentes ao cargo:
Idem 8.5
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Idem 8.5
Datas de entrada e saída do cargo:
Idem 8.5
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 currículo, contendo as seguintes informações:
(i) cursos concluídos:
O sócio Felipe da Costa Pessanha da Silva é formado em Administração pela Universidade Veiga de Almeida em 2012.
(ii) aprovação em exame de certificação profissional:
CPA-20
(iii) principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
Nome da Empresa:
Rio Performance Gestão de Recursos Ltda.
Cargo e funções inerentes ao cargo:
Diretor de Suitability e Distribuição: responsável pela atividade de distribuição de fundos de investimento sob gestão da Sociedade e verificação da adequação do perfil do cliente/investidor ao produto.
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Gestão profissional de recursos de terceiros.
Datas de entrada e saída do cargo:
Entrada no cargo em 19/12/2017.
8.8. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:
a) quantidade de profissionais:
7

b) natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:
Análise de títulos e valores mobiliários disponíveis para negociação no âmbito do mercado financeiro e de capitais, visando subsidiar a recomendação de investimentos e operações, bem como a seleção de ativos para composição das carteiras sob gestão e tomada de decisão de investimentos e desinvestimentos.
c) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:
Cyrnel, Bloomberg, Económica, Broadcast e relatórios <i>Sell Side</i> divulgados pelas corretoras contratadas. Os procedimentos inerentes à análise, seleção e tomada de decisão encontram-se descritos na Política de Decisão de Investimentos, Seleção e Alocação de 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:
03
b) natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:
Elaboração, implementação e monitoramento do efetivo cumprimento das rotinas e procedimentos internos visando a mitigação dos riscos inerentes à atividade desenvolvida pela Sociedade, bem como o integral atendimento às normas regulamentares desta atividade.
c) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:
As rotinas e procedimentos envolvidos encontram-se descritos de forma detalhada nos manuais e políticas adotados pela Sociedade, em especial no Manual de Compliance.
d) a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor:
O Diretor de Risco e Compliance dedica-se com exclusividade a estas atividades, possuindo total independência e autonomia para o exercício das suas funções. Além disso, ele possui cadastro como emitente de ordem em todas as corretoras que operamos, garantindo assim a autoridade operacional necessária para o enquadramento dos fundos em casos excepcionais.
8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de riscos, incluindo:
a) quantidade de profissionais:
02
b) natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:
Monitoramento do enquadramento das operações efetuadas nos limites definidos no Manual de Gestão de Riscos adotada internamente, análise dos riscos inerentes às operações pretendidas, checagem das ordens emitidas.
c) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:
Os sistemas de informação, rotinas e procedimentos envolvidos encontram-se descritos nos manuais e políticas adotados internamente, em especial no Manual de Gestão de Riscos da Sociedade.
d) a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor:
A área de Risco e Compliance possui total independência e autonomia para o exercício das suas funções, sendo outorgado ao Diretor de Risco e Compliance a prerrogativa de emissão de ordens para fins de reenquadramento das carteiras em situações especiais.
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:

a) quantidade de profissionais:
N/A
b) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:
N/A
c) a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade:
N/A
8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:
a) quantidade de profissionais:
02
b) natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:
Distribuição de quotas de fundos de investimento e verificação da adequação do perfil dos investidores e potenciais investidores ao perfil do produto.
c) programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas:
Todos os colaboradores da Sociedade são submetidos ao programa de treinamento anual, sendo que ao Diretor de Distribuição e Suitability será dado ênfase os procedimentos a serem observados para fins de disponibilização de informações aos clientes e potenciais clientes e processo de <i>suitability</i> .
d) infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição:
O Diretor de Distribuição e Suitability possui estrutura adequada para o desempenho das suas funções, a saber: 1 computador Dell (com 4 Giga, processador Intel Core i3, <i>Firewall</i> , Antivírus Avast e monitores de 17 polegadas), 2 <i>links</i> de internet (Velox de 20Mbps e Virtua de 60Mbps - <i>links</i> balanceados para contingência), 2 impressoras, 2 números de telefone fixo e 1 celular)
e) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:
São utilizadas planilhas internas para <i>input</i> das informações dos clientes e potenciais clientes e controle de movimentação. Os cadastros são armazenados em PDF na rede e atualizados a cada 2 anos.
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:
Taxas de administração e performance dos fundos.
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: 55,55%
b) taxas de performance: 44,45%
c) taxas de ingresso: N/A
d) taxas de saída: Não houve.
e) outras taxas: N/A
9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:
N/A
10. Regras, Procedimentos e Controles Internos

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

De forma resumida, o processo de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços consiste na avaliação do potencial do contratado em agregar valor às atividades da Sociedade, assim como na verificação da sua regularidade e idoneidade. Os critérios detalhados encontram-se no Manual de Seleção de Prestadores de Serviço.

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

Cada fundo sob gestão possui um controle gerencial de custos de corretagem, os quais são monitorados diariamente.

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

O recebimento de presentes ou quaisquer outros benefícios em valor superior a US\$ 100 deve ser autorizado pela área de Risco e Compliance.

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

Tais planos encontram-se descritos de forma detalhada em manual próprio. De forma resumida, a Sociedade adota as seguintes medidas preventivas de contingência:

Internet: A Sociedade possui contratadas assinaturas da Velox de 20Mbps e Virtua de 60Mbps. Caso um dos fornecedores de internet não esteja funcionando adequadamente, a troca é feita imediatamente, de maneira simples, através da troca da chave do provedor do serviço. Esse processo é feito de forma manual através de acesso ao *Data Center*. Vale ressaltar que o acesso ao Data Center é permitido a integrantes da área de Risco e Compliance da Sociedade.

Dados: É adotada rotina diária de *back-up* feitas por *storage d-link DNS 323* com 2 HDs independentes do servidor, ficando, ainda, uma cópia do *back-up* no servidor. Existem, adicionalmente, 2 HDs portáteis sob rotina de rodízio semanal - uma semana na empresa e uma semana na casa de um dos sócios. Os computadores individuais também contam com *backup* diário, feito pelo sistema Cobian Backup, que armazena os dados no servidor da Sociedade. Este processo garante a manutenção de dados críticos, como relatórios de risco, histórico das operações dos fundos, relatórios administrativos e contábeis, dentre outros.

O rodízio semanal em HD externo é coordenado pelo Diretor de Risco e Compliance. A empresa de TI responsável é acionada na eventualidade de algum problema neste processo, seja de natureza tecnológica ou operacional.

E-mails: O provedor de e-mail é a Weblocal, que mantém seus servidores dentro da IBM, empresa responsável por rodar os sistemas utilizados no controle da segurança. Os sistemas rodam a cada hora ou menos, a depender da frequência de uso do servidor.

Dentre os sistemas utilizados pela IBM podemos mencionar Nimsoft Robot, McAfee Anti-Virus, Passmark SuiteLatest e McAfee Host Intrusion Protection w/Reporting, sempre em suas versões mais atualizadas. Os sistemas atuam de maneira integrada. O Nimsoft Robot é responsável por testar frequentemente falhas de segurança no servidor, ao passo que McAfee Anti-Virus e McAfee Host Intrusion Protection w/Reporting são sistemas de prevenção de intrusões. Já o Passmark SuiteLatest é responsável por *server*, para testar se o *hardware* está com a performance dentro dos padrões.

Além dos controles efetuados pela IBM, a Weblocal efetua *backups* semanais. O *backup* diário dos e-mails é feito pela Rio Gestão, através do sistema Cobian Backup.

Documentos: O administrador fiduciário dos fundos sob gestão da Sociedade possui rotinas internas de contingência dos documentos relacionados aos mesmos. Já a documentação necessária ao funcionamento da Rio Gestão (contratos, cadastros, questionários de *suitability*, documentos de sócios, clientes e aqueles relevantes para o processo de tomada de decisão e alocação de ativos, manuais internos, atas, etc.) são armazenadas digitalmente no servidor e, portanto, estão sujeitas à rotina de *backup* diária e semanal.

Energia: A Sociedade possui um equipamento de *No-Break* de 10KVA que, em caso de falta de energia, faz a recuperação da energia de maneira automática, o que garante a continuidade normal das atividades. A manutenção do mesmo é feita anualmente pela empresa terceirizada de TI. Além disso, o prédio no qual se encontra a Sociedade possui sistema de gerador de energia, com procedimento próprio para a manutenção do mesmo.

Telefonia: As corretoras com as quais a Sociedade opera possuem sistema de gravação de ligações telefônicas. Além disso, a maioria das ordens é expedida por plataforma eletrônica. Ordens passadas por telefone fixo se restringem aos casos de utilização de RoboTrader ou contingência. Não é permitida a emissão de ordens pelo telefone celular para os fundos geridos pela empresa quando o colaborador estiver nas dependências da Sociedade.

Processos operacionais: A Sociedade possui um Manual Interno de Processos Operacionais com todas as rotinas diárias necessárias para o funcionamento da empresa. O manual engloba processos de Passivo e Ativo. Pelo menos 2 funcionários estão familiarizados com cada processo; caso ambos estejam ausentes, um terceiro deve ler o manual e seguir o passo a passo para realizar a tarefa pretendida.

Sistemas: Os sistemas provedores de informação (Bloomberg *Anywhere*, Broadcast e AENews, CMA, gestão de risco (Cyrnel), dados (Economática), o sistema do administrador dos fundos e o sistema de corretoras são independentes e possuem base de dados externa, o que permite que a equipe tenha acesso aos mesmos fora da sede, possibilitando a continuidade das atividades em caso de problema pontual. A contingência é efetuada pelos próprios provedores dos sistemas.

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

O Gerenciamento de Risco de Liquidez das carteiras geridas pela Sociedade é realizado semanalmente, periodicidade na qual são realizados testes de estresse para fins de verificação da aderência aos limites estabelecidos.

Títulos públicos federais e compromissadas lastreadas nos mesmos, além de CDBs com cláusula de recompra pela curva, são considerados imediatamente liquidáveis. Investimentos em fundos possuem liquidez ditada pelas regras de resgate.

Para os demais ativos, supõe-se ser possível o desfazimento de posições à ordem de 20% do volume de cada mercado, a cada dia, sem pressões relevantes sobre preços. A projeção de volume diário corresponde a 50% da mediana do valor negociado em um período móvel de 90 dias. O fator de 50% é utilizado por conservadorismo, de forma a contemplar períodos de crise, quando os volumes dos mercados tendem a sofrer quedas abruptas. Caso o ativo não seja negociado em bolsa, ou não seja

possível obter a estimativa do volume diário (por exemplo, no caso de ofertas públicas iniciais), o Diretor de Risco e Compliance determinará de forma discricionária e conservadora o critério a ser utilizado.

Caso precise de mais detalhes a Sociedade possui Manual de Gerenciamento de Risco e Liquidez próprio.

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:

A Sociedade possui metodologia própria de *suitability* a fim de verificar se o produto, serviço ou operação é adequado aos objetivos de investimento do cliente; verificar se a situação financeira do cliente é compatível com o produto, serviço ou operação e verificar se o cliente possui conhecimento necessário para compreender os riscos relacionados ao produto, serviço ou operação.

Ademais, possuímos também uma Política de Cadastro e Conheça seu Cliente com o objetivo identificar o real beneficiário das operações propostas e realizadas pela Sociedade para fins de gestão profissional de recursos de terceiros, mitigando o risco da Sociedade ser envolvida em esquemas de fraudes, lavagem de dinheiro e/ou financiamento de atividades criminosas/terrorismo.

Este procedimento é essencial para identificar se há suspeita de vinculação do cliente/investidor com atividades criminosas e classificá-lo para fins de prevenção à lavagem de dinheiro, em função dos potenciais riscos que este possa trazer à imagem e reputação da Sociedade.

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://riogestao.com.br/politicas/>

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:

a) principais fatos:

N/A

b) valores, bens ou direitos envolvidos:

N/A

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 tenha figurado no polo passivo e tenham afetado sua reputação profissional, indicando:

a) principais fatos:

N/A

b) valores, bens ou direitos envolvidos:

N/A

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

N/A

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:

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 negócios ou sua reputação profissional, indicando:

a) principais fatos:

N/A

b) valores, bens ou direitos envolvidos:

N/A

12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, atestando:

Por meio desta, o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários da sociedade declara que:

a) não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pela CVM, pelo Banco Central do Brasil, pela Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou pela Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC;

b) não foi condenado 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 está impedido de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa;

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

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

f) não tem contra si títulos levados a protesto;

g) nos últimos 5 (cinco) anos, não sofreu punição em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, do Banco Central do Brasil, da Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC;

h) nos últimos 5 (cinco) anos, não foi acusado em processos administrativos pela CVM, pelo Banco Central do Brasil, pela Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou pela Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC.

Rio de Janeiro, 31 de dezembro de 2019

Cristiano Rodriguez Pinelli