



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

# Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 07.807.954/0001-50

Nome do Administrador de Carteira: RIO PERFORMANCE GESTÃO DE RECURSOS LTDA

Ano de competência: 2021

## 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. Principais eventos societários tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário

Não houve eventos dessa natureza neste período.

#### b. Escopo das atividades

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

#### c. Recursos humanos e computacionais

Dentre as últimas alterações relevantes nos cinco anos, cabe citar:

- Maio/2021: O sócio André Luis Querne Peçanha assumiu o cargo de Diretor de Gestão da Sociedade.

Não houve alterações relevantes nos recursos computacionais da Sociedade, os quais encontram-se em constante atualização.

#### d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos

A Sociedade possui regras, políticas, procedimentos e controles internos definidos em seus manuais e políticas, quais sejam: 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 Certificação Política de Tomada de Decisão, Seleção e Alocação de Ativos e Plano de Contingência. Os controles internos são revisados periodicamente.

## 3. Recursos Humanos

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

#### a. Número de sócios:

12

#### b. Número de empregados:

3

#### c. Número de terceirizados:

2



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

| CPF            | Nome                          |
|----------------|-------------------------------|
| 021.399.547-69 | CRISTIANO RODRIGUEZ PINELLI   |
| 013.881.977-74 | ANDRE LUIS QUERNE PECANHA     |
| 021.419.177-00 | GYORGY FERENC PAVETITS JUNIOR |

### 4. Auditores

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

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

| Nome empresarial | Data da contratação | Descrição |
|------------------|---------------------|-----------|
|------------------|---------------------|-----------|

### 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

**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)**

Não

**5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução (A apresentação destas demonstrações financeiras e deste relatório é obrigatória apenas para o administrador registrado na categoria Administrador Fiduciário, subcategoria Capital Mínimo, de acordo com o inciso II do § 2º do art. 1º.):)**

**Demonstração Financeira:** Não se aplica

**Relatório:** Não se aplica

### 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.



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

**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 e títulos públicos.

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

Sim

**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**

A Sociedade se dedica exclusivamente à gestão profissional de recursos de terceiros.

**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 fundo e carteiras administradas geridas pela empresa, fornecendo as seguintes informações**

|                           | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|---------------------------|---|---|-------|
| a. Número de investidores | 22  | 5587  | 5609  |



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

| b. Número de investidores, dividido por:                      | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|---|---|---|-------|
| i. Pessoas Naturais   | 0   | 5572  | 5572  |
| ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)     | 0   | 14  | 14    |
| iii. Instituições Financeiras                                 | 0   |   | 0     |
| iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar             | 0   |   | 0     |
| v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar             | 0   |   | 0     |
| 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                                     | 21  |   | 21    |
| xi. Investidores não Residentes                               | 0   |   | 0     |

| xii. Outros | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|-------------|---|---|-------|
| XXXX        | 1   | 1   | 2     |

|       | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total |
|-------|---|---|-------|
| Total | 22  | 5587  | 5609  |

|   | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total              |
|---|---|---|--------------------|
| c. Recursos financeiros sob administração | R\$ 26.909.943,24   | R\$ 0,00  | R\$ 207.957.855,77 |

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

R\$ 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**



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

| Valor            | Nome |
|------------------|------|
| R\$ 7.170.967,49 |      |
| R\$ 7.021.474,39 |      |
| R\$ 6.923.512,42 |      |
| R\$ 6.135.268,62 |      |
| R\$ 4.510.416,75 |      |
| R\$ 4.325.279,85 |      |
| R\$ 3.814.188,37 |      |
| R\$ 3.235.308,80 |      |
| R\$ 3.120.581,00 |      |
| R\$ 3.023.979,40 |      |

### 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\$ 0,00  | R\$ 166.618.160,96  | R\$ 166.618.160,96 |
| ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)     | R\$ 0,00  | R\$ 14.429.751,56   | R\$ 14.429.751,56  |
| iii. Instituições Financeiras                                 | R\$ 0,00  |   | R\$ 0,00           |
| iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar             | R\$ 0,00  |   | R\$ 0,00           |
| v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar             | R\$ 0,00  |   | R\$ 0,00           |
| 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\$ 26.909.943,23   |   | R\$ 26.909.943,23  |
| xi. Investidores não Residentes                               | R\$ 0,00  |   | R\$ 0,00           |

| xii. Outros | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total    |
|-------------|---|---|----------|
| XXXX        | R\$ 0,01  | R\$ 0,01  | R\$ 0,02 |

|       | Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados | Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados | Total              |
|-------|---|---|--------------------|
| Total | R\$ 26.909.943,24   | R\$ 0,00  | R\$ 207.957.855,77 |

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



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

|  |                    |
|--|--------------------|
| a. Ações   | R\$ 74.395.989,04  |
| b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira | R\$ 0,00           |
| c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras                        | R\$ 0,00           |
| 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\$ 0,00           |
| g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios                                 | R\$ 0,00           |
| h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa   | R\$ 0,00           |
| i. Cotas de outros fundos de investimento  | R\$ 133.561.866,73 |
| j. Derivativos (valor de mercado)  | R\$ 0,00           |
| k. Outros valores mobiliários  | R\$ 0,00           |
| l. Títulos públicos  | R\$ 0,00           |
| m. Outros ativos   | R\$ 0,00           |
| Total  | R\$ 207.957.855,77 |

### 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

| CPF/CNPJ           | Nome                        |
|--------------------|-----------------------------|
| 00.002.139/9547-69 | CRISTIANO RODRIGUEZ PINELLI |
| 00.001.388/1977-74 | ANDRE LUIZ QUERNE PEÇANHA   |
| 00.002.341/8547-37 | FELIPE E FARIA NEVES        |

#### b. Controladas e coligadas

| CNPJ | Nome          |
|------|---------------|
| -    | Não Informado |

#### c. Participações da empresa em sociedade do grupo

| CNPJ | Nome          |
|------|---------------|
| -    | Não Informado |

#### d. Participações de sociedades do grupo na empresa

| CNPJ | Nome          |
|------|---------------|
| -    | Não Informado |



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

### e. Sociedades sob controle comum

| CNPJ | Nome          |
|------|---------------|
| -    | Não Informado |

### 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.

Nenhum arquivo selecionado.

## 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 e Cristiano Pinelli. Cada membro possui direito a voto, porém compete ao André Querne, na qualidade de Diretor de Gestão a tomada de decisão de investimentos e desinvestimentos para as carteiras sob gestão.

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

André Luis Querne Peçanha: 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 anterior.

Nenhum arquivo selecionado



### COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

#### 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 |
|-----|------|-------|-----------|-------|---------------|------------------|---------------|
|-----|------|-------|-----------|-------|---------------|------------------|---------------|

#### 8.4. a 8.7. 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 |
|--------------------------------|--------------------|-----------------------------------|-------|------------------|-------------------|---------------|------------------|----------------------------|-------------------|---------------------------|
| 8.7 (DISTRIBUIÇÃO DE COTAS)    | 123.319.897-10     | FELIPE DA COSTA PESSANHA DA SILVA | 34    | ADMINISTRADOR    | SÓCIO             | 21/08/2018    | INDETERMINADO    |                            | ADMINISTRADOR     | -                         |
| 8.5 (COMPLIANCE)               | 00.002.341/8547-37 | FELIPE E FARIA NEVES              | 49    | ENGENHEIRO       | SÓCIO             | 10/05/2016    | INDETERMINADO    |                            | ENGENHEIRO        | ENGENHEIRO                |
| 8.6 (GESTÃO DE RISCO)          | 00.002.341/8547-37 | FELIPE E FARIA NEVES              | 49    | ENGENHEIRO       | SÓCIO             | 10/05/2016    | INDETERMINADO    |                            | ENGENHEIRO        | ENGENHEIRO                |
| 8.4 (ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA) | 00.001.388/1977-74 | ANDRE LUIS QUERNE PEÇANHA         | 52    | ENGENHEIRO CIVIL | DIRETOR DE GESTÃO | 28/05/2021    | INDETERMINADO    | MEMBRO DE COMITÊS INTERNOS | ENGENHEIRO CIVIL  | ISENTO CFG, CGA e CGE     |

#### 8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, fornecer principais experiências profissionais durante os últimos cinco anos, indicando:

**COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

| <b>CPF do Diretor</b> | <b>Nome do Diretor</b>            | <b>Nome da Empresa</b> | <b>Cargo</b> | <b>Atividade principal</b>   | <b>Data de Entrada</b> | <b>Data de Saída</b> |
|-----------------------|-----------------------------------|------------------------|--------------|--|------------------------|----------------------|
| 00.001.388/1977-74    | ANDRE LUIS QUERNE PEÇANHA         | RIO GESTÃO             | SÓCIO        | Sócio fundador e membro do departamento de gestão desde maio de 2006. Diretor responsável pela atividade de gestão: análise de oportunidades de investimento, seleção e alocação de ativos nas carteiras dos fundos sob gestão desde maio de 2021.   | 01/05/2006             |                      |
| 123.319.897-10        | FELIPE DA COSTA PESSANHA DA SILVA | RIO GESTÃO             | SÓCIO        | Sócio e responsável pela área de RI desde novembro de 2014. Diretor de Suitability e Distribuição: responsável pela supervisão da atividade de distribuição de fundos de investimento sob gestão da Sociedade e, consequentemente, coordenação da equipe responsável pelo contato com investidores, bem como responde pela verificação da adequação do perfil do cliente/investidor ao produto (Suitability) desde dezembro de 2017. | 01/11/2014             |                      |



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

|                    |                      |            |       |   |            |  |
|--------------------|----------------------|------------|-------|---|------------|--|
| 00.002.341/8547-37 | FELIPE E FARIA NEVES | RIO GESTÃO | SÓCIO | Sócio Fundador desde maio de 2006. 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 desde maio de 2016. | 01/05/2006 |  |
|--------------------|----------------------|------------|-------|---|------------|--|

### 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

Britech, Bloomberg, Economática, Broadcast e relatórios Sell Side 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 regulamentadores aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:

#### a. Quantidade de profissionais

3

#### 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.



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

### **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 \***

2

#### **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 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**

N/A

#### **c. A indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividades**

N/A

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

#### **a. Quantidade de profissionais**

2

#### **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**



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Todos os colaboradores da Sociedade são submetidos ao programa de treinamento anual, sendo que ao Diretor de Distribuição e Suitability será dada ênfase os procedimentos a serem observados para fins de disponibilização de informações aos clientes e potenciais clientes e processo de suitability.

### **d. Infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos, programas 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, Firewall, Antivírus Avast e monitores de 17 polegadas), 2 links de internet (Oi Fibra de 200Mbps e Virtua de 120Mbps - links 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 input das informações dos clientes e potenciais clientes e controle de movimentação. Os cadastros são armazenados em PDF na rede e atualizados em até 5 anos, de acordo com a avaliação interna de risco adotada pela instituição.

### **8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes**

xx

## **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:**

Taxas de administração e performance dos fundos.

### **9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total aferida 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. Taxa com bases fixas (%):**

66,00

#### **b. Taxa de performance (%):**

34,00

#### **c. Taxa de ingresso (%):**

0,00

#### **d. Taxa de saída (%):**

0,00

#### **e. Outras taxas (%):**

0,00

#### **Total (%):**

100,00

### **9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:**



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

### 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 de 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 Oi Fibra de 200Mbps e Vértua de 600Mbps. 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 aos integrantes da área de Risco e Compliance da Sociedade.

**Dados:** Existem 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 Skymail, 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 Skymail 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 pa



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

### **10.5. Descrever as políticas, as 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 25% 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 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**

Importante: Não é necessária avaliação do administrador a respeito da chance de perda ou do valor que acredita ser efetivamente devedor em caso de eventual condenação.

### **11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, e sejam relevantes para seu patrimônio pessoal, incluindo:**

#### **a. Principais fatos \***

N/A

#### **b. Valores, bens ou direitos envolvidos**

N/A



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

**11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteira de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem o seus negócios ou sua reputação profissional, incluindo:**

**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 no últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que 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

**Declaração do administrador, atestando:**

**Que reviu o formulário de referência**

Marcado

**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)**

Marcado

**Declarações adicionais do administrador, informando sobre**



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

**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**

Mercado

**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**

Mercado

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

**Nada a declarar**

Mercado

**Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito**

**Nada a declarar**

Mercado

**Inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado**

**Nada a declarar**

Mercado

**Títulos contra si levados a protesto**

**Nada a declarar**

Mercado

Data de envio: 31/03/2022 - 15:22:00

Data de impressão: 31/03/2022

Hora de impressão: 15:25:43