



## 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](http://www.cvm.gov.br)

# Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 11.135.763/0001-66

Nome do Administrador de Carteira: SMARTQUANT INVESTIMENTOS LTDA.

Ano de competência: 2023

## 2. Histórico da empresa

### 2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A Smartquant foi devidamente autorizada, por meio do Ato Declaratório nº 11.113, de 18/06/2010, a prestar os serviços de administração de carteira de valores mobiliários, tendo, desde então, focado a sua atuação na gestão de fundos de investimentos 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

Tratam-se de alterações da composição das pessoas físicas integrantes do capital social da Smartquant, conforme descrito a seguir: na 5ª (quinta) alteração contratual datada de 4 de abril de 2017, ocorreu o ingresso do sócio CARLOS AUGUSTO MILANI BERTOZZI, ficando o capital social da Smartquant distribuído da seguinte forma: ANTONIO DOMICIANO DA SILVA FILHO, MICHELINA BONTEMPO e CARLOS AUGUSTO MILANI BERTOZZI como titulares, respectivamente, de 94% (noventa e quatro por cento), 4% (quatro por cento) e 2% (dois por cento) da totalidade das cotas.

#### b. Escopo das atividades

A administração de carteira de títulos, valores mobiliários, fundos de investimento ou outros ativos, próprios ou de terceiros, de pessoas físicas ou jurídicas, no Brasil ou no exterior.

#### c. Recursos humanos e computacionais

Recursos humanos: 3 (três) sócios, dos quais 1 (um) é o Diretor de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, 1 (uma) é a Diretora de Compliance, Diretora de Risco e Diretora de Prevenção da Lavagem de Dinheiro e 1 (um) é o analista interno de administração de carteira de valores mobiliários.

Recursos Computacionais: 8 Estações de trabalho para todos os usuários (CPU, Monitor, Mouse, Teclado, Ramal telefônico, Mesa e Cadeira); 2 Links de Internet; e 1 Impressora a Laser.

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

A Smartquant possui a totalidade dos Manuais, Políticas e materiais em geral, exigidos nos termos da regulamentação aplicável, presente em sua respectiva página - [www.smartquant.com.br.com.br](http://www.smartquant.com.br.com.br) - na rede mundial de computadores.

## 3. Recursos Humanos

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

#### a. Número de sócios:

3

#### b. Número de empregados:

3

#### c. Número de terceirizados:

3



## 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
065.475.798-40	ANTONIO DOMICIANO DA SILVA FILHO

### 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)**

Sim

**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 administração de carteira de títulos, valores mobiliários, fundos de investimento ou outros ativos, próprios ou de terceiros, de pessoas físicas ou jurídicas, no Brasil ou no exterior.



## 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.)**

Atualmente, encontra-se sob a gestão da Smartquant, o SmartQuant Fundo de Investimento Multimercado, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 12.284.306/0001-04 ("SmartQuant FIM"), o SmartQuant TRE Fundo de Investimento Multimercado, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 32.300.880/0001-08 ("SmartQuant TRE FIM"), o Smartquant Relativa Fundo De Investimento Multimercado Crédito Privado Investimento No Exterior, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 26.605.617/0001-24 ("SmartQuant Relativa").

### **c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão**

As carteiras integrantes do SmartQuant FIM e SmartQuant TRE FIM são compostas pelos seguintes valores mobiliários: títulos públicos, ações, derivativos listados em bolsa, títulos de renda fixa, swaps e ativos no exterior.

As carteiras integrantes do SmartQuant Relativa são compostas pelos seguintes valores mobiliários: títulos públicos e privados, ações, derivativos listados em bolsa, títulos de renda fixa, fundos de investimento, swaps e ativos no exterior.

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

Não

## **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 gestora não desenvolve outras atividades além da gestão de fundos de investimentos.

### **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**

A gestora não possui sociedades controladoras, controladas, coligadas e ou sob controle.

## **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	5	159	164



## 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	87	87
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	0	2	2
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	3		3
xi. Investidores não Residentes	0		0

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
conta e ordem	2	70	72

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	5	159	164

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 23.860.309,70	R\$ 0,00	R\$ 54.338.838,68

### **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\$ 15.390.334,12	
R\$ 5.291.414,61	
R\$ 3.885.211,09	
R\$ 3.671.206,45	
R\$ 2.204.978,57	
R\$ 2.122.978,46	
R\$ 1.702.741,74	
R\$ 1.607.627,16	
R\$ 1.464.795,50	
R\$ 1.118.062,36	

### 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\$ 29.248.297,59	R\$ 29.248.297,59
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 0,00	R\$ 137.878,35	R\$ 137.878,35
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\$ 7.496.393,18		R\$ 7.496.393,18
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
conta e ordem	R\$ 16.363.916,52	R\$ 1.092.353,04	R\$ 17.456.269,56

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 23.860.309,70	R\$ 0,00	R\$ 54.338.838,68

### 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\$ 521.858,26
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\$ 568.607,16
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\$ 3.554.303,90
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 11.597.356,46
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 2.875.422,89
k. Outros valores mobiliários	R\$ 0,00
l. Títulos públicos	R\$ 33.951.808,55
m. Outros ativos	R\$ 1.400.747,54
Total	R\$ 54.470.104,76

### 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:

Não Aplicável. Não há.

## 7. Grupo Econômico

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

#### a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
11.135.763/0001-66	Smartquant Investimentos Ltda

#### 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

#### e. Sociedades sob controle comum



## 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

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

As principais atribuições do departamento técnico são desempenhadas pelo Diretor de Administração de Valores Mobiliários e pelo analista interno de administração de valores mobiliários, CARLOS AUGUSTO MILANI BERTOZZI, são: (i) a elaboração de estudos e análises de valores mobiliários destinados a embasar as decisões de investimento a serem tomadas pela Smartquant; (ii) a manutenção de relacionamento com os administradores dos fundos de investimento, para o desempenho de atividades relativas a, mas não se limitando à (a) conferência diária das carteiras relativamente à compra e venda de valores mobiliários; (b) conferência diária da evolução do valor das cotas dos fundos de investimento; (c) conferência diária da evolução do benchmark dos fundos; e (d) conferência diária do cômputo das taxas de administração e performance; (iii) acompanhamento dos trâmites de documentação (a) de constituição de novos fundos de investimento; e (b) de assembleias de cotistas, entre outras; (iv) a preparação de (a) cálculos e planilhas para embasamento de decisões de investimento; (b) cálculos de correlação entre preços de valores mobiliários; e (c) planilhas de sensibilidade de preços de derivativos a variações nos preços dos ativos base, dentre outros; e (v) a realização, dentre outras pesquisas necessárias, daquelas que objetivem (a) o levantamento de séries históricas de preços de valores mobiliários; e (b) a busca e compilação em tabelas de dados macro-econômicos domésticos e internacionais.

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

Pela estrutura e forma de atuação da Smartquant Investimentos, as decisões são tomadas de forma dinâmica e sob demanda entre os principais sócios. O Comitê de Risco e Compliance foi criado em abril de 2019 e é composto pela MICHELINA BONTEMPO, Diretora de Compliance, Diretora de Risco e Diretora de Prevenção de Lavagem de Dinheiro e por um estagiário que foi contratado neste mesmo mês. As reuniões do Comitê são realizadas mensalmente e as decisões são registradas em arquivo PDF que ficam disponíveis digitalmente e impressos.

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

A Smartquant tem 4 (quatro) Diretorias. Estas Diretorias, bem como as suas respectivas atribuições, são: (i) Diretoria de Administração de Carteira de Valores Mobiliários, responsável pela atividade da administração de carteira de títulos e valores mobiliários; (ii) Diretoria de Compliance, responsável pelo cumprimento dos manuais, normas, regras de conduta, controles internos e regulamentação e legislação aplicáveis; (iii) Diretoria de Risco, responsável pelo monitoramento, mensuração e ajuste permanentes dos riscos inerentes a cada uma das carteiras de valores mobiliários que administre; e (iv) Diretoria de Prevenção da Lavagem de Dinheiro, responsável pela aplicação das regras que dispõem sobre a identificação, o cadastro, o registro, as operações, a comunicação, os limites e a responsabilidade administrativa referentes aos crimes de "lavagem" ou ocultação de bens, direitos e valores.

### 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

### 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
-----	------	-------	-----------	-------	---------------	------------------	---------------



## 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

### 8.4. 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
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	00.006.547/5798-40	ANTONIO DOMICIANO DA SILVA FILHO	56	Economista	Diretor de Administração de Carteira de Valores Mobiliários	18/06/2010	Indeterminado		Ciências Econômicas	Anbima
8.5 (COMPLIANCE)	135.426.928-40	MICHELI NA BONTE MPO	55	Publicitária	Diretora de Compliance, Diretora de Risco e Diretora de Prev	10/05/2017	Indeterminado		Publicidade e Letras, pela Anhembi Morumbi e USP	Anbima
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	135.426.928-40	MICHELI NA BONTE MPO	55	Publicitária	Diretora de Compliance, Diretora de Risco e Diretora de Prev	10/05/2017	Indeterminado		Publicidade e Letras, pela Anhembi Morumbi e USP	Anbima

### 8.4. a 8.7. 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
----------------	-----------------	-----------------	-------	---------------------	-----------------	---------------

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

#### a. Quantidade de profissionais

2

#### b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Estruturação de propostas de fundos; e  
Identificação, análise, seleção e monitoramento das posições investidas pelo fundo.

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

Sistemas: próprios, por meio de planilhas, e um contratado no exterior que sinaliza a entrada e saída de ordens.  
Rotinas e procedimentos: análise e seleção de ativos; proposição da política de investimento; compra e venda de posições; estruturação de fundos; controle de caixa do fundo; conciliação dos fundos e carteiras; P&L (Receitas & Perdas) do fundo.  
Para investimentos em derivativos, serve-se do sistema desenvolvido pela própria casa de investimentos, fundamentado sobre um modelo quantitativo por nós denominado "Black Box", que identifica ordens com a menor chance de perda e a maior possibilidade de ganho.





## 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

### **8.9. 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**

2

#### **b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes**

É função do Comitê de Compliance a verificação permanente do atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade da Smartquant. Para a realização do trabalho, esta diretoria tem acesso total aos processos que envolvem a gestão das carteiras, bem como aos requerimentos exigidos de toda equipe no Manual de Compliance da Smartquant. Cabe ao Comitê de Compliance da Smartquant o desempenho das seguintes funções: (i) validar todas as políticas, rotinas e procedimentos vigentes na Smartquant, adequando-os, quando necessário, às normas e instruções dos órgãos reguladores; (ii) elaborar e implementar o programa de treinamento dos colaboradores da Smartquant; (iii) assegurar o controle de informações confidenciais; (iv) assegurar a existência de testes periódicos de segurança para os sistemas de informações; (v) monitorar o cumprimento, por todos os colaboradores, das políticas da Smartquant, bem como as leis e normas vigentes; (vi) identificar, administrar e eliminar eventuais conflitos de interesse; e (vii) conduzir a avaliação dos casos em que forem constatados indícios de descumprimento das políticas e normas legais, assim como aplicar as sanções cabíveis; dentre outras.

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

O Comitê de Compliance deve encaminhar às Diretorias integrantes da Smartquant, até o último dia útil do mês de abril de cada ano, relatório relativo ao ano civil imediatamente anterior à data de entrega, contendo: (i) as conclusões dos exames efetuados; (ii) as recomendações a respeito de eventuais deficiências, com o estabelecimento de cronogramas de saneamento, quando for o caso; e (iii) a manifestação do Diretor de Investimentos ou, quando for o caso, pela Diretora 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. Referido relatório deve ficar disponível para a CVM na sede da Smartquant, por um período mínimo de 5 (cinco) anos contado da sua respectiva emissão. Os processos ligados à atividade de compliance são monitorados por meio de documentos, planilhas e procedimentos internos.

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

O Comitê de Compliance exerce as suas funções com independência, possuindo acesso total aos processos que envolvem a gestão das carteiras, e não poderá atuar em funções relacionadas à administração de carteiras de valores mobiliários, à intermediação e distribuição ou à consultoria de valores mobiliários, ou em qualquer atividade que limite a sua independência, na Smartquant ou fora dela.

### **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**

São atribuições do Comitê de Risco o acompanhamento das carteiras no que tange às respectivas políticas de investimento e os fatores de risco.

Cabe ao Comitê de Risco da Smartquant o desempenho das seguintes funções: (i) monitorar, por meio da depuração de dados dos emissores e dados de mercado, os riscos de crédito, preço, liquidez, concentração, contraparte e operacional das carteiras que gerencia;

(ii) elaborar relatórios de preço, liquidez e demais parâmetros, com base em testes quantitativos; (iii) em caso de resultados verificados fora dos parâmetros determinados, desenquadramentos e riscos excessivos, endereçar alertas para à Diretoria de Administração de Carteira de Valores Mobiliários e demais Diretorias da Smartquant.

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



## 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

O Comitê de Risco diariamente verifica a composição da carteira dos fundos de investimentos cujas respectivas carteiras sejam geridas pela Smartquant e a sua conformidade com relação aos limites de concentração definidos nas políticas de investimentos constantes de seus respectivos regulamentos. São utilizados modernos sistemas de monitoramento de exposição ao risco, que, por meio de planilhas, auferem os parâmetros de stress test e VaR, pertinente às carteiras geridas. Tais planilhas são verificadas diariamente e reavaliadas mensalmente.

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

O Comitê de Risco exerce as suas funções com independência, possuindo acesso total aos processos que envolvem a gestão das carteiras, e não poderá atuar em funções relacionadas à administração de carteiras de valores mobiliários, à intermediação e distribuição ou à consultoria de valores mobiliários, ou em qualquer atividade que limite a sua independência, na Smartquant ou fora dela.

### **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**

1

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

Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.

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

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

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

#### **b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes**

Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.

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

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

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

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

## **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 remuneração do gestora é gerada através dos fundos geridos atualmente, Smartquant FIM, cobrança de 2,0 a.a. de Taxa de Administração e 20,0% de performance do que exceder o CDI, Smartquant TRE, com, cobrança de 2,0 a.a. de Taxa de Administração e 25,0% de performance do que exceder o CDI e Smartquant Relativa, com, cobrança de 0,12 a.a. de Taxa de Administração e o fundo não possui taxa de performance.



## 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

### **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 (%):**

99,00

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

1,00

#### **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:**

A Smartquant entende que não há outras informações relevantes a ser divulgadas.

## **10. Regras Procedimentos e Controles Internos**

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

Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.

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

Há o acompanhamento do mercado dos principais prestadores de serviço; o monitoramento das diversas opções para avaliação daqueles que oferecem o menor custo para os volumes transacionados pela nossa gestão; e a revisão permanente destes valores, de forma a reduzir os custos de transação à medida que se adquire escala via aumento dos ativos sob gestão.

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



## 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

Nos termos do Manual de Compliance da Smartquant, é proibido aos integrantes oferecerem ou aceitarem presentes ou outros itens de valor sob circunstâncias em que os próprios integrantes ou clientes ou demais colaboradores possam ser influenciados. Itens de valor incluem dinheiro, títulos, oportunidades de negócios, mercadorias, serviços, descontos em mercadorias ou serviços, entretenimento, alimentos ou bebidas. É proibido aos integrantes, ainda: (i) solicitar para si próprio ou para terceiros qualquer coisa de valor em troca de negócios com a Smartquant ou fornecimento de informação confidencial; (ii) dar ou aceitar dinheiro de clientes, fornecedores, prestadores de serviços, ou qualquer outra pessoa ou entidade com a qual a Smartquant mantenha relacionamento; (iii) utilizar a posição na Smartquant para obter qualquer coisa de valor de um cliente, fornecedor, prestador de serviço, ou qualquer outra pessoa ou entidade com a qual a empresa mantenha relacionamento; e (iv) exceto pelos itens abaixo relacionados, aceitar qualquer coisa de valor de qualquer pessoa ou entidade que mantenha relacionamento com a Smartquant.

Como integrante, é permitido que se aceite: (i) refeições, bebidas, acordos de viagens ou estadia de valor razoável durante o curso de uma reunião ou qualquer outro encontro de negócios; para analisar a razoabilidade do valor, deve se levar em consideração, por exemplo, se estas despesas seriam reembolsadas pela Smartquant como despesas de viagens e negócios; (ii) materiais de propaganda ou promocional, tais como canetas, lápis, blocos de notas, chaveiros, calendários ou outros itens similares; (iii) descontos ou rebates em mercadorias ou serviços que não excedam àqueles disponíveis para outros clientes; (iv) presentes que estejam relacionados a eventos publicamente conhecidos, tais como conferências, eventos desportivos, promoções, casamentos, aposentadorias; e (v) premiações de natureza filantrópica por reconhecimento ou por serviços prestados a uma determinada comunidade. Em caso de recebimento ou da iminência de se receber qualquer coisa de valor de um cliente, fornecedor, prestador de serviço ou qualquer outra pessoa ou entidade com quem a Smartquant mantenha relacionamento e, em circunstâncias que não estejam previstas neste Código, a Diretoria de Compliance deverá ser comunicada, por escrito, para a devida análise.

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

Foi efetuada a contratação de 2 (dois) links de internet, a fim de se criar uma redundância em caso de falha de um dos links. O Plano de Contingência consiste na:

Determinação dos ativos e aplicativos vitais e o plano de contingência para os casos de perda, roubo, furto, incêndio, entre outros, que possam restringir o uso desses equipamentos vitais, dificultando o cumprimento dos deveres da empresa perante seus clientes e

É parte integrante do Plano de Contingência o Plano de Continuidade de Negócios.

O Plano de Continuidade de Negócios é constituído pelos seguintes planos:

Plano de Administração de Crises (PAC): define as responsabilidades de cada membro da equipe envolvida com o acionamento da contingência antes, durante e depois da ocorrência do incidente. Além disso, define os procedimentos a serem executados pela mesma equipe no período de retorno à normalidade;

Plano de Recuperação de Desastres (PRD): define os procedimentos para contingenciamento dos ativos que suportam cada processo de negócio, objetivando reduzir o tempo de indisponibilidade e, conseqüentemente, os impactos potenciais ao negócio; e

Plano de Continuidade Operacional (PCO): define o plano de recuperação e restauração das funcionalidades dos ativos afetados que suportam os processos de negócio, a fim de restabelecer o ambiente e as condições originais de operação, no menor tempo possível.

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



## 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 política de gestão de liquidez segue todas as recomendações da ANBIMA quanto a este assunto, a saber:

### 1) Princípios

**Abrangência:** este manual abrange todos os fundos e carteiras de investimentos abertos sob responsabilidade da Smartquant.

**Melhores Práticas:** o processo e a metodologia deste manual devem seguir as melhores práticas de mercado.

**Comprometimento:** os colaboradores da Iguana, independente de sua função exercida, devem estar comprometidos em seguir as políticas, práticas e controles internos necessários ao cumprimento dessa política.

**Equidade:** todos os fundos e carteiras devem seguir a mesma metodologia, processos e controles quanto ao gerenciamento de riscos, assegurando tratamento equitativo aos cotistas independente do fundo ou carteira que eles possuam com a Smartquant.

**Consistência:** as informações e preços a serem utilizados no processo de gestão de risco de liquidez devem ser obtidos de fontes externas independentes e seguir o princípio da Equidade. Quando da impossibilidade dos dados serem obtidos de fontes externas independentes, a metodologia e premissas de formação do preço devem ser únicas para todos os fundos e carteiras. Os dados privados devem seguir metodologia devidamente documentada para a captura dos mesmos e deve ser passível de verificação por terceiros.

**Compliance:** este manual deve estar em conformidade com as diretrizes da ANBIMA, bem como as metodologias e procedimentos adotados devem ser passíveis de verificação pela área de Supervisão da ANBIMA. **Frequência:** o gerenciamento de risco de liquidez deve ser realizado no mínimo semanalmente.

**Transparência:** tanto este manual quanto visitas para conhecer os procedimentos da Smartquant estão disponíveis a todos os clientes.

**Formalismo:** o processo aqui descrito deve ser seguido pela área de gestão de risco e todos os documentos referentes às suas decisões devem ser guardados.

### 2) Métricas de Liquidez

Mensuramos a liquidez individual dos ativos para determinar a liquidez do fundo.

Quanto ao passivo, calculamos: grau de dispersão do passivo, resgates em condições ordinárias, teste de stress de liquidez. Além disso, estabelecemos a regras para controle do caixa do fundo.

### 3) Desequadramento e Gerenciamento de Efeitos adversos

Estabelecemos os parâmetros e processos para reenquadramento dos fundos nas situações supracitadas

### 4) Processo de gestão de risco de liquidez

Definimos frequência de revisão da política e do comitê responsável pela revisão do Manual de Gestão de Liquidez. Além disso, definimos os procedimentos semanais, o procedimento para guarda da documentação e as responsabilidades do administrador fiduciário.

## **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**

Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.

## **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.smartquant.com.br](http://www.smartquant.com.br)

## **11. Contingências**

Importante: Não é necessário 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 \***

A Smartquant Investimentos não possui qualquer tipo de contingência relevante para seu negócio.

#### **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**

O Diretor Responsável pela Gestão dos Fundos de Investimento não possui qualquer tipo de contingência que afete sua reputação profissional.

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

N/A

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

A Smartquant Investimentos não possui qualquer tipo de contingência relevante.

**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**

A Smartquant Investimentos não possui qualquer tipo de condenação.

**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**

O Diretor Responsável pela Gestão dos Fundos de Investimento não possui qualquer tipo de condenação.

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

N/A

## 12. Declarações

**Declaração do administrador, atestando:**

**Que reviu o formulário de referência**

Mercado

**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)**

Mercado

**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: 25/03/2024 - 15:55:00

Data de impressão: 25/03/2024

Hora de impressão: 15:56:40