



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

ANEXO E DA RESOLUÇÃO CVM N° 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica – Art. 17, II

(informações fornecidas com base nas posições de 30 de setembro de 2025)

GESTORES DE CARTEIRA

1. IDENTIFICAÇÃO DAS PESSOAS RESPONSÁVEIS PELO CONTEÚDO DO FORMULÁRIO

1.1. Declarações dos diretores responsáveis pela gestão de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e desta Resolução, atestando que:

- a. revisaram o formulário de referência
- b. o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, negócios, políticas e práticas adotadas pela sociedade

(i) Thamyris Chiodi Appel, diretora responsável pelo cumprimento das regras, políticas, procedimentos e controles internos da Schonfeld Strategic Advisors (Brazil) Ltda. (“**Schonfeld Brazil**” ou “**Gestora**”), denominada Diretora de Compliance e Riscos, e (ii) Andre Laport Ribeiro, diretor responsável pela atividade de gestão, denominado Diretor Gestor (ou “*Head* da LATAM”), da Gestora declaram que revisaram este Formulário de Referência e atestam que o conjunto de informações aqui contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, negócios, políticas e práticas adotadas pela Sociedade Gestora.

A declaração que trata deste item consta do Anexo I deste Formulário e fica arquivada na sede da Gestora.

2. HISTÓRICO DA SOCIEDADE¹

2.1. Breve histórico da constituição da sociedade

A Schonfeld Strategic Advisors (Brazil) Ltda. foi devidamente constituída em 22 de julho de 2025, com o objetivo de fornecer gestão discricionária de carteiras como parte de um plano para expandir as operações globais de sua controladora registrada na SEC, a Schonfeld Strategic Advisors LLC (“**SSA LLC**”), com sede nos EUA, que atualmente também possui presença regulamentada no Reino Unido, em Hong Kong, Singapura, no Centro Financeiro Internacional de Dubai (DIFC) e no Japão (em conjunto, o “**Grupo Schonfeld**”).

Como operadora de um grupo global multiestratégia, o Grupo Schonfeld está sujeito às seguintes jurisdições regulatórias:

¹ A sociedade deve informar apenas dados relativos à área envolvida na gestão de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

2

- **SSA LLC** está registrada como consultora de investimentos junto à Comissão de Valores Mobiliários dos Estados Unidos (SEC) e é isenta de registro como Consultora de Negociação de Commodities perante a Comissão de Negociação de Futuros de Commodities dos Estados Unidos (CFTC), nos termos da Regra 4.14(a)(10) da CFTC.
- **Schonfeld Strategic Advisors (Hong Kong) Limited (“SSA HK”)** é licenciada pela Comissão de Valores Mobiliários e Futuros de Hong Kong (SFC) para conduzir atividade regulada do Tipo 9 (Gestão de Ativos).
- **SSA SG** é licenciada pela Autoridade Monetária de Singapura (MAS) para atividade de gestão de fundos.
- **Schonfeld Strategic Advisors (UK) LLP (“SSA UK”)** recebeu autorização como Gestora de Fundos de Investimento Alternativo junto à Autoridade de Conduta Financeira do Reino Unido (FCA), com vigência a partir de 1º de março de 2019.
- **Schonfeld Strategic Advisors (DIFC) Limited (“SSA DIFC”)** recebeu autorização como Empresa de Categoria 3C pela Autoridade de Serviços Financeiros de Dubai (DFSA), com vigência a partir de 6 de setembro de 2022.
- **Schonfeld Strategic Management LLC (“SSM”)** está registrada como Operadora de Pool de Commodities perante a Comissão de Negociação de Futuros de Commodities dos Estados Unidos (CFTC), nos termos da Regra 4.7 da CFTC. Além disso, diversos fundos privados assessorados pela SSA estão registrados nos mesmos termos.
- **SFEFOF e SSPFOF** estão registrados como fundos mútuos junto à Autoridade Monetária das Ilhas Cayman (CIMA).

Embora os reguladores do Grupo Schonfeld possam consultar-se entre si, eles operam de forma independente e não realizarão supervisão das entidades listadas acima de forma consolidada.

2.2. Descrever as alterações relevantes pelas quais a sociedade passou nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo:

- a. os principais eventos societários, tais como fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário

Não aplicável, tendo em vista que a sociedade está em fase pré-operacional.

- b. Escopo das atividades

Não aplicável, tendo em vista que a sociedade está em fase pré-operacional. .

- c. Recursos Humanos e Computacionais



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

3

Não aplicável, pois a empresa está em fase pré-operacional

d. Normas, Políticas, Procedimentos e Controles Internos

Não aplicável, pois a Gestora encontra-se em fase pré-operacional.

3. RECURSOS HUMANOS²

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

a. Número de sócios

A Gestora possui, nesta data, 6 (seis) sócios - 5 (cinco) pessoas físicas e 1 (uma) pessoa jurídica.

b. Número de empregados

1³.

c. Número de terceirizados

Não aplicável.

d. indicar o setor de atuação dos diretores responsáveis pela gestão de carteiras de valores mobiliários e os respectivos exames de certificação realizados, para os fins do artigo 3º, III, c/c artigo 4º, III, desta Resolução

- **Alínea d com redação dada pela Resolução CVM nº 167, de 13 de setembro de 2022.**

Sr. Andre Laport Ribeiro, inscrito no CPF sob o nº 899.326.177-68, Diretor Gestor, é inscrito na CVM como gestor de carteiras de valores mobiliários e exerce essa função exclusivamente na Gestora, e possui a certificação CGA (Certificação de Gestores da ANBIMA).

e lista das pessoas físicas que estão registradas na CVM como gestores de carteiras de valores mobiliários e que atuem exclusivamente como agentes, empregados ou sócios da sociedade, e seus respectivos setores de atividade

- **Alínea e com redação dada pela Resolução CVM nº 167, de 13 de setembro de 2022.**

Andre Laport Ribeiro – Diretor Gestor.

²A sociedade deve informar apenas dados relativos à área envolvida na gestão de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.

³A SSA Brazil possui apenas um empregado local. Os demais profissionais que compõem os times de Compliance & Risco, conforme descritos nos itens 8.9.a e 8.10.a, são funcionários globais da Schonfeld.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

4

4. AUDITORES

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

- a. Nome comercial

Não aplicável.

- b. data de contratação dos serviços

Não aplicável.

- c. Descrição dos serviços contratados

Não aplicável.

5. RESILIÊNCIA FINANCEIRA

5.1. Com base nas demonstrações financeiras, atestar:

- a. se a receita proveniente de taxas fixas mencionada no parágrafo 9.2.a é suficiente para cobrir os custos e investimentos da sociedade na gestão de carteira de valores mobiliários

Não aplicável, tendo em vista que a sociedade está em fase pré-operacional.

- b. se o patrimônio líquido da sociedade representa mais de 0,02% dos recursos financeiros sob gestão referidos no item 6.3.c e mais de R\$ 300.000,00 (trezentos mil reais)

Não aplicável, tendo em vista que a sociedade está em fase pré-operacional.

5.2. Demonstrações financeiras e relatório a que se refere o parágrafo 5º do artigo 1º desta Resolução⁴

Não aplicável, tendo em vista que a sociedade está em fase pré-operacional.

6. ESCOPO DAS ATIVIDADES

6.1. Descrever detalhadamente as atividades realizadas pela sociedade, indicando, no mínimo:

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

⁴ A apresentação destas demonstrações financeiras e deste relatório é obrigatória apenas para o gestor registrado na categoria administrador fiduciário, de acordo com o inciso II do parágrafo 2º do artigo 1º.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

5

A Gestora atua na gestão discricionária de carteiras de investimento, no Brasil ou no exterior.

- b. tipos e características de 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 geridas, etc.)

A Gestora criou uma subsidiária local para atuar como gestora de subinvestimento dos veículos de negociação de fundos privados do Grupo Schonfeld. O consultor de investimentos relevante de cada Fundo Offshore celebraria contratos de gestão de subinvestimento com a Entidade Local, dando-lhe total discricionária para investir os ativos dos Fundos Offshore.

- c. Tipos de valores mobiliários sujeitos à administração e gestão

As carteiras geridas pela Gestora investirão principalmente em uma gama diversificada de estratégias de investimento destinadas à diversificação da carteira e à melhoria do retorno. A Gestora emprega uma gama diversificada de abordagens de investimento para aumentar os retornos e diversificar a carteira, incluindo negociação de base, situações especiais, reequilíbrio do índice, longo e curto prazo fundamental, macro e parâmetros de volatilidade de negociação.

A Gestora tem como objetivo gerar retornos de investimento por meio de uma abordagem equilibrada de estratégias discricionárias e sistemáticas. Seu universo de investimentos abrange a exposição a uma ampla gama de classes de ativos, incluindo, entre outros, ações, renda fixa, commodities, câmbio e moedas digitais.

- d. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento dos quais é administrador ou gestor

A Gestora não atuará na distribuição de cotas de fundos de investimento.

6.2. Descrever sucintamente outras atividades desenvolvidas pela sociedade que não a administração de carteira de valores mobiliários, destacando:

- a. os potenciais conflitos de interesse entre tais atividades; e

A Gestora não realizará outras atividades além da gestão de carteira, motivo pelo qual não há potenciais conflitos de interesse a serem apontados.

- b. informações sobre as atividades realizadas por sociedades controladoras, controladas, coligadas e sob controle comum do gestor e os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades.

Schonfeld Strategic Advisors LLC - controladora registrada na SEC com sede nos EUA, fornecendo serviços de gestão de carteira, que atualmente também possui presenças regulamentadas no Reino Unido, em Hong Kong, em Singapura, no DIFC e no Japão — não possui quaisquer conflitos de interesse em



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

6

suas operações. Quaisquer situações potenciais de conflito de interesses entre carteiras geridas pela Gestora e suas partes relacionadas serão tratadas de acordo com os documentos constitutivos dos fundos e/ou os contratos de gestão de carteiras.

7. GRUPO ECONÔMICO

7.1. Descrever o grupo econômico em que a sociedade está inserida, indicando:

a. Controladores diretos e indiretos

A Schonfeld Brasil é controlada pela Schonfeld Strategic Advisor LLC, sociedade de responsabilidade limitada devidamente constituída e existente de acordo com as leis do Estado de Delaware, Estados Unidos da América.

b. subsidiárias e coligadas

Não aplicável.

c. Participações da sociedade em sociedades do grupo

Não aplicável.

d. Participações de sociedades do grupo na sociedade

Schonfeld Strategic Advisors (Brazil) Ltda, foi estabelecida como uma sociedade privada de responsabilidade limitada no Brasil e é uma subsidiária integral da SSA LLC

A SSA LLC é detida pelo Steven B Schonfeld Revocable Trust (54,5% de controle na SSA LLC), pelo Steven B Schonfeld 2011 Delaware Trusts (45% de controle na SSA LLC) e pelo Trust U/A/D 12/12/06 F/B/O (0,5% de controle na SSA LLC).

e. Sociedades sob Controle Comum

- A SSA LLC está registrada como consultora de investimentos na Comissão de Valores Mobiliários e está isenta de registro como Consultora de Negociação de Commodities na Comissão de Negociação de Futuros de Commodities, de acordo com a Norma 4.14(a)(10) da CFTC.
- A Schonfeld Strategic Advisors (Hong Kong) Limited (“SSA HK”) é licenciada pela Comissão de Valores Mobiliários e Futuros de Hong Kong para conduzir atividades regulamentadas do Tipo 9 (Gestão de Ativos). A SSA SG é licenciada pela Autoridade Monetária de Singapura para atividade de gestão de fundos.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

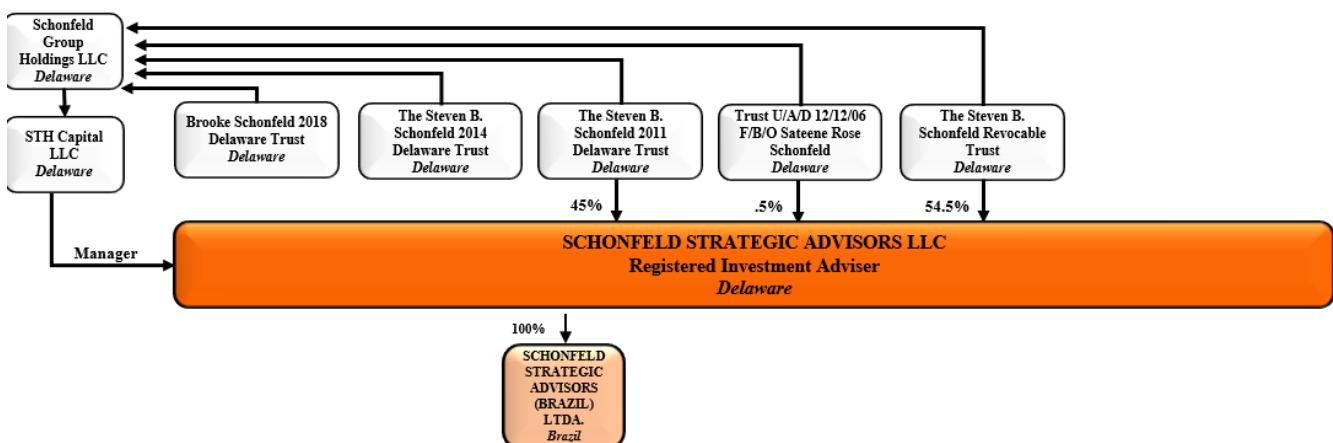
Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

7

- A Schonfeld Strategic Advisors (UK) LLP (“SSA UK”) recebeu autorização como Gestora de Fundos de Investimento Alternativos junto à Autoridade de Conduta Financeira, com vigência a partir de 1º de março de 2019.
- A Schonfeld Strategic Advisors (DIFC) (“SSA DIFC”) Limited recebeu autorização como empresa de categoria 3C junto à Autoridade de Serviços Financeiros de Dubai, com vigência a partir de 6 de setembro de 2022.
- A Schonfeld Strategic Management LLC ("SSM") está registrada como Operadora do Pool de Commodities na Comissão de Negociação de Futuros de Commodities de acordo com a Norma 4.7 da CFTC. Além disso, vários fundos privados assessorados pela SSA são registrados de acordo com tal norma.
- SFEFOF e SSPFOF são registrados como fundos mútuos na Autoridade Monetária das Ilhas Cayman.

7.2. Caso a sociedade assim o desejar, inserir organograma do grupo econômico no qual está inserida, desde que compatível com as informações apresentadas no item 7.1.



Legenda:

Manager
Registered Investment Adviser

Gestora
Consultora de Investimentos Registrada

8. ESTRUTURA OPERACIONAL E ADMINISTRATIVA⁵

8.1. Descrever a estrutura administrativa da sociedade, conforme estabelecido em seu contrato ou estatuto social, identificando:

- a. atribuições de cada órgão, comissão e departamento técnico

⁵A sociedade deve informar apenas dados relativos à área envolvida na gestão de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

8

A Gestora será administrada e composta por, no mínimo, 2 (dois) Diretores, com mandato por prazo indeterminado. São nomeados para os cargos de diretores, nesta data, Andre Laport Ribeiro e Thamyris Chiodi Appel.

A Sociedade não prevê a incorporação de fundos de investimento no Brasil, e todas as suas atividades de gestão de carteira serão fornecidas por meio de acordos com fundos localizados no exterior. Considerando isso, o Diretor de Compliance será responsável pela função de Gestão de Riscos e estabelecerá a função de gestão de riscos do dia-a-dia da Sociedade, que será integrada à estrutura global de gestão de riscos da SSA LLC, sob a responsabilidade do Diretor de Riscos da SSA LLC, Michael Wagg. As políticas e procedimentos de risco são estabelecidos e implementados pelo Diretor de Riscos (CRO) da SSA LLC. A gestão de riscos de contraparte é supervisionado pelo Líder de Finanças de Carteira, que realiza a medição e monitoramento desse risco independentemente da equipe do CRO. Por uma questão de exaustividade, a gestão de risco da contraparte é integrada com a estrutura geral de gestão de risco. Ambos desempenham essa função independentemente do Diretor de Investimentos (“CIO”) e dos profissionais de investimentos da Sociedade.

O Diretor Executivo será responsável pela gestão das carteiras de valores mobiliários sob gestão da Sociedade, nos termos do inciso III do artigo 4º da Resolução da Comissão de Valores Mobiliários (“CVM”) nº 21, de 25 de fevereiro de 2021 (“Resolução CVM 21”).

O Diretor de Riscos e Compliance será responsável pela gestão de riscos das carteiras de valores mobiliários sob gestão da Sociedade, nos termos do inciso V do artigo 4º da Deliberação CVM 21.

- b. em relação aos comitês, sua composição, a periodicidade de realização de suas reuniões e a forma de registro de suas decisões

Não há comitês na Sociedade.

- c. em relação aos membros da Diretoria, suas atribuições e poderes individuais

Consulte o item 8.1, "a", acima.

8.2. Caso a sociedade assim o desejar, inserir organograma da estrutura administrativa da sociedade, desde que compatível com as informações apresentadas no item 8.1.

A Gestora optou por não incluir organograma da estrutura administrativa.

8.3. Em relação a cada um dos diretores referidos nos itens 8.4, 8.5, 8.6 e 8.7 e aos membros dos comitês da sociedade pertinentes à atividade de gestão de carteiras de valores mobiliários, indicar, na forma de tabela:

| Nome | Idade | Cargo | Mandato |
|------|-----------|---------------|--|
| CPF | Profissão | Data da posse | Outros cargos ou funções ocupados na sociedade |



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

9

| | | | |
|--|-------------------|--|---------------|
| Andre Laport Ribeiro | 56 | Diretor Executivo | Indeterminado |
| 899.326.177-68 | Portfolio Manager | 09/10/2025 | não |
| Thamyris Chiodi Appel | 34 | Diretora de Compliance, Riscos e AML/FTP | Indeterminado |
| 371.323.948-78 | Advogada | 09/10/2025 | não |
| 8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela gestão de carteiras de valores mobiliários, fornecer: | | | |
| a. currículo, contendo as seguintes informações: | | | |
| i. cursos concluídos; | | | |
| MBA Executivo, Brown University (EUA) concluído em maio de 2019 | | | |
| OPM, Universidade de Harvard (EUA) concluído em março de 2019 | | | |
| ii. Aprovação no exame de certificação profissional | | | |
| CGA (Certificação de Gestor de Ativos) ANBIMA - licenciado em janeiro de 2025. | | | |
| iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando: | | | |
| <ul style="list-style-type: none"> • Denominação da Sociedade | | | |
| <ul style="list-style-type: none"> • Cargo e funções inerentes ao cargo | | | |
| <ul style="list-style-type: none"> • atividade principal da sociedade na qual tais experiências ocorreram | | | |
| <ul style="list-style-type: none"> • Datas de ingresso e saída do cargo | | | |
| BNP Fortis Bank, Nova York, Diretor Executivo, responsável pela Negociação de Ações (de janeiro de 2002 a março de 2008) | | | |
| Goldman Sachs, Nova York, Diretor Executivo, responsável pela mesa exclusiva da Latin America Equities (de março de 2008 a julho de 2009) | | | |
| Goldman Sachs, São Paulo, Sócio, Líder de Equities, aposentou-se como CEO da Latin America Equities. Foi membro do Comitê Executivo da Goldman Sachs América Latina, do Comitê de Risco de Ações, do Comitê de Risco do Brasil, do Comitê de Padrões de Negócios do Brasil e do Comitê de Gestão do Brasil (de julho de 2009 a outubro de 2016). | | | |



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

10

Vinland Capital, São Paulo, Co-Fundador e CIO, gerindo fundos macro e de ações com sede em São Paulo (de abril de 2018 a setembro de 2024)

8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e pelo cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e desta Resolução, fornecer:

a. currículo, contendo as seguintes informações:

i. cursos concluídos;

Bacharelado em Direito – Pontifícia Universidade Católica de São Paulo, concluído em 2014 (Ordem dos Advogados do Brasil – OAB/SP nº 358.565).

Mestrado (MS) em Direito Penal – Universidade de Coimbra, Portugal, concluído em 2017.

Mestre em Direito, LLM, Direito Penal – Fundação Getulio Vargas concluído em 2019.

ii. Aprovação em um exame de certificação profissional (opcional)

CCEP - Certified Compliance & Ethics Professional.

Certificação Profissional em Compliance Anticorrupção emitida pela Fundação Getulio Vargas (FGV).

Certificação Profissional em Compliance Financeiro emitida pela Fundação Getúlio Vargas (FGV)

iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:

- Denominação da Sociedade
- Cargo e funções inerentes ao cargo
- atividade principal da sociedade na qual tais experiências ocorreram
- Datas de ingresso e saída do cargo

Andre Kehdi e Renato Vieira Advogados, São Paulo, advogada de defesa criminal focada em crimes de lavagem de dinheiro, crimes financeiros, investigações criminais e prática de litígios criminais em tribunais estaduais e federais (de outubro de 2018 a setembro de 2020).

Mendonça e Francez Advocacia Criminal, São Paulo , advogada de defesa criminal responsável por todas as etapas relacionadas ao processo criminal. Elaboração de peças processuais que os advogados precisam fazer em uma investigação criminal e em ações criminais (de fevereiro de 2017 e setembro de 2020 a outubro de 2018 e novembro de 2020).



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

11

César Caputo Sociedade de Advogados, São Paulo, Advogada Associada de Compliance, responsável pela implementação e manutenção de programas de integridade para minimizar riscos e evitar condutas ilícitas: responsável pelo monitoramento e execução do programa de compliance, cronograma de implementação, entrevistas, avaliação de riscos, elaboração de políticas e diretrizes, código de conduta e treinamentos (de dezembro de 2020 a agosto de 2021).

IG4 Capital Investimentos Ltda, São Paulo, Gerente Jurídica e de Compliance responsável por fornecer suporte ao Diretor de Compliance em todos os aspectos relacionados ao cumprimento dos assuntos regulatórios pela IG4 Capital (de agosto de 2021 a setembro de 2025)

8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de riscos, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:

a. currículo, contendo as seguintes informações:

i. cursos concluídos;

ii. Aprovação no exame de certificação profissional

iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:

- Denominação da Sociedade

- Cargo e funções inerentes ao cargo

- atividade principal da sociedade na qual tais experiências ocorreram

- Datas de ingresso e saída do cargo

A Diretora indicada no item 8.5 acima atualmente acumula a função de gestão de riscos.

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, providenciar:

a. currículo, contendo as seguintes informações:

i. cursos concluídos;

Não aplicável.

ii. Aprovação no exame de certificação profissional



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

12

Não aplicável.

iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:

- Denominação da Sociedade
- Cargo e funções inerentes ao cargo
- atividade principal da sociedade na qual tais experiências ocorreram
- Datas de ingresso e saída do cargo

Não aplicável.

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

a. Quantidade de profissionais

3- A área de gestão é composta pelo Diretor de Gestão de Ativos, e por mais dois profissionais de investimentos.

b. natureza das atividades desenvolvidas por seus membros

Ao Diretor de Gestão de Ativos compete a supervisão e coordenação da área de gestão, sendo auxiliado por uma equipe de análise, que, por sua vez, será responsável pela análise detalhada dos setores e empresas.

A equipe é responsável pela análise de investimentos, alocação de ativos e posições das carteiras, dimensionamento de posições e movimentação de compras e vendas. O Diretor de Gestão de Ativos é responsável por definir estratégias e tomar decisões de investimento.

c. os sistemas de informação, rotinas e procedimentos envolvidos

A equipe é responsável pela análise macroeconômica global e local para construção de carteira, alocação e balanceamento das carteiras sob gestão da Gestora, bem como pelo acompanhamento dos investimentos realizados por tais carteiras. A equipe utiliza informações públicas de fontes como ANBIMA, B3, SELIC, Tesouro Direto e CETIP, além de relatórios de instituições de primeira linha e informações econômicas contidas em portais especializados.

Em relação aos sistemas a serem utilizados na gestão de recursos, possui (i) terminais de sistema para consulta de dados financeiros e balanços de sociedades que administra; (ii) e-mails sell-side de corretoras/Bancos de Investimento (acesso a relatórios); e (iii) reuniões com administradores e sócios de



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

13

outras sociedades para discussão de tendências de mercado. As teses de investimento decorrentes dos estudos desenvolvidos pela equipe de gestão são consideradas na tomada de decisão final de seleção e alocação pelo Diretor de Gestão de Ativos.

8.9. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do cumprimento permanente das normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:

- a. Quantidade de profissionais

4 - A área é composta pela Diretora de Compliance, que também será responsável pela área de gestão de riscos, e alavancará os serviços do departamento de Compliance e Risco do Grupo Schonfeld.

A Diretora conta com o apoio de 3 profissionais da Schonfeld Global, dois Diretores de Compliance e um Deputy Chief Compliance Officer, que fornecerão o suporte diário nas diferentes áreas de atuação do Compliance, visando a condução e proteção das atividades da Gestora.

- b. natureza das atividades desenvolvidas por seus membros

O *Diretor de Compliance*, que também é responsável pela gestão de riscos e prevenção à lavagem de dinheiro, tem como funções a verificação da aderência da Gestora às regras aplicáveis previstas tanto nas normas legais quanto em suas *políticas internas de compliance*, além da supervisão geral das atividades da área.

Em suas atividades, a área de *conformidade* se concentrará essencialmente em questões regulatórias da CVM, bem como no monitoramento de obrigações, rotinas e procedimentos previstos em suas políticas internas, inclusive no que se refere à prevenção e combate à lavagem de dinheiro e ao financiamento do terrorismo.

- c. os sistemas de informação, rotinas e procedimentos envolvidos

O Departamento de Compliance é responsável pela elaboração e manutenção do programa de conformidade da Gestora, que inclui a revisão e atualização periódica das políticas e procedimentos constantes do Manual de Ética, bem como o treinamento dos empregados, conforme detalhado no Manual de Ética, disponível no site da Gestora.

Também fazem parte da rotina e dos procedimentos da área: (i) acompanhamento das alterações legislativas e regulatórias, bem como das recomendações da CVM, da ANBIMA e de outros órgãos competentes; (ii) supervisão de equipes internas para garantir o cumprimento da regulamentação, legislação e autorregulação aplicáveis; (iii) acompanhamento de ofícios, cartas de recomendação, ações



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

14

de fiscalização, processos administrativos e/ou judiciais envolvendo a Gestora; e (iv) promoção de medidas de prevenção à lavagem de dinheiro e ao financiamento do terrorismo.

Todo o controle é feito em arquivos e salvo na infraestrutura exclusiva da Gestora, separados por diretórios, cujo acesso é limitado aos Colaboradores que possuem a devida autorização de acesso, de acordo com o nome de usuário pessoal e senha atribuídos a cada Empregado. Tal separação permite à Gestora controlar o acesso e o fluxo de informações entre as equipes e seus respectivos Empregados autorizados.

Além disso, o acesso eletrônico às Informações Confidenciais é controlado pelo usuário atribuído a cada Empregado. No ato do cadastro, a área de compliance é consultada para definição do nível e prerrogativas de acesso eletrônico para o respectivo Empregado. Adicionalmente, em casos de novas solicitações de acesso e/ou alteração de atividade, cargo ou funções do Empregado, a área de compliance deverá ser novamente consultada para confirmação das regras de acesso aplicáveis. Nos casos de desligamento do Empregado, o acesso será imediatamente cancelado.

Considerando que o uso de computadores, telefones, internet, e-mail e outros dispositivos e recursos fornecidos pela Gestora aos seus Empregados são destinados a fins profissionais, como ferramenta para o desempenho das atividades dos Empregados, a Gestora monitora a utilização de tais meios.

Neste sentido, a Gestora:

i. mantém diferentes níveis de acesso a pastas e arquivos eletrônicos de acordo com as funções dos Empregados, e pode monitorar o acesso dos Empregados a tais pastas e arquivos com base na senha e nome de usuário fornecidos;

II. monitora o acesso dos Empregados a sites, blogs, fotologs, webmails, entre outros, bem como aos e-mails enviados e recebidos.

d. como a sociedade garante a independência do trabalho realizado pelo setor

O acesso à rede de informação é controlado e supervisionado pela área de Tecnologia e pelo Diretor de Riscos e Compliance. O Diretor de Riscos e Compliance tem total independência da área de gestão.

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

a. Quantidade de profissionais



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

15

3 - A área é composta pela Diretora de Riscos, que será responsável pelos Departamentos de Risco e Compliance e por um profissional da estrutura Global, Marwan Moubachir. A Diretora contará, também, com o apoio do Chief Risk Officer Global, conforme descrição abaixo.

b. natureza das atividades desenvolvidas por seus membros

O Diretor de Riscos é responsável por coordenar a atividade de gestão de riscos da Gestora, controlar e estabelecer protocolos e rotinas. As principais atividades da área de gestão de riscos são: monitoramento de riscos de carteiras gerenciadas e gestão do desenvolvimento/manutenção de recursos e modelos disponíveis na plataforma de riscos da Gestora.

A Diretora de Risco contará com o suporte e apoio de um profissional de risco, Marwan Moubachir, que será dedicado à análise de risco e ao suporte na elaboração dos documentos e relatórios que deverão ser submetidos ao Diretor de Gestão. Este profissional faz parte do time Global da Schonfeld, reportando Globalmente para o Chief Risk Officer, Michael Wagg e, no Brasil, para a Diretora de Risco.

c. os sistemas de informação, rotinas e procedimentos envolvidos

A área de gestão de riscos da Gestora desenvolve internamente as metodologias de gestão de riscos das carteiras sob gestão da Gestora, utilizando o suporte dos controles internos.

O monitoramento, a mensuração e o ajuste permanente dos riscos da carteira são alcançados pela Gestora por meio de (i) análise e auditoria de emissores sujeitos a investimento; e (ii) implementação de processos de monitoramento de investimentos. Para esses fins, são utilizadas medidas de risco de desempenho como VaR, *teste de estresse* e simulação histórica, entre outras.

Qualquer não conformidade identificada pela área de gestão deve ser imediatamente reportada ao Diretor de Riscos e Compliance, com a posterior elaboração de um plano de ação para reestruturação.

O Diretor de Compliance também será responsável pela função de Gestão de Riscos, e a gestão de riscos do dia a dia será integrada à estrutura de gestão de riscos global da SSA LLC.

Em termos globais, as políticas e procedimentos de risco são estabelecidos e implementados pelo CRO da SSA LLC. O gerenciamento de risco de contraparte é supervisionado pelo Chefe de Finanças de Carteira, que realiza a medição e monitoramento desse risco independentemente da equipe do CRO. Por uma questão de exaustividade, a gestão de risco da contraparte é integrada com a estrutura geral de gestão de risco. Ambos desempenham essa função independentemente do Diretor de Investimentos (“CIO”) e dos profissionais de investimentos da Sociedade.

d. como a sociedade garante a independência do trabalho realizado pelo setor



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

16

O Diretor de Compliance e Riscos tem total independência da área de gestão, podendo, a qualquer momento, questionar os riscos assumidos nas operações realizadas pela instituição e adotar as medidas que julgar necessárias.

8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, controle e processamento de ativos e escrituração de cotas, incluindo:

- a. Quantidade de profissionais

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não realiza tais atividades.

- b. os sistemas de informação, rotinas e procedimentos envolvidos

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não realiza tais atividades.

- c. a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não realiza tais atividades.

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

- a. Quantidade de profissionais

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não realiza tais atividades.

- b. natureza das atividades desenvolvidas por seus membros

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não realiza tais atividades.

- c. programa de capacitação dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não realiza tais atividades.

- d. infraestrutura disponível, contendo uma lista detalhada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não realiza tais atividades.

- e. os sistemas de informação, rotinas e procedimentos envolvidos

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não realiza tais atividades.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

17

8.13. Fornecer outras informações que a sociedade julgue relevante

Não aplicável.

9. REMUNERAÇÃO DA SOCIEDADE

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

A Gestora será remunerada pelos serviços de gestão de investimentos por meio de reembolso de Taxas pelos veículos de negociação de fundos relevantes geridos como parte de um modelo de "repasse". Conforme estabelecido nos documentos de oferta relevantes, as Taxas incluirão itens como remuneração baseada em desempenho cobrada pelas equipes de gestão de carteira da Gestora, salários, despesas operacionais e gerais (como administração de fundos, impostos, custódia, auditoria, jurídico, seguro etc.), pesquisa, corretagem, despesas de custódia e assim por diante.

Modelo de repasse - Conforme indicado acima, a Gestora celebrará um Contrato de Gestão de Investimentos com a SSA LLC. Todas as despesas arcadas pela Requerente são direta ou indiretamente em nome dos veículos de negociação do fundo de negociação. Estes serão faturados à Schonfeld Strategic Advisors LLC. Essas despesas serão faturadas proporcionalmente com base no total de ativos investidos nos veículos de investimento em relação ao total de ativos investidos pela Gestora.

10. NORMAS, PROCEDIMENTOS E CONTROLES INTERNOS

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

Por uma questão de política, os contratos de consultoria celebrados pela Gestora devem ser regidos pelas disposições contidas no contrato de gestão de investimentos entre a Gestora e seu cliente.

O Departamento de Compliance, juntamente com vários outros departamentos dentro da Gestora, é responsável por realizar *due diligence* em relação a cada um desses consultores. Esta revisão de *due diligence* busca confirmar os requisitos de registro aplicáveis, bem como a adoção de políticas e procedimentos que possam ser exigidos por tal registro.

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

A Gestora buscará obter a melhor relação possível entre o custo e a qualidade do serviço prestado em operações que envolvam custos de corretagem, analisando periodicamente as instituições envolvidas e



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

18

monitorando os custos, comparativamente entre diferentes empresas para a execução de um mesmo serviço.

10.3. Descreva as regras para o tratamento de soft dólar, como receber presentes, cursos, viagens etc.

Os Colaboradores da Gestora não podem fornecer ou aceitar Presentes ou Entretenimento Relacionados a Negócios que possam ser considerados como influenciando ou comprometendo a posição ou a independência na tomada de decisões dos Colaboradores da Gestora.

Presentes Relacionados a Negócios. Um presente é considerado "Relacionado a Negócios" se estiver relacionado a qualquer Cliente, cliente em potencial ou qualquer pessoa que faça negócios com ou em nome da Gestora.

Entretenimento Relacionado a Negócios. Um evento de entretenimento é considerado "Relacionado a Negócios" se a pessoa/entidade que fornece o entretenimento estiver presente com os Colaboradores da Gestora. Os Colaboradores da Gestora devem observar que, se o representante do prestador de serviços ou da contraparte patrocinadora do evento não comparecer, o evento será considerado um presente relacionado a negócios e estará sujeito às regras especificadas para presentes.

As limitações estabelecidas abaixo são projetadas para garantir que os Colaboradores da Gestora não forneçam ou aceite presentes relacionados a negócios que sejam de valor tão alto ou em uma base tão frequente que levante questões de impropriedade.

- Proibição de Fornecer ou Aceitar Dinheiro ou Equivalentes de Dinheiro. Os Colaboradores da Gestora não podem fornecer ou aceitar qualquer Presente Relacionado a Negócios na forma de dinheiro ou equivalentes de dinheiro (por exemplo, certificados de presente, cartões-presente) de/para qualquer Cliente, cliente em potencial, funcionário do governo ou para-governamental ou qualquer terceiro que tenha um relacionamento comercial com a Gestora.
- Proibição Contra a Solicitação de Presentes e Entretenimento Relacionados a Negócios. Os Colaboradores da Gestora não poderão usar sua posição na Gestora para obter ou procurar obter entretenimento ou qualquer coisa de valor de um Cliente, cliente em potencial, contraparte ou outra entidade com a qual a Gestora faça ou possa fazer negócios.
- Requisitos de Divulgação e Liberação Prévia para os Presentes e Entretenimento Relacionados a Negócios. Os Colaboradores da Gestora devem receber aprovação por escrito ou fornecer notificação imediata ao Departamento de Compliance, quando forem fornecer ou aceitar Presentes e Entretenimento Relacionados a Negócios de acordo com os requisitos aplicáveis à sua jurisdição ou conforme indicado pelo Departamento de Compliance. Estão



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

19

isentos do requisito de liberação prévia os alimentos compartilhados entre as equipes ou colocados em uma área comum (ou seja, chocolates, biscoitos etc.) ou materiais promocionais razoáveis com o logotipo da contraparte (ou seja, artigos de papelaria, chapéus etc.). Todos esses presentes relacionados a negócio devem ser divulgados ao Departamento de Compliance. O entretenimento deve ser apropriado e de bom gosto, não devendo ser extravagante ou excessivo.

- Proibição de Fornecer Presentes e Entretenimento Relacionados a Negócios a Funcionários do Governo e do Estado, Funcionários Paragovernamentais, Representantes de Planos de Pensão e Funcionários Estrangeiros. Os Colaboradores da Gestora não poderão fornecer nada de valor para o governo e funcionários do estado, funcionários paragovernamentais, Funcionários Estrangeiros, representantes de planos de pensão públicos/privados, seus agentes ou familiares. Para os fins desta política, “Autoridades Estrangeiras” é amplamente definido pela Lei sobre Práticas Corruptas no Exterior (Foreign Corrupt Practices Act, “FCPA”) para incluir autoridades não americanas em todos os níveis do governo, autoridades de partidos políticos, candidatos a cargos públicos e funcionários privados de empresas controladas pelo governo. Além disso, devem ser observadas as regulamentações aplicáveis que tratam de atos de corrupção, em conformidade com a Lei nº 8.429/1992; o Decreto nº 3.678/2000; o Decreto nº 11.129/2022; a Lei nº 12.846/2013; a Lei nº 12.850/1993; e qualquer outra legislação anticorrupção aplicável no Brasil (“Leis Anticorrupção”). Indivíduos que atuam em caráter oficial em nome de um governo estrangeiro ou partido político estrangeiro e empresas de propriedade, mesmo que parcial, de um governo estrangeiro podem ser considerados um “instrumento” desse governo e podem tornar o FCPA e as Leis Anticorrupção aplicáveis. As penalidades civis e criminais por violar a FCPA podem ser severas. Essa proibição inclui não apenas presentes, mas também convites para participar de eventos, bem como a promessa de oferecer “coisas de valor” com o objetivo de obter um benefício comercial de forma corrupta.

O Departamento de Compliance manterá um registro de todas as solicitações de liberação prévia relacionadas a Presentes e Entretenimento Relacionados a Negócios, juntamente com a determinação de aprovação e a justificativa para tal decisão.

O Departamento de Compliance pode exigir que um presente relacionado a negócios seja devolvido/reembolsado ao fornecedor ou que uma despesa relacionada a entretenimento de negócios seja reembolsada pela Gestora ou pelos Colaboradores da Gestora. Dependendo da natureza da violação, os Colaboradores da Gestora podem enfrentar ações disciplinares mais sérias, incluindo a rescisão.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

20

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

A Gestora adotou um Plano de Recuperação de Desastres e Continuidade de Negócios (o “BCP”) que inclui políticas e procedimentos razoavelmente projetados para permitir que a Gestora cumpra suas obrigações de gestão de investimentos com os Clientes em caso de interrupção significativa dos negócios (“SBD”). Os objetivos gerais deste BCP são os seguintes: (i) fornecer aos Colaboradores da Gestora um documento de referência para informações de contato e instruções de recuperação de desastres; (ii) fornecer aos Colaboradores da Gestora acesso a recursos de missão crítica, a fim de mitigar os efeitos de uma SBD; e (iii) manter um ambiente de negócios de trabalho assim que possível após uma SBD. O BCP é distribuído a todo os Colaboradores da Gestora no início do emprego ou associação com a Gestora e pelo menos anualmente a partir de então. O Departamento de Compliance é responsável pela gestão e administração do BCP.

Todo os Colaboradores da Gestora devem se familiarizar com o BCP da Gestora.

Adicionalmente, os sistemas operacionais e os softwares de aplicação são mantidos sempre atualizados, com instalação de atualizações assim que disponibilizadas. As rotinas de backup são monitoradas periodicamente (conforme definido pelo Departamento de Compliance), com testes regulares de restauração de dados.

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

A equipe de *compliance* e risco monitora periodicamente a liquidez das carteiras, controlando os fluxos projetados e realizados. A função de Riscos é segregada da gestão e liderada pela Diretora de Riscos, com autoridade para questionar posições e definir métricas/limites. A Diretora realizará suas funções com o apoio de um integrante na equipe, bem como por meio da integração diária com a estrutura global de risco da SSA LLC (Chief Risk Officer global).

Os limites serão estabelecidos por carteira, calibrados ao mandato, política de investimento, perfil de risco e histórico de retornos.

Em caso de Excedência: (i) Riscos notifica a Gestão e solicita plano de ação; (ii) Gestão envia plano; (iii) Riscos valida e, se não cumprido, reitera ao Diretor Gestor solicitando reestruturação no menor prazo. Justificativas ficam arquivadas com o relatório mensal e anual.

Metodologia e monitoramento (rotina):



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

21

- Relatórios de risco, no mínimo mensal, aos diretores.
- Principais análises: composição de fatores (sistêmicos/idiossincráticos), métricas de liquidez, concentração, volatilidade, VaR histórico (quando aplicável) a 99% de confiança e horizonte de 1 mês, e testes de estresse (sensibilidade e cenários paramétricos/simulados, globais e locais).

A Diretora de Riscos tem a obrigação de comunicar imediatamente qualquer excedência ao Diretor de Gestão.

Risco de Liquidez

- Objetivo: honrar obrigações sem perdas relevantes/impacto operacional.
- Limites de liquidez por veículo (mínimos por projeção de caixa); manutenção de parcela em ativos líquidos compatíveis (ex.: renda fixa D+0, fundos com resgates curtos).
- Medidas de contingência para cenários de iliquidez extrema.

Relatórios e registros: o Relatório de Risco por carteira (que compõem análises de diferentes riscos, para além do risco de liquidez) será enviado, no mínimo, mensalmente ao Diretor de Gestão (art. 26 da RCVM 21). Os e-mails de justificativas em caso de excedências são arquivados com o relatório correspondente.

Revisão e teste de adesão

A equipe de risco realizará a revisão anual mínima (ou ad hoc, se necessário), incorporando mudanças regulatórias e lições aprendidas, visando aprimoramento contínuo de métricas, limites e controles.

10.6. Descrever as políticas, práticas e controles internos para o cumprimento das regras específicas de que trata o inciso I do artigo 30, caso decida atuar na distribuição de cotas de fundos de investimento dos quais seja administrador ou gestor

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não realiza tais atividades.

10.7. Endereço da página do administrador na rede mundial de computadores onde se encontram os documentos exigidos no artigo 16 desta Resolução

<https://www.schonfeld.com/privacy/brazil/documentos-regulatorios/>

11. CONTINGÊNCIAS⁶.

⁶A sociedade deve informar apenas dados relativos à área envolvida na gestão de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.


COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

22

- 11.1.** Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a sociedade seja ré, que sejam relevantes para os negócios da sociedade, indicando:

Não há.

- a. Principais Fatos

Não aplicável.

- b. valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável.

- 11.2.** Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que figure como réu o diretor responsável pela gestão de carteiras de valores mobiliários e que afetem sua reputação profissional, indicando:

Não há.

- a. Principais Fatos

Não aplicável.

- b. valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável.

- 11.3.** Descrever outras contingências relevantes não contempladas nos itens anteriores

Não aplicável

- 11.4.** Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, proferidas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, nos quais a sociedade tenha sido ré, indicando:

Não há.

- a. Principais Fatos

Não aplicável.

- b. valores, bens ou direitos 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
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

23

Não aplicável.

11.5. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, proferidas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela gestão de carteiras de valores mobiliários tenha sido o réu e tenha afetado seus negócios ou reputação profissional, indicando:

Não há.

a. Principais Fatos

Não aplicável.

b. valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável.

12. DECLARAÇÕES ADICIONAIS DO DIRETOR ADMINISTRATIVO INFORMANDO SOBRE:

a. as acusações decorrentes de processos administrativos, bem como as punições sofridas, nos últimos 5 (cinco) anos, 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, inclusive o fato de não estar impedido ou suspenso de exercer cargos em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos referidos órgãos

b. condenações por crime falimentar, de prevaricação, peita ou suborno, concussão, peculato, concussão, 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. impedimentos para administrar seus bens ou aliená-los em razão de decisão judicial e administrativa

d. Inclusão no cadastro de serviços de proteção ao crédito

e. inclusão na lista de diretores inadimplentes de uma entidade de gestão de mercado organizado

f. Títulos contra ele protestados

A declaração de que trata este item, firmada em 14 de outubro de 2025, consta do Anexo II deste Formulário e fica arquivada na sede da Gestora.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

24

ANEXO I

DO FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA DA SCHONFELD STRATEGIC ADVISORS BRAZIL LTDA.

TERMO DE RESPONSABILIDADE – FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA (ANEXO E) – RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

Ref.: Schonfeld Strategic Advisors Brazil Ltda.

CNPJ: 61.852.428/0001-57

Nome do responsável pelo teor do formulário

Cargo do Responsável

Andre Laport Ribeiro

Diretor Gestor, responsável pela gestão de carteiras de valores mobiliários.

Nome do responsável pelo teor do formulário

Cargo do Responsável

Thamyris Chiodi Appel

Diretora Riscos e Compliance

Os diretores acima qualificados declaram que:

- a. revisaram o formulário de referência; e
- b. O conjunto de informações nele contidas é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela sociedade.

São Paulo, 25 de novembro de 2025

Signed by:



SCB5CC7227904D1...

Andre Laport Ribeiro

Signed by:



CFB1D00732FB445...

Thamyris Chiodi Appel



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil
Telefone: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

RESOLUÇÃO CVM Nº 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

25

ANEXO II:

DO FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA DA SCHONFELD STRATEGIC ADVISORS BRAZIL LTDA.

DECLARAÇÕES ADICIONAIS DO DIRETOR RESPONSÁVEL PELA GESTÃO DA CARTEIRA – FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA (ANEXO E) – RESOLUÇÃO CVM N º 21, DE 25 DE FEVEREIRO DE 2021

Ref.: Schonfeld Strategic Advisors Brazil Ltda.

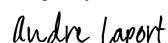
CNPJ: 61.852.428/0001-57

O diretor responsável pela gestão das carteiras de valores mobiliários da SCHONFELD STRATEGIC ADVISORS BRAZIL LTDA. declara:

- a. que não há 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, do Banco Central do Brasil, da Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC, bem como não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargos em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos referidos órgãos;
- b. que não há condenação por crime falimentar, de prevaricação, peita ou 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, salvo no caso de reabilitação;
- c. que não há impedimentos para administrar seus bens ou aliená-los em razão de decisões judiciais e administrativas;
- d. que não consta do livro de registro de serviços de proteção ao crédito;
- e. que não está incluído na lista de princípios inadimplentes de uma entidade de gestão de mercado organizado; e
- f. que não tem títulos contra ele que tenham sido protestados.

São Paulo, 25 de novembro de 2025

Signed by:


Andre Laport

9CB5CC7227904D1...

Andre Laport Ribeiro