

FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA

Genoa Capital Gestora de Recursos Ltda.

Março/2021 – Versão 3.0

ANEXO 15-II - Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

ADMINISTRADORES DE CARTEIRAS DE VALORES MOBILIÁRIOS	
1.	Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário
1.1.	Declarações dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e desta Instrução, atestando que:
a.	reviram o formulário de referência
b.	o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa
Nome do Responsável pelo conteúdo do Formulário de Referência: <u>André Pereira de Souza Raduan</u>	
Cargo: Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários	
Nome do Responsável pelo conteúdo do Formulário de Referência: <u>Rodrigo Noel Barbosa</u>	
Cargo: Diretor Responsável pelo <i>Compliance</i> e Gestão de Riscos	
Por meio desta, o Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários e o Diretor Responsável pelo <i>Compliance</i> e Gestão de Riscos atestam, para todos os fins de direito, que leram e confirmam a veracidade das informações aqui presentes.	
<hr/> ANDRÉ PEREIRA DE SOUZA RADUAN Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários	
<hr/> RODRIGO NOEL BARBOSA Diretor Responsável pelo <i>Compliance</i> e Gestão de Riscos	
2.	Histórico da empresa
2.1.	Breve histórico sobre a constituição da empresa
A Genoa Capital Gestora de Recursos Ltda. (“Genoa Capital”), fundada em julho de 2019, é o resultado da união de profissionais experientes do mercado financeiro e de capitais, que defendem os mesmos ideais e objetivos em termos de gestão, ética e desenvolvimento profissional na busca do melhor retorno ajustado ao risco possível, e, por conseguinte, da satisfação de seus clientes.	

2.2. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo:

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

Eventos societários:

- 1ª Alteração Contratual – Agosto de 2019
 - o Alteração de Sede.

- 2ª Alteração Contratual – Março de 2020
 - o Alteração da Razão Social para Genoa Capital Gestora de Recursos Ltda.
 - o Ingresso dos Sócios André Raduan, Emerson Codogno, Mariano Steinert, Rodrigo Noel, Igor Velecico, Felipe Katz, Guilherme Heringer e David Ferreira.

- 3ª Alteração Contratual – Maio de 2020
 - o Ingresso dos Sócios Wladyslaw Ribeiro, Lucas Cachapuz, Guilherme Frolidi e Leandro Negrão.

- 4ª Alteração Contratual – Junho de 2020
 - o Ingresso do Sócio Vitor Facure

- 5ª Alteração Contratual – Agosto de 2020
 - o Ingresso do Sócio Rafael Lavourinha

b. escopo das atividades

Desde a fundação não ocorreram mudanças na Genoa Capital.

c. recursos humanos e computacionais

Em março de 2020, os sócios André Raduan e Rodrigo Noel assumiram os cargos de Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários e Diretor Responsável pelo *Compliance* e Gestão de Riscos, respectivamente.

d. regras, políticas, procedimentos e controles internos

Desde a fundação não ocorreram mudanças na Genoa Capital.

3. Recursos humanos

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

a. número de sócios

16

b. número de empregados

20
c. número de terceirizados
02
d. lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e que atuem exclusivamente como prepostos, empregados ou sócios da empresa
André Pereira de Souza Raduan - CPF/ME n.º 078.828.837-78; Emerson Ricardo Codogno - CPF/ME n.º 167.805.798-31; Fernando Sérgio Amendola - CPF/ME n.º 293.556.858-31; e Bruno Paulo Ferreira - CPF/ME n.º 103.175.327-31.
4. Auditores
4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:
a. nome empresarial
N/A
b. data de contratação dos serviços
N/A
c. descrição dos serviços contratados
N/A
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
A receita em decorrência de taxas com bases fixas é mais que suficiente para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários.
b. se o patrimônio líquido da empresa representa mais do que 0,02% dos recursos financeiros sob administração de que trata o item 6.3.c e mais do que R\$ 300.000,00 (trezentos mil reais)
Sim
5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução
Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.
6. Escopo das atividades
6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo:

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

A Genoa Capital realiza apenas gestão discricionária de recursos.

<p>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.)</p>
<p>A Genoa Capital tem suas atividades concentradas na gestão de fundos de investimento multimercado regulado pela Instrução CVM n.º 555/14.</p>
<p>c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão</p>
<p>Ações, debêntures, bônus de subscrição, outros títulos mobiliários conversíveis em ações de emissão de companhias, abertas ou fechadas, títulos públicos e etc., através da gestão de fundos de investimento regulados pela Instrução CVM n.º 555/14.</p>
<p>d. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor</p>
<p>A Genoa Capital não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.</p>
<p>6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários, destacando:</p>
<p>a. os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades; e</p>
<p>A Genoa Capital exerce somente a atividade de administração de carteiras e de valores mobiliários, não havendo, portanto, potenciais conflitos de interesses.</p>
<p>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.</p>
<p>A Genoa Capital não possui atividades exercidas por sociedade controladoras, controladas, coligadas e sob controle comum ao administrador, por consequência, não existem potenciais conflitos de interesses.</p>
<p>6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos e carteiras administradas geridos pela empresa, fornecendo as seguintes informações:</p>
<p>a. número de investidores (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)</p>
<p>Número de Investidores Total: 8551 Número de Investidores em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Qualificados: 129 Número de Investidores em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Não-Qualificados: 8448</p>
<p>b. número de investidores, dividido por:</p>
<p>i. pessoas naturais</p>
<p>16</p>

ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)
0
iii. instituições financeiras
0
iv. entidades abertas de previdência complementar
0
v. entidades fechadas de previdência complementar
0
vi. regimes próprios de previdência social
0
vii. seguradoras
0
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil
0
ix. clubes de investimento
0
x. fundos de investimento
621
xi. investidores não residentes
0
xii. outros (especificar)
Conta e Ordem - 7914
c. recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)
Total: R\$ 7.133 milhões Recursos Financeiros sob Administração em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Qualificados: R\$ 177,4 milhões Recursos Financeiros sob Administração em Fundos de Investimento Destinados a Investidores Não Qualificados: R\$ 6.955,6
d. recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior
R\$ 818,75 milhões

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

Em milhões:

- 1) R\$ 729,6
- 2) R\$ 462,6
- 3) R\$ 391,9
- 4) R\$ 374,2
- 5) R\$ 352,1
- 6) R\$ 327,3
- 7) R\$ 164,9
- 8) R\$ 159,7
- 9) R\$ 142,0
- 10) R\$ 112,1

f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

i. pessoas naturais

R\$ 11,8 milhões

ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)

0

iii. instituições financeiras

0

iv. entidades abertas de previdência complementar

0

v. entidades fechadas de previdência complementar

0

vi. regimes próprios de previdência social

0

vii. seguradoras

0

viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil

0

ix. clubes de investimento

0

x. fundos de investimento

R\$ 6.625,3 milhões

xi. investidores não residentes

0
xii. outros (especificar)
Conta e Ordem – R\$ 495,9 milhões
6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:
a. ações
R\$ 952,0 milhões
b. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras
0
c. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras
0
d. cotas de fundos de investimento em ações
0
e. cotas de fundos de investimento em participações
0
f. cotas de fundos de investimento imobiliário
0
g. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios
0
h. cotas de fundos de investimento em renda fixa
0
i. cotas de outros fundos de investimento
0
j. derivativos (valor de mercado)
R\$ 65,2 milhões
k. outros valores mobiliários
0
l. títulos públicos
R\$ 4.213,3 milhões
m. outros ativos
Bonds: R\$ 97,0 milhões Caixa: 1.600,9 milhões

Provisões: R\$ 205,1 milhões	
6.5.	Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária
N/A. Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.	
6.6.	Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
A Genoa Capital não possui outras informações relevantes a serem divulgadas.	
7.	Grupo econômico
7.1.	Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:
a.	controladores diretos e indiretos
Os controladores da sociedade são os Srs. André Raduan, Emerson Codogno, Mariano Steinert e Rodrigo Noel.	
b.	controladas e coligadas
A Genoa Capital não possui controladas e coligadas.	
c.	participações da empresa em sociedades do grupo
A Genoa Capital não detém participações em outras sociedades.	
d.	participações de sociedades do grupo na empresa
A Genoa Capital não possui participações de sociedades na empresa.	
e.	sociedades sob controle comum
A Genoa Capital não compartilha o controle com nenhuma outra sociedade.	
7.2.	Caso a empresa deseje, inserir organograma do grupo econômico em que se insere a empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 7.1.
A Genoa Capital não considera necessário a inclusão de um organograma societário.	
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
Departamento Técnico:	
<ul style="list-style-type: none"> • Área de Gestão: Esta área é responsável por gerir carteiras de investimentos, elaborar as estratégias de investimento, executar as ordens, definir taxas e preços, sempre respeitando as normas legais, as diretrizes estabelecidas nos Comitês, os indicadores de risco e as restrições específicas de cada operação. • Área de Controle de Riscos: Esta área é responsável pelos controles de risco dos fundos de investimento, supervisionando a gestão dos fundos de investimento de acordo com as diretrizes de risco. 	

- Área de Controles Internos e *Compliance*: esta área é responsável por zelar pelo cumprimento das regras, tanto os controles internos quanto à legislação em geral.

Comitês:

- Comitê de Investimentos: tem por objetivo assessorar as decisões relacionadas à gestão dos fundos de investimento. Uma reunião mensal do referido Comitê é importante para alinhamento dos Colaboradores, e suas realizações mensais, registradas em atas, têm caráter de decisão das estratégias a serem seguidas.
- Comitê de Risco e *Compliance*: tem por objetivo revisar os Indicadores de Riscos; aprovar alterações nas políticas e manuais; deliberar sobre assuntos que sejam pertinentes à Gestão de Riscos e de *Compliance*; e outras matérias pertinentes. Sua realização deve ser sempre registrada em ata.

As decisões do Comitê são aprovadas por maioria e suas deliberações serão formalizadas em ata.

Adicionalmente, o Responsável pela Administração de Carteira de Valores Mobiliários deterá o poder de veto no Comitê de Investimentos, enquanto o Responsável pela Gestão de Risco e *Compliance* tem direito ao poder de veto em ambos os Comitês, para ser utilizado em matérias que consideram contra os princípios de gestão de riscos ou os controles internos da Genoa Capital.

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

O Comitê de Investimentos tem frequência mínima mensal, mas reuniões ao longo da semana são usualmente realizadas para alinhamento das posições e estratégias dos fundos. Participa o Diretor de Gestão, bem como o departamento técnico envolvidos na Gestão de Recursos da Genoa Capital.

O Comitê de Risco e *Compliance* se reunirá no mínimo mensal, ou sempre que necessário. O Comitê será composto pelo Diretor de Risco e *Compliance*, e os envolvidos nas atividades de Risco e *Compliance*.

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

Diretores	Atribuições
André Raduan	Diretor Responsável pela Gestão de Fundos de Investimento e Sócio
Rodrigo Noel	Diretor Responsável pela Gestão de Riscos, Diretor Responsável pelo <i>Compliance</i> , Diretor Responsável pela Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Sócio Administrador da Genoa Capital

8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 8.1.

A Genoa Capital acredita que não há necessidade de inserir organograma.

8.3. Em relação a cada um dos diretores de que tratam os itens 8.4, 8.5, 8.6 e 8.7 e dos membros de Comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar, em forma de tabela:

Nome	André Raduan	Rodrigo Noel
Idade	44 anos	47 anos
Profissão	Engenheiro	Engenheiro
CPF	078.828.837-78	013.435.767-17
Cargo ocupado	Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários	Diretor Responsável pela Gestão de Riscos
Data da Posse	Março de 2020	Março de 2020
Prazo do Mandato	Indeterminado	Indeterminado
Outros Cargos na Empresa	N/A	Diretor de <i>Compliance</i> e PLD

8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer:

a. currículo, contendo as seguintes informações:

i. cursos concluídos;

- Graduação em Engenharia Civil – Universidade Federal do Rio de Janeiro – UFRJ - 1998
- Mestrado Profissional em Economia – Área de Concentração: Finanças e Macroeconomia Aplicadas pelo Instituto de Ensino e Pesquisa – Insper - 2010
- Risk and Investment Management Program pela Yale School of Management - 2017

ii. aprovação em exame de certificação profissional

- CFA nível III - *Chartered Financial Analyst* – 2003; e
- Isenção da Certificação Gestor ANBIMA - CGA

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

- nome da empresa
- cargo e funções inerentes ao cargo
- atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram

<ul style="list-style-type: none"> • datas de entrada e saída do cargo
<ul style="list-style-type: none"> • Itaú Asset Management – Gestor de Portfólio - Jan 2013 - Março 2020.
<p>8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e desta Instrução, fornecer:</p>
<p>a. currículo, contendo as seguintes informações:</p>
<p>i. cursos concluídos:</p>
<ul style="list-style-type: none"> • Graduação em Engenharia de Produção - Universidade Federal do Rio de Janeiro – 1995; • MBA em Finanças - Fundação Getúlio Vargas- Rio - 1997 • Risk and Investment Management Program pela Yale School of Management - 2017
<p>ii. aprovação em exame de certificação profissional</p>
<ul style="list-style-type: none"> • Isenção da Certificação Gestor ANBIMA - CGA
<p>iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:</p>
<ul style="list-style-type: none"> • nome da empresa
<ul style="list-style-type: none"> • cargo e funções inerentes ao cargo
<ul style="list-style-type: none"> • atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
<ul style="list-style-type: none"> • datas de entrada e saída do cargo
<ul style="list-style-type: none"> • Kapitalo Investimentos – Portfolio Specialist– 2019 • Itaú Asset Management – Gestor de Portfólio - 2013 - 2018.
<p>8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:</p>
<p>a. currículo, contendo as seguintes informações:</p>
<p>i. cursos concluídos;</p>
<p>ii. aprovação em exame de certificação profissional</p>
<p>iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:</p>
<ul style="list-style-type: none"> • nome da empresa
<ul style="list-style-type: none"> • cargo e funções inerentes ao cargo
<ul style="list-style-type: none"> • atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
<ul style="list-style-type: none"> • datas de entrada e saída do cargo
<p>Vide 8.5</p>
<p>8.7. Em relação ao diretor responsável pela atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento, caso não seja a mesma pessoa indicada no item 8.4, fornecer:</p>
<p>a. currículo, contendo as seguintes informações:</p>

i.	 cursos concluídos;
ii.	 aprovação em exame de certificação profissional
iii.	 principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
	<ul style="list-style-type: none"> • nome da empresa • cargo e funções inerentes ao cargo • atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram • datas de entrada e saída do cargo
	A Genoa Capital não distribui as cotas dos fundos de investimentos sob sua gestão.
8.8.	 Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:
a.	 quantidade de profissionais
	11 profissionais, sendo um deles o Diretor de Gestão de Recursos André Raduan.
b.	 natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
	<p>Todas as decisões de investimento da Genoa Capital serão decorrentes de deliberações do Comitê de Investimentos da Genoa Capital, órgão deliberativo que auxilia a tomada de decisões de investimento da gestora, conforme indicado anteriormente.</p> <p>O processo de decisão de investimentos da Genoa Capital passa, no geral, por diversas fases com a análise criteriosa, detalhada e abrangente de dados públicos divulgados pelas companhias, assim como das perspectivas macroeconômicas nacionais e internacionais para cada setor da economia, antes da decisão final sobre o investimento ou desinvestimento que será realizado pela Genoa Capital.</p> <p>A Equipe de Gestão da Genoa Capital realiza uma análise minuciosa das empresas e de seus diferenciais competitivos. Além da análise dos dados econômico-financeiros, realiza visita às instalações, conversa com gestores e com concorrentes para que seja definida a estratégia. Após a formulação da tese de investimento está é levada ao Comitê para aprovação.</p>
c.	 os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
	Os profissionais voltados à Gestão de Recursos utilizam serviços de informações financeiras, como Bloomberg e Broadcast, por exemplo. O sistema de risco utilizado é o Lote45.
8.9.	 Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:
a.	 quantidade de profissionais
	03 profissionais, sendo um deles o Diretor de Risco e <i>Compliance</i> Rodrigo Noel.
b.	 natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

O acompanhamento do cumprimento das regras e procedimentos de *Compliance* da Genoa Capital será realizado de forma extensiva pelos Colaboradores da Área de *Compliance*, continuamente.

Adicionalmente, estas regras e procedimentos visam garantir o permanente atendimento às normas, políticas e regulamentações vigentes, referentes às diversas modalidades de investimento, à própria atividade de administração de carteiras de valores mobiliários e aos padrões ético e profissional.

As atividades de controle devem ser constantemente avaliadas, tomando como referência as boas práticas de governança corporativa.

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

Controles internos consistem em um ou mais processos desenvolvidos para garantir o atingimento dos objetivos da Genoa Capital, com relação à:

- I. Eficiência e efetividade operacional;
- II. Confiança nos registros de dados e informações;
- III. Conformidade; e
- IV. Abordagem baseada em gestão de risco.

Os controles serão realizados com o auxílio do sistema Lote45 e do sistema para gerenciamento de *Compliance*, Compliasset, podendo contratar outros sistemas caso o Diretor de Risco e *Compliance* considere necessário.

As referidas normas e políticas da Genoa Capital são os principais meios de fiscalização das atividades pelo diretor e pelos demais integrantes da Área de *Compliance*, sendo o vetor da análise das operações da gestora. Através das políticas, a Área de *Compliance* realiza o *crosscheck* do que está disposto com as atividades realizadas pela Genoa Capital e pelos Colaboradores.

Os procedimentos de controles internos adotados pela área de *Compliance* se baseiam na (i) Implementação, (ii) Manutenção, (iii) Análise, (iv) Avaliação e (v) Acompanhamento de Processos de Controles Internos. Dessa forma, a área é responsável em primeiro lugar pelo estabelecimento dos princípios e regras internas. Análise e monitoramento do cumprimento dos procedimentos internos adotados. Avaliação e adequação dos métodos e testes adotados para os processos de controles internos e, por fim, o acompanhamento do resultado desses testes sendo formalizados por meio de um relatório que indicará as falhas e os acertos, bem como um cronograma para saneamento.

Os resultados dos testes efetuados serão compactuados no Relatório de Controles Internos, juntamente com as melhorias e programas de sanidade estabelecidos para resolverem as incongruências identificadas.

Desta forma, estes procedimentos visam mitigar os riscos de acordo com a natureza, complexidade e risco das operações realizadas pela Genoa Capital, bem como disseminar a cultura de controles para garantir o cumprimento da Instrução CVM n.º 558, de 26 de março de 2015, bem como das demais normas estabelecidas pelos órgãos reguladores e autorreguladores.

Ademais, a área de *Compliance* ainda é responsável pela implementação dos programas de treinamento e pela divulgação e atualização das políticas internas.

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

O Diretor de *Compliance* atuará com completa independência para tomar qualquer decisão quanto às questões de *compliance*, sendo de sua exclusiva responsabilidade a gestão sobre essa área.

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

a. quantidade de profissionais

03 profissionais e o Diretor de Risco e *Compliance*, Rodrigo Noel.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A Área Responsável pela Gestão de Riscos atuará com completa independência para tomar qualquer decisão quanto às questões de risco e sua metodologia, sendo de sua exclusiva responsabilidade a gestão sobre essa área.

O objetivo do gerenciamento de risco é gerenciar e mensurar os riscos inerentes à atividade de gestão, visando à adequação das estratégias aos objetivos dos fundos de investimento e buscando mitigar ou reduzir potenciais resultados negativos.

A Genoa Capital monitora e controla os riscos dos fundos de investimento nos quais exercerá a gestão utilizando-se de metodologias próprias e características do mercado para esse fim, a saber:

- I. *Value at Risk* (“VaR”);
- II. VaR Histórico;
- III. *Stress Test*.

<p>c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>
<p>A Genoa Capital conta com uma robusta estrutura e procedimentos de monitoramento, mensuração, análise, controle e gerenciamento de riscos das carteiras de valores mobiliários e fundos de investimento que estão sob sua gestão.</p>
<p>O controle e monitoramento de limites de estratégias são realizados pelo Comitê de Investimentos, registrados através de atas de reunião, além de serem revalidados pelo Comitê de Risco e <i>Compliance</i>, que apresenta periodicidade mensal, também registrados através de atas de reunião.</p>
<p>Cabe conferir que, diariamente, o Diretor de Riscos e <i>Compliance</i> envia relatório às áreas de <i>Compliance</i> e Gestão, contendo as principais disposições acerca dos riscos, em especial os valores de VaR e <i>Stress Testing</i> por fundo, e para os fundos de investimento que possuam limites, é ainda informado o percentual de aproveitamento dos mesmos.</p>
<p>Ainda, com intuito de auxiliar a atividade de gestão de riscos, a Genoa Capital utiliza o sistema operacional de empresa terceirizada da Lote45.</p>
<p>As demais diretrizes de risco podem ser encontradas em sua Política de Gestão de Riscos.</p>
<p>d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor</p>
<p>O Diretor Responsável pela Gestão de Risco atua com completa independência para tomar qualquer decisão quanto às questões de Risco, sendo de sua exclusiva responsabilidade a gestão sobre essa área. A sua independência é garantida sendo assegurado direito a veto no Comitê de Risco.</p>
<p>8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas, incluindo:</p>
<p>a. quantidade de profissionais</p>
<p>Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.</p>
<p>b. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>
<p>Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.</p>
<p>c. a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade</p>
<p>Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.</p>
<p>8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:</p>
<p>a. quantidade de profissionais</p>
<p>A Genoa Capital não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.</p>

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
A Genoa Capital não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
c. programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas
A Genoa Capital não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
d. infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição
A Genoa Capital não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
e. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
A Genoa Capital não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.
8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
A Genoa Capital entende que não há outras informações relevantes a ser divulgadas.
9. Remuneração da empresa
9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 6.1, indicar as principais formas de remuneração que pratica
As únicas formas de remuneração da Genoa Capital se dão através de taxas de Administração e Performance.
10. Regras, procedimentos e controles internos
10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços
Durante o processo de Contratação, os Colaboradores deverão obter informações qualitativas sobre o Terceiro que tenha interesse em iniciar vínculo jurídico com a Genoa Capital, de modo a permitir um melhor julgamento durante a pré-seleção.
Após a análise do procedimento de <i>Due Diligence</i> realizado, o Colaborador responsável pela contratação classificará o Terceiro de acordo com seu potencial de risco.
A Genoa Capital poderá deixar de aplicar os procedimentos aqui expostos, a seu exclusivo critério, quando o Terceiro não tiver relação com a atividade fim da Genoa Capital e possuir notória capacidade econômico-financeira e/ou técnica para satisfazer o objeto da contratação e adimplir as responsabilidades contratuais estabelecidas, ou quando o Terceiro tiver relação com a atividade fim da Genoa Capital e for Associado ou Aderente aos códigos da ANBIMA.
O início das atividades do Terceiro deve ser vinculado à formalização da Contratação, e nenhum tipo de pagamento poderá ser efetuado antes da celebração do contrato. Os contratos celebrados para efetiva formalização da Contratação deverão possuir os requisitos

contidos no art. 19 do Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para Administração de Recursos de Terceiros.

A Genoa Capital realizará um monitoramento contínuo, pelo prazo que durar a Contratação, e analisando o objeto contratado *vis-à-vis* à entrega realizada, com ênfase nas eventuais disparidades na tempestividade, qualidade e quantidade esperadas. Ainda, este monitoramento deve ser capaz de identificar preventivamente atividades que possam resultar em riscos para a Genoa Capital.

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

Para minimizar os custos de transação na negociação dos ativos a Genoa Capital procurará:

- Priorizar a negociação de ativos com alta liquidez para manutenção de caixa;
- Acessar mercados com *spreads* de compra e venda mais apertados;
- Cotar com diversas contrapartes antes de fechar uma operação para ativos não listados;
- Na seleção das corretoras, priorizar, além da idoneidade, aquelas especialistas no mercado operado, que oferecem qualidade de execução e melhor custo de transação;
- Outros procedimentos não especificados.

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

A Genoa Capital poderá permitir o uso de de *Soft Dollar* desde que o benefício a ser concedido:

- (i) se reverta diretamente para a atividade de gestão, e
- (ii) não venha a causar dependência e concentração na execução das ordens impactando a tomada de decisão de investimentos da gestora.

Nesse sentido, em consonância com o art. 16, VI, da Instrução CVM n.º 558/15, a empresa adotará o *Soft Dollar* somente quando o seu benefício acarretar em vantagem para a carteira dos fundos de investimento geridos, sendo vedado o uso de *Soft Dollar* quando a vantagem/benefício se reverter para a gestora, seja no todo ou em parte.

Ademais, as aprovações referentes a quaisquer recebimentos de *Soft Dollar* devem ser previamente apreciadas pela Área de *Compliance*.

Assim, conforme art. 16, VI, da Instrução CVM n.º 558/15, a Genoa Capital adotará a transferência à carteira do fundo de investimento qualquer benefício ou vantagem que possa alcançar em decorrência de sua condição de gestora do mesmo.

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

Para garantir a continuidade das atividades da Genoa Capital, é feito o *backup* das informações digitais e dos sistemas existentes na sede da empresa, através dos seguintes processos:

- I. *Backup* executado diariamente em HD interno. Cópia de tudo que for modificado ou criado ao longo do dia, armazenando em Datacenter externo;
- II. *Backup* diário em disco externo às instalações físicas da Genoa Capital;
- III. Manutenção dos sistemas em funcionamento, apesar de falta de energia temporária, através de equipamentos de *no-break* instalados para suprir o fornecimento de energia nos equipamentos principais para a manutenção das comunicações e atividades mínimas da Genoa Capital;
- IV. Manutenção de meios remotos seguros para o trabalho de seus Colaboradores;

Após o evento, o Comitê de Risco e *Compliance* deverá avaliar os prejuízos decorrentes da ocorrência e propor melhorias e investimentos para a redução dos riscos.

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

As carteiras dos fundos de investimento sob responsabilidade da Genoa Capital serão monitoradas em conformidade com os padrões de risco correspondentes e o responsável pelo controle das informações é o Diretor de Risco e *Compliance*, que exerce sua função com total independência.

O nível mínimo de liquidez da carteira é definido de acordo com a liquidez dos ativos, o prazo do fundo para resgates e a pulverização do passivo.

A liquidez dos ativos, o prazo de resgate, a pulverização do passivo e as regras estabelecidas de liquidez, serão imputadas no sistema de risco contratado, e o referido sistema enviará *inputs* quanto ao nível de liquidez mínimo para cumprir com o percentual do patrimônio dos fundos definido pelo Comitê de Risco.

Cumprindo ainda salientar que as operações com ativos de crédito não fazem parte do escopo de atuação da Genoa Capital.

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

A Genoa Capital não distribuirá as cotas de seus próprios fundos de investimento.

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

<https://www.genoacapital.com.br>

11. Contingências

11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, que sejam relevantes para os negócios da empresa, indicando:
a. principais fatos
b. valores, bens ou direitos envolvidos
A Genoa Capital não possui qualquer tipo de contingência.
11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem sua reputação profissional, indicando:
a. principais fatos
b. valores, bens ou direitos envolvidos
A Genoa Capital não possui qualquer tipo de contingência.
11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores
A Genoa Capital não possui qualquer tipo de contingência.
11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que a empresa tenha figurado no polo passivo, indicando:
a. principais fatos
b. valores, bens ou direitos envolvidos
A Genoa Capital não possui qualquer tipo de contingência.
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
b. valores, bens ou direitos envolvidos
O Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários não possui qualquer tipo de contingência.

12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, informando sobre:

a. acusações decorrentes de processos administrativos, bem como punições sofridas, nos últimos 5 (cinco) anos, em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, Banco Central do Brasil, Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC, incluindo que não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários declara que não existem acusações decorrentes de processos administrativos, bem como não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pela CVM, pelo Banco Central do Brasil, pela Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou pela Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC, incluindo que não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos

b. condenações por crime falimentar, prevaricação, suborno, concussão, peculato, “lavagem” de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores, contra a economia popular, a ordem econômica, as relações de consumo, a fé pública ou a propriedade pública, o sistema financeiro nacional, ou a pena criminal que vede, ainda que temporariamente, o acesso a cargos públicos, por decisão transitada em julgado, ressalvada a hipótese de reabilitação

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários, declara que não existem 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;

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

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários declara que não está impedido de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa;

d. inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários declara que não está incluído no cadastro de serviços de proteção ao crédito.

e. inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários declara que não está incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado.

f. títulos contra si levados a protesto

O Diretor Responsável pela Administração de Recursos de Valores Mobiliários declara que não tem contra si títulos levados a protesto.

ANDRÉ PEREIRA DE SOUZA RADUAN

Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários