



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 15.240.769/0001-54

Nome do Administrador de Carteira: SÃO JOÃO GESTORA DE RECURSOS LTDA

Ano de competência: 2023

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

Constituída em setembro de 2011 sob a forma de sociedade empresária limitada, a São João Gestora de Recursos Ltda. ("Gestora" ou "SJG") é uma empresa de prestação de serviços de administração de carteira de valores mobiliários e gestão de recursos para pessoas físicas ou jurídicas, autorizada a funcionar pela Comissão de Valores Mobiliários nos termos do Ato Declaratório CVM nº 12.600, de 24 de setembro de 2012.

A SJG tem sua sede, foro e administração na Avenida Brigadeiro Faria Lima, nº 2.601, 4º andar, conjunto 43, Jardim Paulistano, São Paulo - SP.

O prazo de duração da sociedade é indeterminado.

Pela prestação dos serviços relacionados à gestão de recursos, a SJG é remunerada por honorários referentes às taxas de gestão, calculadas com base no patrimônio líquido dos fundos sob a gestão da SJG.

A SJG possui uma estrutura que permite dedicação integral à gestão dos recursos. As atividades de administração, custódia e distribuição dos fundos sob a gestão da SJG são executadas por prestadores de serviços de alto padrão de excelência.

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

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

Em 5 de agosto de 2022, com o arquivamento na JUCESP da 8ª Alteração do Contrato Social, houve alteração no quadro societário da SJG. Em 05 de outubro de 2023, houve nova alteração no quadro societário da SJG, com o arquivamento na JUCESP em 07 de novembro de 2023. ("Alterações do Quadro Societário").

b. Escopo das atividades

Não obstante as Alterações do Quadro Societário, o objeto social da SJG permaneceu inalterado.

c. Recursos humanos e computacionais

Em decorrência das Alterações do Quadro Societário, a responsabilidade pela administração de carteiras de valores mobiliários passou a ser atribuída ao Sr. Erico Fukue Fukushiro, enquanto a responsabilidade pela administração do Compliance e Gestão de Risco passou a ser atribuída a Sra. Marcia Carolynne Simões de Oliveira Melo.

d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos

Não ocorreram mudanças relevantes nas regras, políticas, procedimentos e controles internos da SJG nos últimos 5 (cinco) anos.

3. Recursos Humanos

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

a. Número de sócios:

8

b. Número de empregados:

8

c. Número de terceirizados:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

0

CPF	Nome
314.233.238-31	ERICO FUKUE FUKUSHIRO

4. Auditores

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

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

Nome empresarial	Data da contratação	Descrição
Ernst & Young Auditores Independentes S.S. ("EY").	19/12/2023	A EY foi contratada para realizar a auditoria e emitir relatório sobre as demonstrações contábeis da SJG para o exercício social findo em 31 de dezembro de 2023.

5. Resiliência Financeira

5.1. Com base nas demonstrações financeiras, ateste:

a. Se a receita em decorrência de taxas com bases fixas a que se refere o item 9.2.a é suficiente para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários

Sim

b. Se o patrimônio líquido da empresa representa mais do que 0,02% dos recursos financeiros sob administração de que trata o item 6.3.c e mais do que R\$300.000,00 (trezentos mil reais)

Sim

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

Demonstração Financeira: Não se aplica

Relatório: Não se aplica

6. Escopo das Atividades

6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

A SJG tem como objeto a prestação de serviços de gestão discricionária de fundos de investimento e carteiras de valores mobiliários nos mercados doméstico e internacional.

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.)

A SJG realiza a gestão de fundos de investimento multimercado, fundos de ações, fundos offshore de investimento especializado de capital variado (SICAV-SIFs) e de carteiras administradas

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Os fundos sob gestão da SJG realizam investimentos preponderantemente em mercados de taxa de juros pós-fixada e pré-fixadas, índices de preços, moeda estrangeira e renda variável, havendo a possibilidade de realizarem investimentos em outros países.

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

Não

6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários, destacando:

a. Os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades

A SJG realiza exclusivamente a atividade de gestão de fundos de investimento e carteiras administradas. Assim, no seu melhor entendimento, não há potenciais conflitos de interesses a serem tratados neste item.

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

Não aplicável.

6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundo e carteiras administradas geridas pela empresa, fornecendo as seguintes informações

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
a. Número de investidores	21	0	21



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

b. Número de investidores, dividido por:	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	21	0	21
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	0	0	0
iii. Instituições Financeiras	0		0
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0		0
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	0		0
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	0	0	0
vii. Seguradoras	0		0
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	0		0
ix. Clubes de Investimento	0	0	0
x. Fundos de Investimento	0		0
xi. Investidores não Residentes	0		0

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
	0	0	0

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	21	0	21

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 3.826.724.614,86	R\$ 0,00	R\$ 3.826.724.614,86

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

R\$ 2.633.365.607,92

e. Recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes) Caso deseje identificar o cliente, informe o nome após o valor dos recursos, utilizando o caracter ";" como separador



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Valor	Nome
R\$ 696.715.246,90	
R\$ 583.481.140,28	
R\$ 531.539.189,62	
R\$ 492.709.239,72	
R\$ 417.841.544,58	
R\$ 376.170.066,59	
R\$ 160.160.692,70	
R\$ 153.680.310,14	
R\$ 133.072.159,46	
R\$ 63.637.378,49	

f. Recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	R\$ 3.826.724.614,86	R\$ 0,00	R\$ 3.826.724.614,86
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
iii. Instituições Financeiras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
vii. Seguradoras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	R\$ 0,00		R\$ 0,00
ix. Clubes de Investimento	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
x. Fundos de Investimento	R\$ 0,00		R\$ 0,00
xi. Investidores não Residentes	R\$ 0,00		R\$ 0,00

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
-------------	---	---	-------

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 3.826.724.614,86	R\$ 0,00	R\$ 3.826.724.614,86

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

a. Ações	R\$ 0,00
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R\$ 15.334.094,26
c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R\$ 270.694.668,19
d. Cotas de fundos de investimento em ações	R\$ 148.949.668,04
e. Cotas de fundos de investimento em participações	R\$ 15.661.527,97
f. Cotas de fundos de investimento imobiliário	R\$ 2.815.592,65
g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R\$ 194.146,85
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 109.309.137,56
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 3.246.566.455,02
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 0,00
k. Outros valores mobiliários	R\$ 0,00
l. Títulos públicos	R\$ 15.281.309,11
m. Outros ativos	R\$ 1.918.015,21
Total	R\$ 3.826.724.614,86

6.5. Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária:

Item facultativo para o administrador registrado na categoria gestor de recursos.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não há outras informações que a SJG julgue relevantes para fins deste item.

7. Grupo Econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
00.003.933/6464-05	ALEXANDRE COIMBRA BEZERRA CAVALCANTI BRENAND
00.003.890/4804-62	JORGE CAVALCANTI DE PETRIBU FILHO
00.003.533/3244-51	JOSE JAIME MONTEIRO BRENAND FILHO
00.004.728/1484-24	JOSE RICARDO BRENAND DE CARVALHO
00.006.231/2464-50	LUIZA BRENAND GUERRA DIAS PEREIRA
00.002.127/3852-68	CELIMAR MOREIRA MAVIGNIER
314.233.238-31	ERICO FUKUE FUKUSHIRO
00.001.334/5404-54	MARCIA CAROLYNNE SIMOES DE OLIVEIRA MELO

b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
-	Não Informado

c. Participações da empresa em sociedade do grupo



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

CNPJ	Nome
-	Não Informado

d. Participações de sociedades do grupo na empresa

CNPJ	Nome
-	Não Informado

e. Sociedades sob controle comum

CNPJ	Nome
-	Não Informado

7.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma do grupo econômico em que se insere a empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no 7.1.

Nenhum arquivo selecionado.

8. Estrutura Operacional e Administrativa

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

a. Atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico

Área de Compliance e Gestão de Risco: área responsável por (a) assegurar, executar e acompanhar o cumprimento das regras, procedimentos e controles internos da SJG e demais normas e regulamentações aplicáveis, por meio, inclusive, de procedimentos de fiscalização periódicos e treinamentos; e (ii) acompanhar e controlar, na medida do possível, os riscos relacionados aos fundos geridos.

Área de Administração de Carteira de Valores Mobiliários: área responsável por analisar e decidir acerca dos investimentos e desinvestimentos dos ativos sob gestão da SJG, emitindo as respectivas ordens de compra e venda de ativos, enviando as informações relativas aos negócios realizados aos respectivos administradores dos fundos, quando aplicável, e gerenciando a liquidez das carteiras dos fundos geridos, nos termos de suas respectivas políticas de investimento.

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

A SJG não possui comitês periódicos fixos. Os comitês são formados conforme demanda levantada pelo Administrador de Compliance e Risco, pelo Administrador de Carteira de Valores Mobiliários e/ou por algum dos sócios da SJG. Quando instituídos, os comitês são formados por, no mínimo, 3 (três) sócios.

Não obstante o acima exposto, os sócios da SJG se reúnem mensalmente para discutir os resultados apresentados pelos fundos e as estratégias de investimento de cada fundo gerido pela SJG.

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

Marcia Carolynne Simões de Oliveira Melo, inscrita no CPF/ME sob o nº 013.345.404-54, na qualidade de Administradora de Compliance e Gestão de Risco, é responsável pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos.

Erico Fukue Fukushiro, inscrito no CPF/ME sob o nº 314.233.238-31, na qualidade de Administrador de Carteira de Valores Mobiliários, é responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários.

A SJG deverá ser sempre representada por 2 (dois) administradores, atuando em conjunto, podendo também ser representada por procuradores "ad judicium" e "ad negotia" devidamente constituídos nos termos do Contrato Social da SJG.

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

Nenhum arquivo selecionado

8.3. Em relação a cada um dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos
-----	------	-------	-----------	-------	---------------	------------------	---------------

8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, indicar:

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	314.233.238-31	ERICO FUKUE FUKUSHIRO	39	Economista	Administrador de Carteira de Valores Mobiliários	05/08/2022	Indeterminado		Economia pela Escola de Economia de São Paulo da Fundação Getulio Vargas (FGV/EE SP)	CPA-20, CFG, CGA e CGE
8.5 (COMPLIANCE)	00.001.334/5404-54	MARCIA CAROLYNE SIMOES DE OLIVEIRA MELO	38	Administradora de empresas	Administradora de Compliance e Gestão de Risco	07/11/2023	Indeterminado		Administração de empresas pela Universidade Católica de Pernambuco e ciências contábeis pela Faculdade Santa Helena	Não aplicável
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	00.001.334/5404-54	MARCIA CAROLYNE SIMOES DE OLIVEIRA MELO	38	Administradora de empresas	Administradora de Compliance e Gestão de Risco	07/11/2023	Indeterminado		Administração de empresas pela Universidade Católica de Pernambuco e ciências contábeis pela Faculdade Santa Helena	Não aplicável

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída
314.233.238-31	ERICO FUKUE FUKUSHIRO	São João Gestora de Recursos Ltda.	Administrador de Carteira de Valores Mobiliários	Gestão de fundos de investimento e de carteiras administradas	05/08/2022	
00.001.334/5404-54	MARCIA CAROLYNNE SIMÕES DE OLIVEIRA MELO	São João Gestora de Recursos Ltda	Administradora de compliance e gestão de riscos	Administrador de Compliance e Gestão de Risco, também responsável por todas as atividades do back office, incluindo nas áreas contábil, fiscal, jurídica e regulatória.	07/11/2023	

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

a. Quantidade de profissionais

11

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Decisão de investimento. O processo de decisão de investimento é realizado tendo por base as seguintes etapas: (i) análise das oportunidades - a SJG avalia os ativos disponíveis para investimento, atentando para a adequação dos ativos à política de investimento do fundo e a projeção de retorno oferecida por cada ativo; (ii) aprovação do investimento - as decisões de investimento são tomadas em conjunto pelo analista financeiro e pelo Administrador de Carteiras de Valores Mobiliários; e (iii) monitoramento - após a realização do investimento, a SJG passa a acompanhar o retorno (rentabilidade) de cada investimento.

Ordens de compra e venda de ativos financeiros e demais modalidades operacionais. Após a definição do investimento ou do desinvestimento, a SJG emite a ordem de compra ou venda de ativos financeiros utilizando alguma corretora ou banco de seu relacionamento.

Gerenciamento da liquidez das carteiras dos fundos de investimento. A SJG deve assegurar, dentro dos cenários prováveis, que todos os cotistas dos fundos possam amortizar e/ou resgatar os seus investimentos dentro dos prazos previstos pelo regulamento, conforme o caso.

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

Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos na gestão dos recursos consistem nos seguintes: (i) acompanhamento diário das notícias do mercado por meio de sites da internet, e-mail e sistemas Bloomberg; (ii) execução de trades, via telefone ou Bloomberg Instant Messenger; (iii) balanceamento de portfólio por meio do acesso às posições das carteiras via: (a) sistema Lote 45, para os fundos onshore e offshore; (b) sistema Comdinheiro para as carteiras administradas; (c) site do administrador BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda., para os fundos onshore, e os relatórios em planilhas enviados via e-mail pelo administrador dos fundos offshore (Apex Fund Services S.A. e MUFG Fund Services); (iv) batimento diário da carteira reportada pelo administrador para os fundos onshore e mensal para os fundos offshore; (v) instruções da liquidação de trades enviadas para o administrador; e (vi) verificação do resultado reportado pelo administrador.

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

a. Quantidade de profissionais



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

6

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade de gestão de investimento

A SJG requer dos seus administradores e funcionários o conhecimento da legislação, da regulamentação e de todas as regras que lhe são aplicáveis, inclusive aquelas expostas no Manual de Conduta que disciplina sua conduta profissional na SJG. Na hipótese de existência de conflitos entre as regras a serem observadas, os colaboradores são orientados a observar sempre aquelas regras que se mostrarem mais rígidas e limitadoras. Ademais, para que a prestação dos serviços ocorra da maneira esperada pela SJG, deverá ser buscado o contínuo aperfeiçoamento técnico profissional. Nesse sentido, a SJG sempre proporcionará os treinamentos que se fizerem necessários para manter uma equipe de profissionais competentes, diligentes e responsáveis, seguindo o princípio basilar em relação à prevenção e combate a tais práticas é a identificação e o conhecimento dos clientes e o monitoramento contínuo das operações que estes realizam ou pretendem realizar.

Fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados

Antes da contratação dos serviços, a SJG analisa a empresa, os seus sócios e/ou diretores, a estrutura, os recursos humanos e os sistemas utilizados, bem como consulta, quando possível, clientes da empresa terceirizada prestadora de serviços para obter referências a seu respeito. Adicionalmente, a SJG discute especificamente temas relacionados à segurança e à confidencialidade das informações da SJG e de seus clientes a que o terceirizado contratado venha a ter acesso, conforme o caso.

Durante a prestação dos serviços, os documentos, processos e informações apresentados pelo prestador do serviço são revisados pelo setor que utilizará o serviço contratado.

Caso ocorra alguma não conformidade decorrente do serviço prestado, o assunto é imediatamente reportado dentro dos níveis hierárquicos adequados.

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

Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos empregados no atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados são como segue:

(i) Manual de Conduta assinado por todos os colaboradores da SJG, incluindo funcionários, sócios e administradores;

(ii) atendimento aos requerimentos do Código ANBIMA de Administração de Recursos de Terceiros;

(iii) divulgação e atualização, quando aplicável, da página da SJG na rede mundial de computadores, com a respectiva divulgação informações pertinentes;

(iv) fornecimento de treinamentos para todos os funcionários com acesso a informações confidenciais;

(v) em relação à prevenção e combate ao crime de lavagem de dinheiro, bem como ao financiamento e favorecimento ao terrorismo, a SJG identifica algumas premissas e informações mínimas indispensáveis para o início e prestação dos seus serviços, com o intuito de identificar e conhecer os seus clientes, bem como monitorar as operações que estes pretendem realizar. Essas premissas e informações mínimas indispensáveis são as seguintes:

a. estabelecimento da identidade de cada cliente, com o respectivo cadastro individualizado, atualizado em intervalos não superiores a 24 meses, no caso dos clientes ativos, ou quando eventuais clientes titulares de contas inativas manifestem interesse em reativar suas contas;

b. conhecimento das atividades desenvolvidas pelo cliente, para averiguação mínima sobre a origem e destino dos valores disponíveis do cliente, a fim de determinar o tipo de transação que este vai realizar de acordo com o seu perfil;

c. atenção especial dispensada a transações que apresentem atipicidades e possam, após detecção e respectiva análise, configurar indícios de lavagem de dinheiro e/ou financiamento do terrorismo e ao financiamento da proliferação de armas de destruição em massa, nos termos do artigo 20 da Resolução CVM 50; e

d. efetuar o registro de todas as transações independentemente do valor, de forma que as operações que apresentem as características acima descritas possam ser verificadas em tempo hábil e comunicadas aos órgãos competentes de forma tempestiva, sendo que os colaboradores deverão conservar tais registros de forma organizada pelo prazo de cinco anos, mesmo que a SJG não tenha optado por comunicar as autoridades competentes.

Dessa forma, os colaboradores da SJG devem monitorar de forma contínua as operações realizadas, mantendo-se atentos a transações não usuais envolvendo clientes e/ou outros colaboradores e sempre que houver conduta suspeita, a administração da SJG deverá ser notificada por escrito, para que sejam tomadas as medidas pertinentes.

d. A forma como a empresa garante a independência do trabalho executado 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

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

O Manual de Conduta assinado por todos os colaboradores da SJG estabelece que os colaboradores devem sempre buscar manter independência e objetividade nas suas atividades e decisões profissionais. A administração da SJG reforça continuamente esta conduta junto aos seus colaboradores.

Anualmente, o Administrador de Compliance e Gestão de Risco deve preparar o relatório de conformidade relativo ao ano civil imediatamente anterior contendo, no mínimo: (i) as conclusões dos exames efetuados; (ii) as recomendações a respeito de deficiências, com estabelecimento de cronograma de saneamento, quando for o caso; e (iii) a manifestação do diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários ou, quando for o caso, pelo diretor responsável pela gestão de risco a respeito das deficiências encontradas em verificações anteriores e das medidas planejadas, de acordo com cronograma específico, ou efetivamente adotado para saná-las.

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

a. Quantidade de profissionais *

6

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A área de gestão de riscos tem como principal competência mensurar, gerir e analisar os riscos inerentes a atividade de gestão, objetivando a mitigação de resultados negativos. Além disso, compete à área implementar as regras e procedimentos previstos na Política de Gestão de Riscos da SJG, sem prejuízo das competências que lhe são atribuídas no artigo 37, § 2º, do Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para Administração de Recursos de Terceiros.

A gestão dos riscos de liquidez é realizada em conjunto entre a SJG e os administradores dos fundos geridos.

Adicionalmente, a equipe de gestão da SJG monitora diariamente os ativos e as obrigações dos fundos e analisa os cenários político, econômico e o ambiente interno e externo, no intuito de reduzir os potenciais riscos de liquidez inerentes às carteiras dos fundos geridos.

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

Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos na gestão de riscos são os seguintes:

Sistemas de informação. A SJG utiliza os seguintes sistemas de informação:

(i) Sistema Lote 45, que gera as seguintes informações relacionadas aos fundos onshore e offshore geridos pela SJG: composição da carteira dos fundos, análise de enquadramento do fundo, cálculo do Value at Risk (V@R) e do cenário de estresse dos fundos geridos pela SJG;

(ii) Sistema Comdinheiro, que gera informações relacionadas as carteiras administradas: composição, balanceamento e liquidez das carteiras; e

(iii) Sistema Bloomberg, utilizado para captura dos preços dos ativos nos quais os fundos investem.

Rotinas e procedimentos

(i) Análise do Value at Risk (V@R) com base na simulação das perdas do portfólio em cenários de estresse;

(ii) Monitoramento junto ao administrador contratante quanto ao enquadramento dos fundos sob a gestão da SJG; e

(iii) Análise do enquadramento dos fundos sob gestão da SJG com base na posição dos fundos em relação aos seus respectivos regulamentos.

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

A independência do trabalho executado pelo gestor de risco é garantida (i) pela inexistência de subordinação hierárquica e (ii) pela segregação dos locais onde funcionam o front office, em São Paulo, e o back office, em Recife.

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

a. Quantidade de profissionais

0

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

Não aplicável - a SJG não exerce as atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

Não aplicável - a SJG não exerce as atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas.

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

a. Quantidade de profissionais

0

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Não aplicável - a SJG não realiza a distribuição de cotas de fundos de investimento.

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

Não aplicável - a SJG não realiza a distribuição de cotas de fundos de investimento.

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

Não aplicável - a SJG não realiza a distribuição de cotas de fundos de investimento.

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

Não aplicável - a SJG não realiza a distribuição de cotas de fundos de investimento.

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

Não há outras informações que a SJG julgue relevantes para fins deste item.

9. Remuneração da Empresa

9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 2.1. do anexo 15-I, indicar as principais formas de remuneração que pratica:

As receitas operacionais da SJG são compostas pela remuneração dos serviços de gestão prestados aos fundos geridos pela SJG. As taxas de gestão são calculadas com base no montante do patrimônio líquido dos fundos. As receitas de taxa de gestão são auferidas em periodicidade mensal ou semestral, conforme as políticas de cada fundo gerido.

9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total aferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente dos clientes, durante o mesmo período, em decorrência de:

a. Taxa com bases fixas (%):

100,00

b. Taxa de performance (%):

0,00

c. Taxa de ingresso (%):

0,00

d. Taxa de saída (%):

0,00



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

e. Outras taxas (%):

0,00

Total (%):

100,00

9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:

Não há outras informações que a SJG julgue relevantes para fins deste item.

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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

Item facultativo para o administrador registrado na categoria gestor de recursos.

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

Para minimizar custos, a SJG utiliza diversas contrapartes para realização de operações OTC "over-the-counter" e obtém diversas cotações antes de fechar a operação.

Nos mercados organizados, a SJG busca operar com a contraparte que cobra a menor corretagem possível.

Após cada operação, o valor pago em corretagens é registrado em uma planilha, assim como o spread de compra e venda dos ativos OTC. O valor total pago em corretagens para cada contraparte é frequentemente monitorado e a SJG procura manter um equilíbrio entre valores pagos e qualidade do serviço prestado.

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

Os sócios, administradores, funcionários e todos que de alguma forma se envolvem nas atividades de administração de carteira de valores mobiliários pela SJG são orientados e alertados para sempre buscar manter independência e objetividade nas suas atividades e decisões profissionais.

Os colaboradores assumem o compromisso de não oferecer, solicitar ou aceitar quaisquer presentes, benefícios ou compensações, que possam de alguma forma comprometer a independência e objetividade de sua atuação.

Ademais, conforme previsto no Manual de Conduta, toda e qualquer vantagem que possa ser alcançada pelo colaborador deverá ser imediatamente transferida ao cliente da SJG.

Caso, durante a prestação dos serviços, surja alguma situação de conflito de interesse, a prestação do serviço em questão deverá ser imediatamente suspensa; as partes potencialmente afetadas e os administradores da SJG deverão ser comunicados, observado que a prestação dos serviços correspondentes ficará suspensa até que seja definida entre os envolvidos a postura a ser tomada.

As regras acima constam no Manual de Conduta da SJG, que é entregue a todos os colaboradores da SJG, dos quais se exige a assinatura de Termo de Adesão ao Manual de Conduta.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

A SJG possui dois escritórios principais. A equipe de gestão (front office) fica localizada na Avenida Brigadeiro Faria Lima, 2601, conjunto 43, na Cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, ao passo que o backoffice opera na Avenida Engenheiro Domingos Ferreira, 2589, na Cidade de Recife, Estado de Pernambuco.

Na eventual impossibilidade de funcionários da SJG desempenharem suas respectivas tarefas a partir do seu sítio principal, eles receberão ordens para utilizar a estrutura de trabalho remoto (baseada na nuvem) da SJG.

Caso a situação de contingência seja duradoura, os funcionários podem ser realocados para o outro sítio (funcionários de São Paulo realocados para Recife ou vice-versa), de modo que todos possam trabalhar em um mesmo ambiente enquanto durar a contingência. Na impossibilidade de funcionamento de ambos os sítios, a SJG conta com estrutura pronta para trabalho dos funcionários em regime de home office.

A tabela constante do Anexo II descreve as tarefas mínimas que cada colaborador precisa estar apto a desempenhar bem como as ferramentas necessárias para tal finalidade.

Se, em qualquer circunstância, o acesso de pessoas ao escritório estiver indisponível, os seguintes passos serão seguidos:

- Utilizar o acesso aos e-mails via WebMail (Office 365), via qualquer navegador no endereço

<https://login.microsoftonline.com/>

- O acesso ao controle de posição via sistema Lote 45 pode ser realizado nos computadores em que o usuário autorizado tenha o sistema. Os usuários chave também podem acessar o sistema Bloomberg Anywhere, por meio do site https://bba.bloomberg.net/?utm_source=bloomberg-menu&utm_medium=brazil, para obter informações gerais dos mercados

- Acesso de arquivos por meio das contas do Microsoft 365, através das plataformas Azure e Sharepoint, onde os usuários poderão selecionar os arquivos necessários para efetuar downloads.

Em caso de indisponibilidade de energia, a SJG dispõe de NoBreak adicional de 3KVA, o qual garante que equipamentos dos usuários continuem em funcionamento, assim assegurando que nenhum arquivo seja perdido

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

Item facultativo para o administrador registrado na categoria gestor de recursos.

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

Não aplicável.

10.7. Endereço da página do administrador na rede mundial de computadores na qual podem ser encontrados os documentos exigidos pelo art. 14 desta Instrução

www.sjasset.com.br

11. Contingências

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

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

a. Principais fatos *

Não há.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

a. Principais fatos

Não há.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

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

Não há.

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 tenha figurado no polo passivo, indicando:

a. Principais fatos

Não há.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

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

Não há.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

12. Declarações

Declaração do administrador, atestando:

Que reviu o formulário de referência

Marcado

Que o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo de seus negócios (PF) ou da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa (PJ)

Marcado

Declarações adicionais do administrador, informando sobre



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

Nada a declarar

Mercado

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

Nada a declarar

Mercado

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

Nada a declarar

Mercado

Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

Nada a declarar

Mercado

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

Nada a declarar

Mercado

Títulos contra si levados a protesto

Nada a declarar

Mercado

Data de envio: 28/03/2024 - 15:30:00

Data de impressão: 28/03/2024

Hora de impressão: 15:37:52