



## 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: 42.611.920/0001-96

Nome do Administrador de Carteira: QUANTIQUE M3 INVESTMENTS LTDA.

Ano de competência: 2024

## 2. Histórico da empresa

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

A Quantique M3 Investments Ltda. ("Quantique") fundada em julho de 2021, 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 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. Principais eventos societários tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário

Fernando Vieira dos Santos, Camila Fairbanks, Guilherme Barreto, Renato Ometto e Thomas Citrin ingressaram na sociedade em 2021. Marcos Prado, Débora Gomide e Mariana Matsumoto ingressaram na sociedade em 2022. Breno Leal, Michelle Graczyk, Rafael Rosenzvaig e Natália Vieira ingressaram na sociedade em 2023. Raffael Russo e Maria Eduarda Bicalho ingressaram na sociedade em maio/2024.

Em setembro/24, consolidamos a estrutura societária com a Quantique Holding Ltda como controladora e sócia única da Quantique M3 Investments Ltda.

#### b. Escopo das atividades

Desde seu credenciamento não ocorreram mudanças no escopo das atividades da Quantique.

#### c. Recursos humanos e computacionais

Desde a fundação não ocorreram mudanças materiais nas estruturas de recursos humanos e computacionais da Quantique, além dos eventos societários descritos acima.

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

Desde a fundação não ocorreram mudanças nas regras, políticas, procedimentos e controles internos da Quantique.

## 3. Recursos Humanos

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

#### a. Número de sócios:

15

#### b. Número de empregados:

15

#### c. Número de terceirizados:

0



## 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
179.117.148-60	FERNANDO VIEIRA SANTOS FILHO
220.539.598-00	RENATO OMETTO GONÇALVES FILHO
222.072.908-75	MARCOS DE AGOSTINI PRADO

### 4. Auditores

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

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

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

### 5. Resiliência Financeira

#### 5.1. Com base nas demonstrações financeiras, ateste:

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

Não

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

Sim

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

**Demonstração Financeira: Não se aplica**

**Relatório: Não se aplica**

### 6. Escopo das Atividades

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

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

A Quantique é composta por profissionais com trajetória e histórico de sucesso no Mercado Financeiro e de Capitais, especialmente na gestão de investimentos, e suas estratégias customizáveis são desenvolvidas para alcançar os objetivos estabelecidos.

A Quantique realiza apenas gestão discricionária de fundos de investimento, empregando estratégias de investimento sistemáticas, que utilizam técnicas de análise quantitativa e tecnologias de ponta.



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

**b. Tipos e características dos produtos administrados ou geridos (fundos de investimento, fundos de investimento em participação, fundos de investimento imobiliário, fundos de investimento em direitos creditórios, fundos de índice, clubes de investimento, carteiras administradas, etc.)**

Gestão de Fundo de Investimento.

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

Ações, debêntures, bônus de subscrição, outros títulos mobiliários conversíveis em ações de emissão de companhias, abertas ou fechadas, títulos públicos, etc.

**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 Quantique exerce somente a atividade de administração de carteiras e de valores mobiliários, não havendo, portanto, potenciais conflitos de interesses.

**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**

Em 2024, consolidamos a estrutura societária com a Quantique Holding Ltda como controladora única da Quantique M3 Investments Ltda. Ambas as empresas operam com alinhamento estratégico e não há qualquer conflito de interesses entre suas atividades.

**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	15	1	16



## 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	12	0	12
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	0	1	1
iii. Instituições Financeiras	0		0
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0		0
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	0		0
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	0	0	0
vii. Seguradoras	0		0
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	0		0
ix. Clubes de Investimento	0	0	0
x. Fundos de Investimento	3		3
xi. Investidores não Residentes	0		0

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

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	15	1	16

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 28.586.389,96	R\$ 4.241.390,10	R\$ 32.827.780,06

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

R\$ 6.578.450,99

**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\$ 23.157.001,33	
R\$ 2.864.374,72	
R\$ 1.076.590,97	
R\$ 1.063.859,86	
R\$ 1.018.595,87	
R\$ 769.756,91	
R\$ 515.363,73	
R\$ 101.281,70	

### 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\$ 25.394.810,38	R\$ 0,00	R\$ 25.394.810,38
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 0,00	R\$ 4.241.390,10	R\$ 4.241.390,10
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\$ 3.191.579,58		R\$ 3.191.579,58
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
	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 28.586.389,96	R\$ 4.241.390,10	R\$ 32.827.780,06

### 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\$ 3.539.349,60
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R\$ 0,00
c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R\$ 10.769.332,87
d. Cotas de fundos de investimento em ações	R\$ 0,00
e. Cotas de fundos de investimento em participações	R\$ 0,00
f. Cotas de fundos de investimento imobiliário	R\$ 0,00
g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R\$ 0,00
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 0,00
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 0,00
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 18.117,91
k. Outros valores mobiliários	R\$ -18.599,61
l. Títulos públicos	R\$ 13.986.896,15
m. Outros ativos	R\$ 4.532.683,14
Total	R\$ 32.827.780,06

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

Não aplicável, visto que a Quantique não exerce as atividades de administração fiduciária.

### 6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

No preenchimento do item 6.4 foi divulgado o líquido das posições long com as posições short na rubrica "a. Ações".

## 7. Grupo Econômico

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

#### a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
57.624.860/0001-13	Quantique Holding Ltda

#### b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
-	Não Informado

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

CNPJ	Nome
-	Não Informado

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

CNPJ	Nome
-	Não Informado

#### e. Sociedades sob controle comum



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

CNPJ	Nome
-	Não Informado

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

Nenhum arquivo selecionado.

## 8. Estrutura Operacional e Administrativa

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

#### a. Atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico

- Comitê Executivo: responsável por sua administração e avaliação das decisões estratégicas relativas aos negócios, escopo de atividades, suporte operacional, projetos relevantes, dentre outros temas.
- Comitê de Risco: tem como atribuições dar parâmetros gerais, orientar e aprovar a política de risco; estabelecer objetivos e metas para a área de risco; e avaliar resultados e performance da área de risco, solicitar modificações e correções.
- Comitê de Operações: Decide sobre: i) criação ou extinção de fundos ou outras estruturas jurídicas para implementar as estratégias de investimento dos fundos da Quantique, ii) contratação e diretrizes de relacionamento com parceiros (administradores, PBs, corretoras, etc.) e iii) o desenho e a implantação de rotinas operacionais para suporte e execução das estratégias de investimento dos fundos ou outras atividades da empresa.
- Comitê de Compliance: Tem por objetivo o controle e monitoramento das atividades relacionadas à adoção de estratégias, políticas e medidas voltadas para a gestão e mitigação de riscos, controles internos e adequação às normas previstas na legislação e regulamentação aplicáveis às atividades da Gestora.
- Comitê de Investimentos: Tem por objetivo assessorar as decisões relacionadas à gestão dos fundos de investimento. A reunião 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 Modelagem: a gestão discute a parametrização dos atuais modelos juntamente com a análise de performance dos mesmos. Nesta ocasião também são discutidas novas ideias que poderão servir de estudo para futura implementação nos fundos geridos

As aprovações do Comitê são aprovadas por maioria e suas deliberações serão formalizadas em ata eletrônica quando necessária. Os seguintes profissionais compõem o referido comitê com direito a 01 (um) voto.

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 a poder de veto em ambos os comitês, para ser utilizado em matérias que considerar contra os princípios de gestão de riscos ou aos controles internos da Quantique.

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

Executivo: Fernando Santos, Camila Fairbanks e Renato Ometto. Frequência: Mensal  
Risco: Marcos Prado, Fernando Santos, Renato Ometto, Camila Fairbanks, Mariana Matsumoto, Nicholas Richers.  
Frequência: Mínima mensal ou quando solicitado. Ata eletrônica com resumo das principais decisões tomadas.  
Operações: Marcos Prado, Fernando Santos, Renato Ometto e Camila Fairbanks. Frequência: Mínima mensal ou quando solicitado. Ata eletrônica com resumo das principais decisões tomadas.  
Compliance: Camila Fairbanks, Mariana Matsumoto, Marcos Prado, Fernando Santos e Renato Ometto. Frequência: Mínima mensal ou quando solicitado. Ata eletrônica com resumo das principais decisões tomadas.  
Investimentos: Renato Ometto, Fernando Santos, Thomas Citrin. Frequência: Mensal  
Modelagem: Fernando Santos, Renato Ometto e Michelle Graczyk. Frequência: Mensal.

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

Fernando Vieira Santos Filho - Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários  
Camila Fairbanks - Diretora Responsável pelo Compliance, Gestão de Riscos, Prevenção à Lavagem de Dinheiro.

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





## 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

Nenhum arquivo selecionado

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

CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos
179.117.148-60	FERNANDO VIEIRA SANTOS FILHO	53	Administrador de Empresas	Diretor de Gestão de Carteira	12/08/2022	Indeterminado	
300.170.308-38	CAMILA FAIRBANKS RIBEIRO CARDOSO	42	ADMINISTRADORA DE EMPRESAS	Diretora de Compliance, Gestão de Risco e PLD	12/08/2022	Indeterminado	

### 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)	179.117.148-60	FERNANDO VIEIRA SANTOS FILHO	53	Administrador de Empresas		12/08/2022				
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	300.170.308-38	CAMILA FAIRBANKS RIBEIRO CARDOSO	42	ADMINISTRADORA DE EMPRESAS		12/08/2022				
8.5 (COMPLIANCE)	300.170.308-38	CAMILA FAIRBANKS RIBEIRO CARDOSO	42	ADMINISTRADORA DE EMPRESAS		12/08/2022				

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

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída
----------------	-----------------	-----------------	-------	---------------------	-----------------	---------------

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

#### a. Quantidade de profissionais





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

O processo de decisão, seleção e alocação de investimentos passa por diversas fases e análises criteriosas, detalhadas e abrangentes, antes da área de gestão realizar a execução dos investimentos, ou desinvestimentos, nos fundos de investimento geridos pela Quantique. O referido processo conta com o suporte de profissionais de outras áreas da Quantique, uma vez que a principal forma de análise é quantitativa.

Importante ressaltar que o processo conta com a supervisão de membros da área de gestão e de Pesquisa Quantitativa em todas as etapas. As estratégias são inicialmente definidas em conjunto pela área de gestão e pesquisa quantitativa. Após a captura inicial dos dados necessários (se esses ainda não constarem na base de dados proprietária), é realizado um criterioso processo de tratamento transformando-os em dados limpos e prontos para serem utilizados pelos modelos desenhados para atenderem a estratégia. Todos os modelos são propriamente treinados, validados (in-sample) e testados (out-of-sample) antes de produzir qualquer alocação.

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

A Quantique conta com terminais de sistemas para consulta de dados financeiros e balanços de empresas, como Bloomberg e Refinitiv, bem como os serviços do sell side das corretoras com que opera, como o acesso a relatórios, modelos financeiros e a conferências com empresas listadas.

Para uma estratégia ser levada ao Comitê de Investimentos para aprovação, é produzido um back-test onde as métricas de performance e risco são analisadas. A alocação de risco para a estratégia, apesar de calculada sistematicamente, deve ser aprovada pelo Comitê de Investimentos, e deve respeitar os limites estabelecidos pelo Comitê de Risco. Após a aprovação do Comitê de Investimento, as estratégias também devem ser aprovadas pelos Comitês de Risco e verificadas pelos Comitês Operacional e Compliance. As transações geradas pelo início, rebalanceamento e término da estratégia são executadas pela área de gestão; que se responsabiliza a certificar que as posições finais a cada dia estão de acordo com a estratégia, e o risco está enquadrado. Qualquer alteração realizada diferente da estratégia aprovada deve ser reportada ao Comitê de Investimentos em até 24 horas. A área de Operações realiza uma checagem diária independente, certificando que o total de risco das estratégias estão dentro dos limites estabelecidos pela Diretora de Gestão de Riscos, com auxílio comitê de risco, para cada um dos fundos. Se houver desenquadramento, este é imediatamente reportado aos Comitês de Risco, Investimento e Compliance. E o que estiver próximo ao limite será reportado ao Comitê de Risco e a área de gestão até a manhã seguinte.

## **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**

5

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

O acompanhamento do cumprimento das regras e procedimentos de Compliance da Quantique é 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**



## 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

Controles internos consistem em um ou mais processos desenvolvidos para garantir o atingimento dos objetivos da Quantique, 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 dos sistemas Lote45 e Compliasset, podendo contratar outros sistemas caso a Diretora de Risco e Compliance considere necessário.

As referidas normas e políticas da Quantique são os principais meios de fiscalização das atividades pela Diretora 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 Quantique 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 Quantique, bem como, disseminar a cultura de controles para garantir o cumprimento da Resolução CVM n.º 21, de 25 de fevereiro de 2021, 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**

A Diretora de Risco e Compliance tem total independência para tomar qualquer decisão quanto às questões de compliance, inclusive para convocar reuniões extraordinárias do comitê de Risco e Compliance.

## **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 Responsável pela Gestão de Riscos atua 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 Quantique Machine, Math & Mind 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. Volatilidade;
- IV. Stress Test; e
- V. Liquidez.

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



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

A Quantique 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.

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 Compliance, que apresenta periodicidade mensal, também registrados através de atas de reunião.

Cabe conferir que, existem relatórios às áreas de Compliance e Gestão, contendo as principais disposições acerca dos riscos, em especial os valores de VaR e Stress Testing por fundo, e para os fundos de investimento que possuam limites, é ainda informado o percentual de aproveitamento dos mesmos.

Ainda, com intuito de auxiliar a atividade de gestão de riscos, a Quantique utiliza o sistema Lote45 para suporte. As demais diretrizes de risco podem ser encontradas em sua Política de Gestão de Riscos.

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

Por fim, a Diretora Responsável pela Gestão de Riscos atuará 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 e Compliance.

### **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 aplicado à categoria de Gestor de Recursos.

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

Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.

### **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**

A Quantique não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.

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

A Quantique não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.

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

A Quantique não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.

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

A Quantique não distribui as cotas de seus próprios fundos de investimento.



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

## 9. Remuneração da Empresa

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

A principal forma de remuneração da Quantique é através de Taxas com Bases Fixas (Taxa de Administração) e Taxa de Performance.

### 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

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

0,00

#### Total (%):

100,00

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

## 10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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



## 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

Durante o processo de Contratação, os Colaboradores obtêm informações qualitativas e de custo sobre o Terceiro que tenha interesse em iniciar vínculo jurídico com a Quantique, de modo a permitir um melhor julgamento durante a pré-seleção.

A área de Compliance da Gestora ("Área de Compliance") é responsável por realizar a avaliação de Terceiros. Nesse caso, o processo de onboarding e cadastro de Terceiros começa quando da apresentação de um novo Fornecedor, através de envio do kit cadastral, composto por

a) ficha cadastral;

b) questionário ANBIMA de Due Diligence aplicável, conforme modelo disponibilizado no website da Gestora ; e

c) documentação acessória para fins de cadastro e abono de poderes.

Nos casos de contratação de Terceiros para atividades que não possuam um questionário ANBIMA de Due Diligence, a Gestora irá diligenciar para verificar a integridade, capacidade técnica e conformidade do potencial Fornecedor, podendo realizar visitas de Due Diligence à sua sede, bem como quaisquer outras medidas que se mostrem necessárias para a avaliação rigorosa e acurada do Fornecedor.

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 Quantique realizará um monitoramento contínuo, pelo prazo que durar a Contratação, e analisando o objeto contratado vis a vis a 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 Quantique.

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

Para minimizar os custos de transação na negociação dos ativos, a Quantique procura:

- 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 Quantique poderá permitir o uso de Soft Dollar desde que o benefício a ser concedido:

- se reverta diretamente para a atividade de gestão, e
- 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. 18, VI, da Resolução CVM n.º 21, de 25 de fevereiro de 2021, 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.

Por fim, conforme art. 18, VI, da Resolução CVM n.º 21, de 25 de fevereiro de 2021, a Quantique adotará a transferência à carteira do fundo de investimento qualquer benefício ou vantagem que possa alcançar em decorrência de sua condição de gestora.

### **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

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

I.Backup executado diariamente em nuvem;

II.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 Quantique;

III.Manutenção de meios remotos seguros para o trabalho de seus Colaboradores;

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

### **10.5. Descrever as políticas, as 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 Quantique são monitoradas em conformidade com os padrões de risco correspondentes e diariamente são gerados relatórios com essas informações.

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.

Cumpra ainda salientar que as operações com ativos de crédito não fazem parte do escopo de atuação da Quantique.

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

A Quantique não distribui 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**

[www.quantM3.com](http://www.quantM3.com)

## **11. Contingências**

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

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

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

A Quantique não é parte em processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

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

Não aplicável.

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

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



## 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 Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários não possui qualquer tipo de contingência.

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

Não aplicável.

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

Não existem outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores.

### **11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas no últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que tenha figurado no polo passivo, indicando:**

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

Nos últimos 5 anos a Quantique não foi parte em processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

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

Não aplicável.

### **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**

Nos últimos 5 anos o Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários não possuiu qualquer tipo de contingência.

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

Não aplicável.

## **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: 25/03/2025 - 13:04:00

Data de impressão: 25/03/2025

Hora de impressão: 13:06:17