



ANEXO 15-II

Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

ADMINISTRADORES DE CARTEIRAS DE VALORES MOBILIÁRIOS	
1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário	
Guilherme Figueiredo - Diretor responsável pela administração de carteira de valores mobiliários / Edson Maioli - Diretor responsável pela gestão de risco e pelo cumprimento de regras, políticas procedimentos e controles internos.	
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	
Informamos que a referida declaração foi firmada em 31 de Dezembro de 2019 pelo diretores acima identificados e encontra-se disponível na sede da Empresa.	
2. Histórico da empresa	
2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa	
A AMS Capital Ltda. (“ <u>AMS Capital</u> ” ou “ <u>Empresa</u> ”) é uma sociedade limitada constituída no Brasil em 5/11/1998 que tem como objetivo social principal a atuação como gestora de fundos de investimento e administradora de carteira de valores mobiliários. A AMS Capital atua em diversos segmentos do mercado financeiro e de capitais, incluindo, mas não se limitando, à renda fixa e variável, moedas, crédito, produtos estruturados e mercadorias (<i>commodities</i>).	
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 aquisições de controle societário	

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

<p>- Em 4 de Janeiro de 2017 a Everest Participações Ltda. (CNPJ 03.203.507/0001-30) incorporou a AMS International Gestão Financeira Ltda. (CNPJ 09.356.064/0001-69).</p> <p>- Em 4 de Janeiro de 2017, em ato contínuo à incorporação mencionada acima, os sócios da incorporadora decidiram alterar sua denominação para AMS Capital Ltda.</p>	
b.	escopo das atividades
Sem alterações no escopo das atividades.	
c.	recursos humanos e computacionais
Sem alterações em recursos humanos e computacionais.	
d.	regras, políticas, procedimentos e controles internos
<p>As políticas da AMS Capital, bem como procedimentos e regras contidos em tais políticas e controles internos relacionados a tais políticas foram ajustados em atendimento ao Novo Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para Administração de Recursos de Terceiros, que entrou em vigor em janeiro de 2019.</p> <p>As políticas atualizadas foram enviadas à ANBIMA e estão disponíveis no <i>website</i> da AMS Capital: www.msafra.com.br.</p>	
3. Recursos humanos	
3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:	
a.	número de sócios
13 (treze)	
b.	número de empregados
21 (vinte e um)	
c.	número de terceirizados

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

0 (zero)
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
Guilherme Figueiredo (CPF 013.124.188-50) / Ezra Moise Safra (CPF 091.351.188-90)
4. Auditores
4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:
a. nome empresarial
b. data de contratação dos serviços
c. descrição dos serviços contratados
Os fundos de investimento geridos pela AMS Capital são auditados regularmente por auditor selecionado e contratado pela Intrag DTVM Ltda., instituição prestadora do serviço de Administração Fiduciária e Custódia. As auditorias dos fundos geridos (data referência 31/12/2019) realizadas pela Deloitte foram contratadas em 15/01/2019 e as da Ernest & Young em 31/12/2018. A AMS Capital Ltda. não possui auditoria externa.
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
As receitas da AMS Capital, em decorrência de taxas com base fixas, são suficientes 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

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

reais)
O Patrimônio da AMS Capital é superior a R\$ 300.000,00 e maior que 0,02% dos recursos financeiros sob administração.
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 AMS Capital é gestora de recursos, devidamente credenciada como administradora de carteira de valores mobiliários perante a CVM. Os serviços de Custódia e Administração Fiduciária são desempenhados pelo Itaú Unibanco S.A. e a controladoria pela Intrag DTVM Ltda.
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 fundos de investimento.
c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão
Os ativos que podem fazer parte do portfólio dos fundos geridos pela AMS Capital são: títulos de renda fixa de emissão de instituição financeira, debêntures, títulos públicos federais, ações emitidas por companhias abertas e negociadas em bolsa, cotas de fundos de investimentos regulados pela CVM nº 555/15, operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais, operações de derivativos e outros valores mobiliários permitidos pela legislação e regulamento dos fundos de investimentos.
d. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor
A AMS Capital não atua como distribuidora de cotas de fundos de investimento.
6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários, destacando:

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

a. os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades; e
A AMS Capital não exerce nenhuma outra atividade, a não ser gestão de fundos de investimento.
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 existem outras atividades que não a administração de valores mobiliários, não havendo, portanto, conflitos de interesse.
6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos e carteiras administradas geridos pela empresa, fornecendo as seguintes informações:
a. número de investidores (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)
Total de 7 (sete) investidores, todos pessoas naturais cujos investimentos estão alocados em fundos destinados a investidores qualificados.
b. número de investidores, dividido por:
i. pessoas naturais
7 (sete)
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)
-
iii. instituições financeiras
-
iv. entidades abertas de previdência complementar
-
v. entidades fechadas de previdência complementar

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

-
vi. regimes próprios de previdência social
-
vii. seguradoras
-
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil
-
ix. clubes de investimento
-
x. fundos de investimento
-
xi. investidores não residentes
-
xii. outros (especificar)
-
c. recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)
Total de R\$ 891 milhões sob gestão alocados em fundos destinados a investidores qualificados.
d. recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior
Os fundos geridos no país não possuem aplicação em ativos financeiros no exterior nesta data. A AMS faz a gestão de fundos no exterior que não estão contemplados no item 6 deste formulário.

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

e. recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)
1º R\$ 789 milhões / 2º R\$ 92,4 milhões / 3º R\$ 4,1 milhões / 4º 3,9 milhões / 5º R\$ 1,2 milhões / 6º R\$ 779 mil / 7º R\$ 198 mil
f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:
i. pessoas naturais
R\$ 892 milhões
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)
-
iii. instituições financeiras
-
iv. entidades abertas de previdência complementar
-
v. entidades fechadas de previdência complementar
-
vi. regimes próprios de previdência social
-
vii. seguradoras
-
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil
-

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

ix. clubes de investimento
-
x. fundos de investimento
-
xi. investidores não residentes
-
xii. outros (especificar)
-
6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:
a. ações
R\$ 519 milhões
b. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras
-
c. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras
-
d. cotas de fundos de investimento em ações
-
e. cotas de fundos de investimento em participações
-
f. cotas de fundos de investimento imobiliário

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

-
g. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios
-
h. cotas de fundos de investimento em renda fixa
-
i. cotas de outros fundos de investimento
-
j. derivativos (valor de mercado)
-
k. outros valores mobiliários
R\$ 3 milhões
l. títulos públicos
R\$ 370 milhões
m. outros ativos
-
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
6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
A AMS Capital faz gestão de fundos de investimento fora do país. Os valores sob gestão nestes fundos não estão contemplados no item 6 deste formulário.

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

7. Grupo econômico
7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:
a. controladores diretos e indiretos
Ezra Moise Safra
b. controladas e coligadas
-
c. participações da empresa em sociedades do grupo
-
d. participações de sociedades do grupo na empresa
-
e. sociedades sob controle comum
-
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.
-N/A
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
A estrutura operacional e administrativa da gestora é composta pelo Diretor Presidente, Diretor Responsável pela Administração de Carteiras, Diretoria Financeira e de <i>Compliance</i> , Diretoria de Mercados Emergentes, Diretoria de Renda Variável Internacional, Diretoria de Crédito, Diretoria de

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

Renda Variável, Diretoria de Renda Variável de Mercados Emergentes, Diretor de Análise e Pesquisa, Diretoria Econômica, Diretoria Contábil, Diretoria de Câmbio e Diretoria Jurídica. O departamento técnico tem a seguinte composição: áreas administrativas: contas a pagar/receber, recursos humanos, contabilidade e controladoria, risco, jurídico, *compliance* e tecnologia; área de gestão de recursos de terceiros: economistas, analistas, *traders* e *portfolio managers*.

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

Comitê de Compliance: É composto pelo Diretor Presidente, Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários, Diretor Financeiro e de *Compliance* e a Diretora Jurídica. A função principal é a implementação e o monitoramento do cumprimento do Manual de *Compliance*, do Código de Ética e das demais Políticas da Empresa. As reuniões acontecem no mínimo anualmente e sempre que necessário e não há registro em ata das discussões e decisões tomadas. Quando necessária, a formalização ocorre por *e-mail*. Comitê de Crédito: É composto pelo Diretor Presidente, pelo Diretor Responsável pela Administração de Carteiras e pelo Diretor de Crédito. A função principal é a análise e aprovação de operações de crédito. As reuniões acontecem sempre que necessário conforme determinado na Política de Gestão de Risco e não há registro em ata das discussões e decisões tomadas. Quando necessária, a formalização ocorre por *e-mail*. Comitê de Risco: É composto pela analista de risco de mercado, o Diretor Financeiro e de *Compliance* (que é o responsável pela área de risco), a Diretora Jurídica e o Diretor Contábil, responsável pelo *Back-Office*. A função principal é supervisionar e controlar o risco das carteiras sob gestão, bem como as atividades da área. As reuniões acontecem sempre que necessário e não há registro em ata das discussões e decisões tomadas. Quando necessária, a formalização ocorrerá por e-mail enviado ao Comitê de Risco. O comitê recebe diariamente relatórios de risco de mercado. Comitê de Tecnologia da Informação e Segurança Cibernética: É composto pelo Diretor Financeiro e de *Compliance*, o Gerente de TI e a Diretora Jurídica. A função principal é estabelecer as regras referentes ao uso da tecnologia da informação e à segurança cibernética e supervisionar seu cumprimento. As reuniões acontecem sempre que necessário e não há registro em ata das discussões e decisões tomadas. Quando necessária, a formalização ocorre por *e-mail*.

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

São treze os diretores: Diretor Presidente, com função de supervisão geral, Diretor de Administração de Carteiras, com função de administração de carteira de valores mobiliários, Diretor Financeiro e de *Compliance*, com função de supervisão das áreas de Controladoria, Administrativa e RH, Tecnologia,

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

Risco e *Compliance*, Diretor de Mercados Emergentes, responsável pelo portfólio mercados emergentes, Diretor de Renda Variável Internacional, responsável pelo portfólio de renda variável internacional, Diretor de Crédito, responsável pelo portfólio de crédito privado, Diretor de Renda Variável, responsável pelo portfólio local de renda variável, Diretor de Renda Variável de Mercados Emergentes, responsável pelo portfólio de renda variável em mercados emergentes, Diretor de Câmbio, responsável pelas operações de câmbio, Diretor de Análise e Pesquisa, responsável por análise e pesquisa nos setores de varejo, consumo, educação, *utilities*, telecomunicações e infraestrutura, Diretor da Área Econômica, responsável pela análise econômica, Diretor Contábil, responsável pelas áreas de contabilidade e *back-office* e Diretora Jurídica, responsável pela área jurídica.

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

-

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:

a. nome

b. idade

c. profissão

d. CPF ou número do passaporte

e. cargo ocupado

f. data da posse

g. prazo do mandato

h. outros cargos ou funções exercidos na empresa

O mandato de todos os diretores tem prazo indeterminado e nenhum deles possui outro cargo nem exerce outra função distinta daquela descrita no item 8.1.

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

Nome	Idade	Profissão	CPF	Cargo	Posse Diretoria	Comitê
Ezra Moise Safra	48	administrador de empresas	091.351.188-90	Diretor Presidente	06/11/2003	- <i>Compliance</i> - Crédito
Guilherme Figueiredo	50	administrador de empresas	013.124.188-50	Diretor Resp. pela Adm. de Carteiras	06/11/2003	- <i>Compliance</i> - Crédito
Edson Maioli	54	contabilista	055.655.518-03	Diretor Financeiro e de <i>Compliance</i>	29/3/2006	- <i>Compliance</i> - Risco - TI e Seg. Cibernética
Diana Gandelman Weiss	40	advogada	016.835.187-05	Diretora Jurídica	08/10/2018	- <i>Compliance</i> - Risco - TI e Seg. Cibernética
Gustavo Bolognesi	35	contabilista	335.436.858-64	Diretor Contábil	01/2/2017	- Risco
Giselle Aparecida Alves Figueiredo	27	economista	390.771.538-10	Analista de Risco	N/A	- Risco
Fabio Rodrigues Lopes Gentile	45	tecnólogo	157.826.028-05	Gerente de Informática	N/A	- Tecnologia da Informação e Segurança Cibernética
Luiz Felipe Afonso Caetano	32	economista	367.707.498-31	Diretor de Crédito	15/7/2019	- Crédito

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

Guilherme Figueiredo (26/Fev/1969)

a. currículo, contendo as seguintes informações:

i. cursos concluídos;

Administração de Empresas (FAAP) / MBA em Finanças (William E. Simon Graduate School of Business Administration).

ii. aprovação em exame de certificação profissional

N/A

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
- datas de entrada e saída do cargo

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

AMS Capital Ltda. - Diretor Responsável pela Administração de Carteiras responsável pelo <i>front-office</i> desde 06/2000.
8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e desta Instrução, fornecer:
Edson Maioli (15/Out/1965)
a. currículo, contendo as seguintes informações:
i. cursos concluídos;
Ciências Contábeis (UNICID-SP) / MBA em Controladoria (FGV)
ii. aprovação em exame de certificação profissional (opcional)
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
• datas de entrada e saída do cargo
AMS Capital Ltda. - Diretor responsável pelo <i>back-office</i> e com função de supervisão das áreas de controladoria, administrativa e RH, tecnologia, risco e <i>compliance</i> desde 08/2004.
8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:
a. currículo, contendo as seguintes informações:
i. cursos concluídos;
ii. aprovação em exame de certificação profissional
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

<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
- Mesmo Diretor do item 8.5 acima.
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:
a. currículo, contendo as seguintes informações:
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
<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
N/A. A AMS Capital não realiza distribuição de cotas de fundos de investimento.
8.8. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:
a. quantidade de profissionais
16 (dezesseis)
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

<p>A área de gestão de Fundos de Investimento da AMS Capital conta com 17 (dezesete) profissionais, entre eles, 1 (um) Diretor Responsável pela Administração de Carteiras, 1 (um) Diretor Presidente, 1 (um) Diretor responsável pela área econômica, 2 (dois) Economistas, 1 (um) <i>Trader</i>, 1 (um) Analista, 7 (sete) Diretores-<i>Portfolio Managers</i>, e 3 (três) secretárias.</p>
<p>c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>
<p>Sistemas/Recursos utilizados na área de gestão de recursos: Bloomberg, Reuters, Broadcast (AE), Valor Econômico, além de consultorias externas especializadas.</p>
<p>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:</p>
<p>a. quantidade de profissionais</p>
<p>16 (dezesseis)</p>
<p>b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes</p>
<p>A área administrativa conta com 3 (três) Diretores, 2 (dois) gerentes, 8 (oito) analistas 1 (um) auxiliar administrativo e 2 (duas) recepcionistas.</p>
<p>c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>
<p>Sistemas/Recursos utilizados na área de verificação e controle de normas legais e regulamentares: - Sistema de Risco: Risk Control (Accenture) e PORT; Sistema de Contabilidade e Controladoria: AIM, Britech, Sistema Administrativo: StarSoft, CVM, Bacen e Anbima.</p>
<p>d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor</p>
<p>Por meio de: segregação das atividades, segregação física da área de gestão, políticas internas, código de ética, controle de acesso aos equipamentos e dados e acompanhamento/monitoramento das atividades pelo Comitê de Compliance.</p>
<p>8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de riscos, incluindo:</p>
<p>a. quantidade de profissionais</p>

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

1 (um) analista de risco
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
Gerenciamento do risco de mercado, liquidez e exposição da carteira dos fundos de investimento.
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
<p>São utilizados três sistemas para controle de risco, Bloomberg, o Accenture/RiskControl (desenvolvidos por terceiros) e um sistema desenvolvido internamente. Estes sistemas foram escolhidos por serem compatíveis com a natureza e a complexidade dos produtos, serviços, atividades, processos e sistemas da instituição, e estão capacitados a auxiliar na identificação, avaliação, monitoramento, controle e a mitigar os riscos associados às atividades da instituição.</p> <p>Os critérios utilizados na gestão de risco de liquidez são aqueles definidos pelas Diretrizes de Liquidez das Carteiras de Fundo de Investimento da ANBIMA e à Deliberação nº 56 de 18 de agosto de 2014 pelo Conselho de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento. Tais critérios incluem (i) volume para aferição de liquidez dos ativos componentes da carteira dos fundos, (ii) o tratamento dos ativos utilizados como margem e garantias, (iii) controle de liquidez mínima da carteira, (iv) a periodicidade de monitoramento e (v) as métricas de gerenciamento da liquidez das carteiras, considerando a adequação à cotação e o perfil do passivo dos fundos.</p> <p>São gerados os seguintes relatórios de risco de mercado diários que contém as seguintes informações: (1) Exposição: apresenta os limites adotados vs. a posição no final de cada dia. (2) Risco: apresenta o VaR consolidado; PV Volatilidade, VaR e VaR marginal. (3) <i>Stress test</i>: apresenta o comportamento das carteiras dos fundos em alguns cenários de stress.</p>
d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor
O setor se reporta ao Comitê de Risco, órgão independente da gestão dos recursos.
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:
a. quantidade de profissionais

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

b. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
c. a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade
8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:
a. quantidade de profissionais
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
c. programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas
d. infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição
e. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
A Empresa não realiza distribuição de cotas. A Distribuição dos fundos geridos pela AMS Capital é realizada pela Intrag DTVM Ltda.
8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
-N/A
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 principais formas de remuneração da AMS Capital são as taxas de administração e performance dos fundos de investimentos geridos e receita financeira do caixa da companhia.

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total auferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente, durante o mesmo período, dos clientes em decorrência de:
-
a. taxas com bases fixas
79%
b. taxas de performance
21%
c. taxas de ingresso
-
d. taxas de saída
-
e. outras taxas
-
9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
Não há.
10. Regras, procedimentos e controles internos
10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços
A seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços para a AMS Capital Ltda. segue o estabelecido na Política de Contratação de Terceiros enviada à ANBIMA e disponível no <i>website</i> www.msafra.com.br .
10.2. Descrever como os custos de transação com valores mobiliários são monitorados e

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

<p>minimizados</p>
<p>O gestor possui sistema próprio para calcular e validar os custos incorridos nas transações realizadas. Para minimizar custos, o processo de seleção de corretoras prioriza além do custo, a idoneidade e as que tem qualidade na execução e liquidação operacional. O acompanhamento destas corretoras é feito através de <i>rankings</i> baseados nos critérios acima, e as com melhor desempenho tem os negócios incrementados.</p>
<p>10.3. Descrever as regras para o tratamento de soft dollar, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens etc.</p>
<p>A Empresa tem por política transferir aos fundos geridos qualquer benefício ou vantagem que possa alcançar em decorrência de sua condição de gestora, salvo se for de outra maneira expressamente determinado pelo regulamento do fundo em questão. As operações de <i>soft dollar</i> somente ocorrerão se aprovadas pelo Comitê de <i>Compliance</i> e se em benefício dos fundos sob gestão, sendo que não haverá favorecimento da parte que oferecer esse tipo de serviço.</p> <p>É vedado aos Colaboradores receber diretamente presentes de prestadores de serviços ou quaisquer terceiros que sejam oferecidos em decorrência das atividades da Empresa. No caso de recebimento de presentes, estes deverão ser entregues à diretoria que o sorteará entre todos os Colaboradores e diretores da Empresa.</p> <p>Da mesma maneira, cursos viagens e afins somente poderão ser aceitos se aprovados pelo Comitê de <i>Compliance</i> e se a viagem for no interesse exclusivo da Empresa para melhor capacitação de seus profissionais.</p>
<p>10.4. Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados</p>
<p>A empresa possui um plano de contingência e continuidade do negócio (“<u>Plano de Contingência</u>”) que permite que não haja interrupção das atividades, protegendo os processos críticos contra efeitos de falhas ou desastres significativos, e assegurando sua retomada em tempo hábil, se for o caso. O Plano de Contingência é revisado e testado anualmente e está devidamente documentado. Além disso, a empresa possui uma rotina de <i>backup</i> e retenção das informações, armazenadas em fitas magnéticas, da seguinte forma: (i) todos os dias úteis durante os últimos 30 dias, (ii) último dia útil de cada mês, gerando um <i>backup</i> mensal, retido por 12 meses, e (iii) último dia útil de cada ano, gerando um <i>backup</i> anual, retido por 5 anos. Além do <i>backup</i> em fita magnética, é realizada a replicação de todas as informações críticas para um <i>site</i> de contingência, incluindo arquivos (em tempo real) e banco de dados. A empresa utiliza dos recursos de <i>cloud computing</i> Microsoft Azure como contingência de sua</p>

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

<p>infraestrutura de tecnologia local. O ambiente hospedado no Microsoft Azure garante a disponibilidade e acessos aos servidores de <i>e-mails</i>, arquivos e bancos de dados, independentemente da localização física de seus usuários ou do funcionamento das instalações próprias da empresa.</p>
<p>10.5. Descrever as políticas, práticas e controles internos para a gestão do risco de liquidez das carteiras de valores mobiliários</p>
<p>A AMS Capital faz um controle rígido para gestão do risco de liquidez, o qual está refletido na Política de Gestão de Risco, cópia da qual está arquivada na ANBIMA e disponível no <i>website</i> www.msafra.com.br.</p>
<p>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</p>
<p>A empresa não realiza distribuição de cotas. A Distribuição dos fundos geridos pela AMS Capital é realizada pela INTRAG DTVM Ltda.</p>
<p>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</p>
<p>www.msafra.com.br</p>
<p>11. Contingências</p>
<p>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:</p>
<p>Não há qualquer processo judicial, administrativo ou arbitral do qual a empresa seja parte, relevante aos negócios da empresa. Há um procedimento administrativo referente a um auto de infração da Receita Federal que representa, no caso de perda, uma despesa de, aproximadamente, 1,53% do faturamento anual da empresa.</p>
<p>a. principais fatos</p>

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

Em 02.10.2008, um auto de infração foi lançado pela Receita Federal que está em discussão em âmbito administrativo.
b. valores, bens ou direitos envolvidos
O valor do auto é de R\$ 583.933,55.
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:
Não há.
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 a empresa tenha figurado no polo passivo, indicando:
Não há.
a. principais fatos
Não há.
b. valores, bens ou direitos envolvidos
Não há.

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

<p>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:</p>
<p>Não há.</p>
<p>a. principais fatos</p>
<p>Não há.</p>
<p>b. valores, bens ou direitos envolvidos</p>
<p>Não há.</p>
<p>12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, informando sobre:</p>
<p>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</p>
<p>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</p>
<p>c. impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa</p>
<p>d. inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito</p>
<p>e. inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado</p>

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de Dezembro de 2019)

f. títulos contra si levados a protesto

Informamos que a referida declaração foi firmada em 31 de Dezembro de 2019 pelo diretores acima identificados e encontra-se disponível na sede da Empresa.