



## 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: 36.556.327/0001-91

Nome do Administrador de Carteira: HELIUS CAPITAL GESTÃO DE RECURSOS SA.

Ano de competência: 2023

## 2. Histórico da empresa

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

A Gestora foi constituída em março de 2020 com o objetivo de desenvolver atividade de gestão profissional de recursos de terceiros. Para tanto, foi autorizada pela CVM a prestar serviços de administração de carteiras de títulos de valores mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 18.029, de 13 de agosto de 2020.

Os sócios fundadores da gestora se conhecem e trabalharam juntos por alguns anos no mercado financeiro, sempre na gestão de carteiras de renda variável.

### 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 2021, com a constituição da HC Partners Holding LTDA, os sócios migraram a participação detida na Sociedade para a Holding. Com isso, o quadro societário da Helius Capital passou a ser composto conforme abaixo.

WILLIAM PINTO PEREIRA LEITE  
HC PARTNERS HOLDING LTDA.

Abaixo, as datas de ingresso e saída dos diretores da empresa.

Em março de 2020, Bernardo Tarquinio Duque Ferri e Eduardo Sampaio Rebouças assumiram como diretores.

Em dezembro de 2020, Jorge Getulio Veiga Neto assumiu o cargo de Diretor de Compliance, Risco e PLD.

Em abril de 2023, com a saída de Jorge Getulio Veiga Neto, João Vitor Paes Giesta assumiu o cargo de Diretor de Compliance, Risco e PLD.

Em novembro de 2023, Bernardo Tarquinio Duque Ferri deixou o cargo de diretor ao sair voluntariamente da empresa.

#### b. Escopo das atividades

Não ocorreram mudanças relevantes nesse sentido, a Helius permanece exercendo somente a atividade de gestão de recursos.

#### c. Recursos humanos e computacionais

A entrada dos novos sócios diretores mencionados acima, a contratação de um profissional para a área administrativa e a contratação de um profissional para a área de Trading

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

Não aplicável.

## 3. Recursos Humanos

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

#### a. Número de sócios:

7

#### b. Número de empregados:



## 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

### c. Número de terceirizados:

0

CPF	Nome
328.883.568-13	WILLIAM PINTO PEREIRA LEITE

## 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
BDO	10/08/2023	Auditoria das Demonstrações Contábeis da gestora

## 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**



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

A Gestora tem como objeto a prestação de serviços de gestão discricionária de carteiras de títulos e valores mobiliários, notadamente de fundos de investimento.

### **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 Gestora faz a gestão de fundos de investimento regulados pela Instrução CVM 555/14.

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

Os fundos de investimento sob gestão têm como foco investimento em ativos de renda variável, podendo investir também ativos de renda fixa, créditos privados e investimentos no exterior.

### **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**

Não aplicável, tendo em vista que a Gestora não desempenha outras atividades.

### **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	7	1533	1540



## 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	0	4	4
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	7		7
xi. Investidores não Residentes	0		0

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Cotistas de distribuidores por conta e ordem	0	1529	1529

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	7	1533	1540

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 69.255.688,61	R\$ 0,00	R\$ 100.113.914,52

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

R\$ 18.465.768,66

**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\$ 15.995.833,00	
R\$ 14.373.272,82	
R\$ 13.971.507,49	
R\$ 12.355.225,93	
R\$ 5.661.188,24	
R\$ 3.685.325,97	
R\$ 3.213.335,12	
R\$ 3.020.354,06	
R\$ 1.398.897,63	
R\$ 1.396.740,47	

### 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\$ 0,00	R\$ 785.295,57	R\$ 785.295,57
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\$ 69.255.688,61		R\$ 69.255.688,61
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
Cotistas de distribuidores do fundo (distribuição por conta	R\$ 0,00	R\$ 30.072.930,34	R\$ 30.072.930,34

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 69.255.688,61	R\$ 0,00	R\$ 100.113.914,52

### 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\$ 64.456.585,36
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\$ 0,00
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\$ 18.465.768,66
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ -4.924.062,12
k. Outros valores mobiliários	R\$ 16.253.449,66
l. Títulos públicos	R\$ 5.862.172,96
m. Outros ativos	R\$ 0,00
Total	R\$ 100.113.914,52

### 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 - A gestora não exerce as atividades de administração fiduciária.

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

Não há outras informações relevantes no entendimento da Gestora.

## 7. Grupo Econômico

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

#### a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
328.883.568-13	William Pinto Pereira Leite
121.327.097-93	Eduardo Sampaio Rebouças
399.147.868-47	Joao Julio Almeida Matos Murca Pereira
127.880.617-22	Joao Vitor Paes Giesta
42.934.344/0001-18	HC Partners LTDA
00.004.775/8791-70	Laura Castanheira Rodrigues da Cunha
409.761.038-42	guilherme Strifezzi Leal
468.309.038-40	Ricardo Bernstein

#### 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

A Gestora está atualmente dividida em 2 diretorias:

- 1) Diretoria de Gestão, Distribuição e Suitability - sob a responsabilidade de William Pinto Pereira Leite, Gestor certificado pela ANBIMA, cuja atribuição será a de realizar a gestão dos fundos de investimento da casa e a distribuição de ativos; e
- 2) Diretoria de Compliance, Risco, PLD - sob a responsabilidade de João Vitor Paes Giesta, cuja atribuição é de guardião das normas e políticas da Gestora, bem como verificar sempre sua aderência à legislação vigente. É dele a atribuição de avaliar as posições de risco da Gestora, bem como políticas de crédito para os fundos que a casa pretenda oferecer;

A Gestora, conta, ainda, com os seguintes Comitês:

- 1) Comitê de Investimentos: responsável pela avaliação e acompanhamento dos investimentos dos portfólios sob gestão, cabendo ao Diretor de Gestão todas as tomadas de decisão.
- 2) Comitê de Compliance e Risco: responsável por (i) Analisar eventuais situações pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD sobre as atividades e rotinas de compliance; (ii) Revisar as metodologias e parâmetros de controle existentes; e (iii) Analisar eventuais casos de infringência das regras descritas nas políticas e manuais internos da Gestora, das regras contidas na regulamentação em vigor, ou de outros eventos relevantes e definir sobre as sanções a serem aplicadas.
- 3) Comitê Executivo: formado pelos Diretores da Gestora, o Comitê Executivo é responsável por tomar as decisões estratégicas da gestora como novas contratações, abertura ou fechamento de novos fundos, entre outras.

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



## 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

Comitê de Investimentos: Composto pelo Diretor de Gestão e pelos integrantes da Equipe de Gestão. Reúne-se semanalmente (se ou quando necessário) e há registro em ata ou e-mail.

Comitê de Compliance e Risco: Composto pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD e por seu analista. Reúne-se mensalmente e há registro em ata ou e-mail.

Comitê de Executivo: Composto pelos Diretores da Gestora. Reúne-se quinzenalmente (se ou quando necessário) e há registro em ata ou e-mail.

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

Diretor de Compliance, Risco e PLD: cumprimento de regras, políticas e procedimentos de controles internos, implementação do programa de prevenção à lavagem de dinheiro, bem como o cumprimento de regras, políticas e procedimentos de gestão de riscos da Gestora.

Diretor de Gestão: Responsável por monitorar os mercados, analisar e acompanhar os investimentos, avaliar as oportunidades de investimento, por definir as estratégias e instrumentos de investimento e pela implantação das decisões.

### 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:

CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos
328.883.568-13	WILLIAM PINTO PEREIRA LEITE	39	Engenheiro	Diretor de Gestão, Distribuição e Suitability	20/02/2020	Indeterminado	
127.880.617-22	JOAO VITOR PAES GIESTA	29	Engenheiro	Diretor de Compliance, Risco e PLD	14/04/2023	Indeterminado	

### 8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, 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

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	328.883.568-13	WILLIAM PINTO PEREIRA LEITE	39	Engenheiro	Diretor de Gestão, Distribuição e Suitability	14/08/2020	Indeterminado		Formado em Engenharia Civil pela USP em 2008.	CGA
8.7 (DISTRIBUIÇÃO DE COTAS)	328.883.568-13	WILLIAM PINTO PEREIRA LEITE	39	Engenheiro	Diretor de Gestão, Distribuição e Suitability	14/08/2020	Indeterminado		Formado em Engenharia Civil pela USP em 2008.	CGA
8.5 (COMPLIANCE)	127.880.617-22	JOAO VITOR PAES GIESTA	29	Engenheiro	Diretor de Compliance, Risco e PLD	19/04/2023	Indeterminado		Formado em Engenharia de Produção pelo IBMEC-RJ em 2018.	PQO
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	127.880.617-22	JOAO VITOR PAES GIESTA	29	Engenheiro	Diretor de Compliance, Risco e PLD	19/04/2023	Indeterminado		Formado em Engenharia de Produção pelo IBMEC-RJ em 2018.	PQO

**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
328.883.568-13	WILLIAM PINTO PEREIRA LEITE	Garde Asset Management	Gestor de portfólio de renda variável para os fundos Garde D'Artagnan (multimercado), Garde Aramis (previdência) e Garde Athos (ações long bias), totalizando um patrimônio de aproximadamente R\$ 5 bilhões. Portfólios geridos usando estratégias direcionais, long & short e arbitragens	Gestor de Recursos	01/04/2018	01/02/2020
328.883.568-13	WILLIAM PINTO PEREIRA LEITE	Credit Suisse (Brasil) S.A. Corretora de Títulos e Valores M	Gestor de portfólio de renda variável de recursos proprietários do banco de aproximadamente US\$ 500 milhões em estratégias direcionais, long & short e arbitragens.	Banco de Investimentos	01/05/2013	01/02/2018



### 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

328.883.568-13	WILLIAM PINTO PEREIRA LEITE	SPX Capital	Analista de renda variável responsável pelos setores de petróleo e gás, mineração e siderurgia, papel e celulose e aviação, assessorando nas decisões de investimentos dos gestores dos fundos SPX Nimitz (multimercado), SPX Raptor (multimercado) e SPX Falcon (ações long bias) com um patrimônio total de aproximadamente R\$ 9 bilhões à época.	Analista de renda variável.	01/02/2011	01/04/2013
328.883.568-13	WILLIAM PINTO PEREIRA LEITE	Credit Suisse Hedging-Griffo - (atual Verde Asset).	Analista de renda variável responsável pelos setores de petróleo e gás, mineração e siderurgia, papel e celulose e aviação, assessorando nas decisões de investimentos dos gestores dos fundos CSHG Verde (multimercado), CSHG Strategy Long & Short (ações long & short) e CSHG Unique (ações long bias) com um patrimônio total de aproximadamente R\$ 15 bilhões à época.	Gestor de Recursos	01/08/2007	02/01/2011
127.880.617-22	JOAO VITOR PAES GIESTA	XP INVESTIMENTOS	Analista Operacional	Analista	07/01/2019	01/10/2020

**8.8 Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, 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. Quantidade de profissionais**

6

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

A equipe de gestão é responsável pela análise, avaliação de investimentos, alocação entre os diferentes ativos e posições dos fundos sob gestão. E ainda, geração de ideias, discussões sobre risco-retorno, implementação e acompanhamento de ideias de investimento de suas carteiras através de leitura de research reports, dados micro e macroeconômicos, além de controles associados à gestão destes investimentos.

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

A equipe de gestão utilizará para controle da composição da carteira, provedores externos de informação, como o Lote45, Bloomberg e planilhas internas para avaliação da rentabilidade dos fundos sob gestão e para o desempenho de suas atividades diárias, além de research de terceiros ("sell side").

Rotinas diárias de controles são executadas através de sistemas desenvolvidos internamente, contendo histórico de operações, posição de investimentos, resultados dos investimentos efetuados, histórico da carteira dos fundos e de seus riscos.

## **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**

2

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

Algumas das atribuições da Área de Compliance, já foram elencadas no item 8.1 (a) acima.

Com relação à fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, tendo em vista a estrutura da Gestora, o processo para monitoramento contínuo do terceiro contratado será conciso e objetivo. Em linhas gerais, o Diretor de Compliance, Risco e PLD, contando com o auxílio do Diretor de Gestão avaliará o desempenho do terceiro versus a expectativa e metas traçadas quando da sua contratação, a relação custo benefício e o grau de segurança empregado nas suas tarefas. Sem prejuízo, em casos específicos, adotará controles mais rigorosos, conforme detalhado na Política de Contratação de Terceiros da Gestora.

Para informações detalhadas, consulte o Manual de Compliance da Gestora e a Política de Contratação de Terceiros.

### **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

As rotinas e os procedimentos envolvidos na atividade de Compliance da Gestora serão controlados por meio do sistema do Lote 45 e controles proprietários.

Rotina e Procedimentos: Todas as rotinas e procedimentos do Compliance constam expressamente do Manual de Compliance, dentre eles:

- (i) Realização da ampla divulgação e aplicação dos preceitos éticos no desenvolvimento das atividades de todos os colaboradores da Gestora, inclusive por meio dos treinamentos;
- (ii) Adoção de programa de reciclagem para os colaboradores, que será executado, no mínimo, anualmente ou à medida que as regras e conceitos contidos no Manual de Compliance sejam atualizados, com o objetivo de fazer com que os mesmos estejam sempre atualizados, estando todos obrigados a participar de tais programas.
- (iii) Monitoramento sobre uma amostragem significativa dos colaboradores, escolhida aleatoriamente pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD, para que sejam verificados os arquivos eletrônicos, inclusive e-mails, com o objetivo de verificar possíveis situações de descumprimento às regras contidas no Manual de Compliance e demais políticas internas. Verificação periódica, pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD, dos níveis de controles internos e compliance junto a todas as áreas da Gestora, com o objetivo de promover ações para esclarecer e regularizar eventuais desconformidades.

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

O Diretor de Compliance, Risco e PLD possui completa autonomia e independência das outras áreas da Gestora para desempenho de suas atividades.

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

### **a. Quantidade de profissionais \***

2

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

As atividades desenvolvidas pela Área de Compliance, Risco e PLD constam expressamente da Política de Gestão de Risco, e tem por estabelecer a metodologia, os critérios e os parâmetros aplicados para monitorar a exposição aos fatores de risco inerentes aos investimentos realizados pela Gestora, analisando, desta forma, as informações diárias dos fundos de investimento sob sua gestão, seus limites e volatilidade dos ativos em relação à exposição aos mercados, considerando a relação dos mesmos com os cenários apresentados. A Gestora busca também identificar os potenciais eventos que possam vir a afetar seus resultados, bem como os resultados da carteira dos fundos sob sua gestão. Para informações detalhadas, consulte a Política de Gestão de Risco da Gestora.

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

Sistemas: A Gestora possui sistemas terceirizados, como o Lote 45, assim como ferramentas e planilhas desenvolvidas internamente que apoiam o controle de risco. Ainda vale destacar que cada veículo sob gestão pode possuir estratégias de investimento e monitoramento de risco particulares.

A Área de Compliance e Risco realiza um monitoramento diário, após o fechamento dos mercados de cada dia, em relação aos principais riscos relacionados aos Fundos, utilizando-se principalmente do controle de Value-at-Risk (VaR) e Stress Test.

Com o auxílio de sistemas de terceiros contratados, especialmente o Lote45, e também com o auxílio dos sistemas e modelos proprietários criado pela Gestora de acompanhamento de mercado e ativos financeiros, e amplo acesso a relatórios de análise publicados por diversas instituições financeiras e sob supervisão do Diretor de Compliance, Risco e PLD, são gerados relatórios diários de exposição a riscos para cada Fundo, o qual refletirá, também, os enquadramentos constantes dos regulamentos dos fundos de investimento.

Face ao perfil dos investimentos alvo da Gestora, o processo de avaliação e gerenciamento de riscos permeia todo o processo de decisão de investimento e segue os parâmetros estipulados na Política de Gestão de Risco da Gestora.



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

A área de Gerenciamento de Risco, liderada pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD, possui total autonomia no exercício de suas atividades.

### **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**

A Gestora não exerce atividades de tesouraria, de controle e de processamento de ativos e da escrituração de cotas.

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

A Gestora não exerce atividades de tesouraria, de controle e de 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**

A empresa não realiza atividades de distribuição.

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

A empresa não realiza atividades de distribuição.

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

A empresa não realiza atividades de distribuição.

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

A empresa não realiza atividades de distribuição.

### **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 Gestora pode receber, pela gestão dos fundos de investimento, conforme o caso, uma taxa de administração de até 3% ao ano, aplicável sobre o valor do patrimônio líquido do respectivo fundo e, eventualmente, uma taxa de performance de até 20%, incidente sobre a rentabilidade do Fundo, todas calculadas em cima do Patrimônio Líquido do Fundo, à razão 1/252.

### **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:**



## 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. Taxa com bases fixas (%):**

80,00

**b. Taxa de performance (%):**

20,00

**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:**

N/A - Não há outras informações relevantes no entendimento da Gestora.

## 10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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

A seleção e contratação de Terceiros é um processo conduzido de forma conjunta pelo Diretor de Investimentos, conforme definido no Formulário de Referência da Gestora responsável pela seleção e indicação dos potenciais contratados, e pelo Diretor de Compliance e PLD da Gestora, conforme definido no Formulário de Referência da Gestora, responsável pela condução do processo de due diligence prévio à contratação.

Referido processo de due diligence visa obter informações qualitativas sobre o Terceiro que tenha interesse em iniciar vínculo jurídico com a Gestora e com os Fundos de Investimento geridos, de modo a permitir um melhor julgamento durante a pré-seleção. A avaliação de tais informações será feita mediante a apresentação do questionário Anbima de due diligence, na forma e conteúdo aprovados pelo autorregulador.

Em todos os casos, o Diretor de Compliance e PLD exigirá, no que couber, a documentação comprobatória das informações prestadas. Caso não seja possível aferir a veracidade da informação por meio de documentos comprobatórios, o Diretor de Compliance e PLD envidará melhores informações para conferir tais informações.

Para maiores informações, consultar a Política de Contratação Terceiros.

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



## 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 Gestora possui o dever fiduciário de agir com a finalidade de conseguir, nas circunstâncias de mercado, preços e condições de execução mais favoráveis para os Fundos e outros veículos geridos (best execution). Assim, a Gestora tem o dever de cultivar a transparência em relação a potenciais conflitos de interesse, práticas de remuneração, benefícios indiretos e outros fatores que possam interferir na escolha do prestador de serviço.

A equipe de Gestão deve trabalhar apenas com uma lista pré-definida e aprovada pelo Compliance de corretoras, que deverá levar em consideração, dentre outros, os seguintes critérios: (i) preços; (ii) custos; (iii) velocidade de execução; (iv) qualidade ou probabilidade de execução e liquidação; e (v) tamanho.

A Gestora tem o dever de evitar situações de conflito de interesses e negociações paralelas sem o necessário disclosure e consentimento junto ao interessado.

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

Em termos gerais, Soft Dollar pode ser definido como sendo o benefício econômico, de natureza não pecuniária, eventualmente concedido à Gestora por corretoras de títulos e valores mobiliários ou outros fornecedores ("Fornecedores"), em contraprestação ao direcionamento de transações dos fundos de investimento geridos pela Gestora, para fins de auxílio no processo de tomada de decisões de investimento em relação aos respectivos fundos.

Tais benefícios não devem apresentar caráter pecuniário e devem ser utilizados pelos representantes da Gestora exclusivamente em benefício dos clientes, como ferramentas de auxílio da avaliação, seleção e decisão de investimento e suporte à gestão dos fundos de investimento geridos pela Gestora.

A Gestora não deverá selecionar seus Fornecedores considerando somente os benefícios recebidos por meio de acordos de Soft Dollar, mas deverá levar em consideração, primordialmente, a eficiência, produtividade ou menores custos oferecidos por tais Fornecedores.

A Gestora, por meio de seus representantes, deverá observar os seguintes princípios e regras de conduta ao firmar acordos de Soft Dollar:

- (i) Colocar os interesses dos clientes acima de seus próprios interesses;
- (ii) Definir de boa-fé se os valores pagos pelos clientes e, conseqüentemente, repassados aos Fornecedores, são razoáveis em relação aos serviços de execução de ordens ou outros benefícios que esteja recebendo;
- (iii) Ter a certeza de que o benefício recebido auxiliará diretamente no processo de tomada de decisões de investimento em relação ao veículo que gerou tal benefício, devendo alocar os custos do serviço recebido de acordo com seu uso, se o benefício apresentar natureza mista;
- (iv) Divulgar amplamente a clientes, potenciais clientes e ao mercado os critérios e políticas adotadas com relação às práticas de Soft Dollar, bem como os potenciais conflitos de interesses oriundos da adoção de tais práticas;
- (v) Cumprir com seu dever de lealdade, transparência e fidedignidade com os clientes; e
- (vi) Transferir à carteira dos clientes qualquer benefício ou vantagem que possa alcançar em decorrência de sua condição de gestora de carteira de valores mobiliários.

Os acordos de Soft Dollar devem ser transparentes e mantidos por documento escrito. A Gestora deverá manter registros dos benefícios recebidos, identificando, se possível, a capacidade de contribuir diretamente para o processo de tomada de decisões de investimento, visando comprovar o racional que levou a firmar tais acordos de Soft Dollar.

### **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](http://www.cvm.gov.br)

A Gestora estabeleceu em seu plano de contingência alguns cenários de crise e seus possíveis desdobramentos, a saber:

1. Perda de Acesso ao Prédio: significa que todos os colaboradores e contratados da Gestora que estiverem no prédio no momento do incidente deverão evacuá-lo e quem estiver fora não poderá entrar.
2. Perda de Pessoal: afeta o staff e prestadores de serviços da Gestora. Inclui ferimentos, doenças, morte e incapacidade de chegar no escritório (ou potencialmente trabalhar de casa).
3. Perda de Infraestrutura de TI: inclui falha parcial ou completa da rede de TI, incluindo hardware e softwares essenciais. O fator-chave é envolver os prestadores de serviços assim que possível para instaurar os sistemas de back-up.
4. Perda de Infraestrutura de Telecom: inclui falha parcial ou completa da rede de telecomunicações, incluindo equipamentos, telefones fixos, celulares e a internet).
5. Perda de Energia Elétrica: Falta de energia devido a apagões ou interrupção da rede elétrica devido a chuvas e/ou quedas de árvores.

Uma vez que o líder do plano de continuidade foi acionado devido a uma potencial crise, caso seja possível ele convocará (pessoalmente ou via call-tree) os colaboradores-chave da Gestora para formar o comitê de crise e avaliar conjuntamente a situação e próximos passos.

O processo de gestão de crise da Gestora está estruturado de acordo com as seguintes etapas: Etapa Inicial, Recuperação de Desastre, Telecom, Comunicação Externa,

Em caso de eventos de crise, a Gestora possui contingências e redundâncias de forma a permitir a continuação de suas atividades mesmo em condições adversas.

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

O controle da liquidez dos ativos inseridos nas carteiras dos veículos sob gestão da Gestora é realizado, através da elaboração interna de planilhas Excel e do uso de sistemas, com base na média do volume de negociação diária e comparado com o tamanho total dos ativos individuais. De acordo com suas características, os veículos devem operar com montante suficiente da posição diária em caixa ou ativos extremamente líquidos.

O tratamento dos ativos utilizados como margem, ajustes e garantias considera, no mínimo, os seguintes aspectos: liquidez dos ativos, participação de cada ativo nos veículos e expectativa da Gestora em relação à manutenção dos ativos em carteira.

Será estabelecido um limite máximo de resgate esperado para cada veículo. O percentual do patrimônio líquido de cada veículo que pode ser liquidado até a respectiva data de cotização, com base no número de dias necessários para a liquidação de cada posição, deve ser sempre superior a esse limite.

Para maiores informações, consultar a Política de Gestão de Risco da Gestora.

### **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**

Os Colaboradores da Gestora que atuem, direta ou indiretamente, conforme o caso, na distribuição de cotas dos fundos: (i) deverão cadastrar os Clientes previamente à primeira aplicação, com base nas informações, regras e procedimentos contidos na Política de PLDFT e Cadastro da Gestora; (ii) serão responsáveis pela coleta de informações dos Clientes e obtenção do Questionário de Suitability devidamente preenchido, para fins de elaboração de relatório sobre cada Cliente e definição do perfil de risco respectivo, nos termos da Política de Suitability da Gestora; e (iii) receberão treinamento específico para o desempenho das atividades listadas acima, nos termos do Manual de Distribuição e dos referidos na Política de Procedimentos e Controles Internos e Política de Suitability da Gestora.

### **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.heliuscapital.com.br](http://www.heliuscapital.com.br)

## **11. Contingências**



## 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

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 \***

N/A, não existe nenhuma contingência relevante para ser informada.

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

N/A, não existe nenhuma contingência relevante para ser informada.

**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**

N/A

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

N/A

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

N/A

**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**

N/A

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

N/A

**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**

N/A

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

N/A



## 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

### 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**

**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**

Marcado

**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**

Marcado

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

**Nada a declarar**

Marcado

**Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito**

**Nada a declarar**

Marcado

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

**Nada a declarar**

Marcado

**Títulos contra si levados a protesto**



**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](http://www.cvm.gov.br)

**Nada a declarar**

Mercado

Data de envio: 23/04/2024 - 19:44:00

Data de impressão: 23/04/2024

Hora de impressão: 19:46:14