



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: 14.407.553/0001-78

Nome do Administrador de Carteira: MAGNETIS GESTORA DE RECURSOS LTDA

Ano de competência: 2022

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A Magnetis Gestora de Recursos Ltda. (Magnetis) foi constituída em 29 de agosto de 2011 e obteve junto à CVM, em 11 de junho de 2014, o credenciamento para o exercício de atividade de consultoria de investimentos, nos termos do Ato Declaratório no 13.705.

Em março de 2015, a Magnetis passou a oferecer o serviço de consultoria de investimentos por meio de sua plataforma online.

Em 13 de janeiro de 2017, a Magnetis obteve junto à CVM o credenciamento para o exercício de atividade de administração de carteira de valores mobiliários, nos termos do Ato Declaratório 15.463.

O sócio fundador da Magnetis, Luciano Tavares, é gestor de investimentos com mais de 20 anos de experiência no mercado financeiro. Ao longo de sua carreira, fundou a gestora Nest Investimentos e foi vice-presidente da Merrill Lynch no Brasil.

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 24 de julho de 2015, o Sr. Luciano Mascarenhas Tavares transfere suas cotas para a Braavos Financial Solutions Ltd., possibilitando o aporte de capital por parte de fundos renomados como monashees+, Redpoint e ventures e 500 Startups. Em 2022, a Julius Baer Family Office exerceu o direito de aquisição de participação minoritária na Holding da Magnetis.

b. Escopo das atividades

Em 2016, o Contrato Social da Magnetis foi alterado para prever em seu objeto o serviço de administração de títulos e valores mobiliários, exclusivamente na categoria "gestor de recursos".

c. Recursos humanos e computacionais

Em 2018, houveram as substituições dos Diretores responsáveis pela Gestão de recursos de terceiros e também do Diretor responsável por Risco e Compliance. E em 2022, houve a substituição do Diretor responsável pela área de Tecnologia, conforme item 8.1.(c) deste formulário.

d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos

As regras, políticas, e controles internos foram adaptados para cumprir com a Resolução CVM nº 21/21. As principais políticas e regras estão disponíveis no site da Magnetis.

3. Recursos Humanos

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

a. Número de sócios:

2

b. Número de empregados:

53



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

c. Número de terceirizados:

0

CPF	Nome
169.872.728-32	LUCIANO MASCARENHAS TAVARES
117.707.607-17	MARCELO TOEWS ROMERO SILVA

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 Magnetis tem como principal atividade a gestão discricionária de títulos e valores mobiliários.



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.)

Carteiras administradas e fundos de investimento.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Carteiras administradas e fundos de investimento.

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 Magnetis atuava na consultoria de valores mobiliários, nos termos da regulamentação aplicável, assim como realiza investimentos próprios. Cabe esclarecer que a atividade de consultoria foi descontinuada. Sendo assim, não há conflito de interesse.

Quanto às Carteiras Administradas, elas são compostas de nossos fundos que são Fundos de Fundos, na busca por maior eficiência e os mesmos se mantêm com os menores custos possíveis e quaisquer benefícios são revertidos para os cotistas dos fundos em questão.

A distribuição dos fundos próprios, via Magnetis DTVM, é somente meio para a gestão das carteiras. Não há cobrança pelo uso da Magnetis DTVM. Assim, não há conflito de interesse.

Lembramos que a atuação da Magnetis sempre será pautada pela relação de fidúcia e lealdade aos seus clientes, motivo pelo qual irá sempre alertar, previamente, sobre potenciais conflitos de interesses que venham eventualmente a ser verificados caso a caso.

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

As sociedades controladoras tem como atividade a participação societária em empresas de tecnologia. Não observamos conflitos de interesses.

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	229	4561	4790



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	229	4561	4790
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	0	0	0
iii. Instituições Financeiras	0		0
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0		0
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	0		0
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	0	0	0
vii. Seguradoras	0		0
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	0		0
ix. Clubes de Investimento	0	0	0
x. Fundos de Investimento	0		0
xi. Investidores não Residentes	0		0

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

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	229	4561	4790

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 102.987.578,00	R\$ 0,00	R\$ 871.135.914,50

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

R\$ 0,00

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\$ 30.713.171,44	
R\$ 24.501.872,82	
R\$ 24.181.904,85	
R\$ 21.914.704,16	
R\$ 14.256.433,09	
R\$ 11.790.239,34	
R\$ 11.372.522,49	
R\$ 10.576.320,74	
R\$ 10.047.410,60	
R\$ 9.966.206,77	

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\$ 102.987.578,00	R\$ 768.148.336,50	R\$ 871.135.914,50
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
iii. Instituições Financeiras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
vii. Seguradoras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	R\$ 0,00		R\$ 0,00
ix. Clubes de Investimento	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
x. Fundos de Investimento	R\$ 0,00		R\$ 0,00
xi. Investidores não Residentes	R\$ 0,00		R\$ 0,00

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

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 102.987.578,00	R\$ 0,00	R\$ 871.135.914,50

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

a. Ações	R\$ 0,00
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R\$ 0,00
c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R\$ 12.667.387,00
d. Cotas de fundos de investimento em ações	R\$ 176.042.063,00
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\$ 17.429.956,00
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 404.218.307,00
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 260.778.201,50
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 0,00
k. Outros valores mobiliários	R\$ 0,00
l. Títulos públicos	R\$ 0,00
m. Outros ativos	R\$ 0,00
Total	R\$ 871.135.914,50

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

A Magnetis não exerce atividade de administração fiduciária.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

N/A

7. Grupo Econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
22.821.217/0001-03	BRAAVOS FINANCIAL SOLUTIONS LLC
169.872.728-32	LUCIANO MASCARENHAS TAVARES
22.821.218/0001-40	BRAAVOS FINANCIAL SOLUTIONS LTD

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

e. 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

Departamentos:

Gestão - Responsável por analisar as carteiras, bem como os instrumentos financeiros disponíveis no mercado, e elaborar e executar as estratégias de investimento;

Inteligência de Dados - Responsável por auxiliar a equipe de gestão de carteiras, realizando a análise de dados, programação e desenvolvimentos de algoritmos de análise de ativos que serão imputados no sistema proprietário da Magnetis.

Riscos - Responsável por monitorar as carteiras e suas exposições aos diferentes fatores de risco, de acordo com as diretrizes estabelecidas;

Compliance - Responsável por monitorar as atividades da Sociedade e sua aderência aos padrões operacionais e de conduta legais e regulamentares.

Comitê:

Comitê de Investimentos - Avalia os cenários econômicos local e internacional; Impactos sobre os instrumentos utilizados para alocação das carteiras; Definição das estratégias de alocação para os perfis estabelecidos para cada carteira e os critérios quantitativos do sistema de gestão.

Comitê de Riscos - Avalia a exposição aos riscos das carteiras e fundos Magnetis, bem como controle de desenquadramentos e inclusão de novos produtos.

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

Comitê de Investimentos:

Composição: Diretor de Gestão e Analista de Dados;

Frequência: Mensal

Registro: Ata

Comitê de Riscos:

Composição: Diretor de Gestão, Diretor de Risco, Gerente de Portfólio e Analista de Risco;

Frequência: Esporádico

Registro: Ata/Histórico de e-mail

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



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

- Diretor Presidente: Luciano Mascarenhas Tavares - Responsável por administrar, orientar e dirigir os negócios da Sociedade. Tem ainda a responsabilidade perante a CVM pelo exercício da atividade de Suitability, nos termos da Resolução CVM nº 30/21, conforme alterada;

- Diretor de Risco, Compliance e Operações: Eduardo Jun Nonaka - Responsável perante à CVM pelo (i) cumprimento das regras, políticas, procedimentos e controles internos da Sociedade; (ii) pela gestão de risco, nos termos da Resolução CVM nº 21/21, ou norma que venha a aditá-la ou substituí-la; (iii) pela política de prevenção à "lavagem" de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores da Sociedade, nos termos da legislação vigente, especialmente a Resolução CVM nº 50/21, conforme alterada e (iv) por coordenar, administrar, dirigir e supervisionar as operações da Sociedade;

- Diretor Comercial: Vinicius Takano Maeda - Responsável por dirigir e orientar as atividades de prospecção e captação de negócios e clientes; estabelecer e supervisionar o relacionamento da Sociedade com os clientes efetivos e potenciais. Tem ainda a responsabilidade perante a CVM pelas atividades de consultoria de valores mobiliários, nos termos da Resolução CVM nº 19/21;

- Diretor de Investimentos: Marcelo Toews Romero Silva - Responsável por dirigir e orientar a elaboração de estratégias negociais a partir dos diagnósticos analíticos decorrentes da análise de dados e administração de carteiras de títulos e valores mobiliários, para os fins da Resolução CVM nº 21/21;

- Diretor de Produtos e Tecnologia: Pablo Daniel Garateguy Chelle - Responsável por dirigir e orientar as atividades de desenvolvimento de sistemas de software da Sociedade, incluindo a gestão e administração da rede de computadores e supervisão da manutenção dos programas e sistemas implantados; Desenvolver a equipe de produtos, definindo funções e responsabilidades, assim como, definir a estratégia de produto alinhada com os objetivos da empresa.

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
163.098.338-12	Eduardo Jun Nonaka	51	Engenheiro Civil	Diretor de Risco e Compliance	13/12/2018	Indeterminado	
169.872.728-32	Luciano Mascarenhas Tavares	48	Administrador de Empresas	Diretor Presidente	30/06/2016	Indeterminado	
117.707.607-17	Marcelo Toews Romero Silva	36	Economista	Diretor de Investimentos	13/12/2018	Indeterminado	Membro do Comitê de Investimentos
998.298.861-15	Vinicius Takano Maeda	36	Administrador de Empresas	Diretor Comercial	30/06/2016	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)	117.707.607-17	Marcelo Toews Romero Silva	36	Economista	Diretor de Investimentos	13/12/2018	Indeterminado	Membro do Comitê de Investimentos	Programa de Qualificação Operacional (PQO) - B3	Certificação de Gestores ANBIMA (CGA), Certificado em Quantitative Finance (COF)
8.5 (COMPLIANCE)	163.098.338-12	Eduardo Jun Nonaka	51	Engenheiro Civil	Diretor de Compliance	13/12/2018	Indeterminado		Programa de Qualificação Operacional (PQO) - B3, Curso de Compliance - INSPER Educação Executiva (2017)	Certified Anti Money Laundering Specialist (CAMS) Certificação ao PQO Risco e Compliance
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	163.098.338-12	Eduardo Jun Nonaka	51	Engenheiro Civil	Diretor de Risco	13/12/2018	Indeterminado		Programa de Qualificação Operacional (PQO) - B3, Curso de Compliance - INSPER Educação Executiva (2017)	Certified Anti Money Laundering Specialist (CAMS) Certificação ao PQO Risco e Compliance

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
163.098.338-12	Eduardo Jun Nonaka	CM Capital Markets CCTVM Ltda	Diretor Administrativo e Financeiro	Liderança da implantação da área de compliance, supervisão dos riscos operacionais, atendimento a auditorias externas, gerenciamento dos departamentos de TI, Back office, Jurídico, Contabilidade entre outros.	01/09/2003	01/06/2016
163.098.338-12	Eduardo Jun Nonaka	CM Capital Markets DTVM Ltda.	Presidente	Liderança da reestruturação do modelo de negócios da Administradora Fiduciária, montagem da equipe, gerenciamento dos esforços comerciais, estabelecimento de parcerias com custodiantes e controladores externos, estabelecimento das melhores práticas e legais de Compliance e controles internos.	01/06/2016	21/04/2017
117.707.607-17	Marcelo Toews Romero Silva	Magnetis Investimentos	Diretor de Inteligência de Dados	Responsável por dirigir e orientar a elaboração de estratégias negociais a partir dos diagnósticos analíticos decorrentes da análise de dados.	21/08/2017	13/12/2018



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

117.707.607-17	Marcelo Toews Romero Silva	Magnetis Investimentos	Diretor de Investimentos	Responsável pela administração de carteiras de títulos e valores mobiliários, para os fins da Instrução CVM nº 558.	13/12/2018	
117.707.607-17	Marcelo Toews Romero Silva	Álamos Gestão de Recursos	Sócio / Trader de Derivativos	Responsável pela análise e execução de operações de renda variável envolvendo derivativos.	31/05/2013	28/04/2017

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

a. Quantidade de profissionais

3

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A equipe de gestão recursos é responsável pela gestão das carteiras administradas e desenvolvimento de análises técnicas e quantitativas.

O Diretor de Investimentos é responsável por analisar as carteiras, bem como os instrumentos financeiros disponíveis no mercado, e elaborar e executar as estratégias de investimento e por desenvolver análises técnicas e quantitativas, bem como orientar a elaboração de estratégias negociais a partir dos diagnósticos decorrentes da análise de dados fornecidas pelo sistema, conforme descrito no item "c" abaixo.

2 analistas quantitativos - Analista Quantitativo é responsável por coletar dados de mercado e elaborar análises quantitativas e relatórios de acompanhamento e contribuir com as análises das carteiras, bem como dos instrumentos financeiros disponíveis no mercado, e auxilia o Diretor de Gestão e o Gerente de Portfolio na elaboração e execução das estratégias de investimento.

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

As estratégias de investimento são executadas, na sua maioria, através de sistema proprietário da Magnetis, com integração de dados de fornecidos publicamente pela CVM, ANBIMA e B3.

Os sistemas desenvolvidos pela Magnetis são responsáveis por analisar os diversos perfis de risco e realizar a seleção de ativos baseados em metodologias consagradas de otimização de carteiras. Os sistemas ainda monitoram todas as carteiras em tempo real, verificando enquadramento à estratégia e aos limites de risco.

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



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 principal função do Diretor de Compliance é o suporte a todas as áreas da Magnetis no que concerne a esclarecimentos de todos os controles e regulamentos internos (Compliance), bem como no acompanhamento de conformidade das operações e atividades da Magnetis com as normas regulamentares (internas e externas) em vigor, definindo os planos de ação, monitorando o cumprimento de prazos e do nível de excelência dos trabalhos efetuados e assegurando que quaisquer desvios identificados possam ser prontamente corrigidos (enforcement).

O analista de controles internos é responsável pela elaboração e revisão das políticas e procedimentos internos, elaboração de documentos periódicos para atendimento as exigências normativas, pela definição de procedimentos de monitoramento e controles, atendimento as diversas áreas da empresa e acompanhamento de planos de ação para atender as exigências normativas e corrigir possíveis gaps.

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

A área de administração de recursos de terceiros da Magnetis é completamente segregada das demais áreas, tanto física quanto eletronicamente (usuários individualizados).

Cada colaborador possui notebook e sistema de comunicação escrita e por voz monitorado 100% do tempo, de modo a evitar o compartilhamento do mesmo equipamento e/ou a visualização de informações de outro Colaborador.

Como procedimentos básicos, podemos apontar as consultas diárias aos sistemas dos órgãos reguladores, acompanhamento diário das carteiras com o uso dos sistemas de risco de carteiras (RiskHub Cyrnel), mapeamento dos processos internos e melhorias contínuas.

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

A área de controles internos atua de forma independente, sem qualquer ingerência ou subordinação por parte da área de gestão de recursos, principalmente em função da estrutura segregada e dos princípios éticos da Magnetis.

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

O Diretor de Risco deve tomar as providências necessárias para ajustar a exposição a risco das carteiras administradas pela Magnetis, com base nos limites previstos na Política de Gestão de Risco.

O Analista de Risco é responsável pela execução dos procedimentos internos e regulatórios para controle da exposição aos riscos das carteiras administradas.

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

O departamento de Risco realiza o monitoramento das carteiras através de sistemas desenvolvidos pela própria Magnetis e principalmente o Sistema de risco Cynrel Atlas magnetis.com.br Market Risk e Atlas Liquid Risk provido pela empresa Britech.

Atlas/MARKET RISK: tem como objetivo a gestão de risco de mercado dos portfólios de investimento, incluindo, mas não se limitando a:

- VaR Paramétrico, usando forward looking risk analytics, considerando todas as posições do portfólio;
- VaR Monte Carlo, VaR Simulação Histórica, Componente VaR, Expected Shortfall, Tracking Error, Contribuição marginal ao risco;
- Cálculo de Duration e Convexidade de Títulos de Renda Fixa;
- Cenários de estresse BMF, cenários customizados pelo usuário, análises de sensibilidade;
- Decomposição por setor, classes de ativo, tipo de instrumento, estratégias ou classes customizadas;
- Explosão automática em ativos e decomposição do risco consolidado de fundo de fundos;
- Compliance e gestão de regras de enquadramento.

Atlas/LIQUID RISK: destinado para o cômputo de métricas de liquidez, concentração e estresse de fundos de investimento sem a explosão de cotas de fundos, que aplica em ativos domésticos, incluindo:

- Risco de Liquidez para instrumentos de crédito privado, títulos públicos, renda variável, futuros e cotas de fundos ANBIMA;
- Fator de Dispersão / Concentração de Cotistas;
- Análise de concentração por emissor e produto;
- Customização dos parâmetros de liquidez;
- Upload do histórico do passivo;
- Análise de todos os vértices solicitados pela ANBIMA;

Os ativos das carteiras administradas que estão expostos a risco de crédito são compostos exclusivamente de títulos públicos, ou títulos de emissores privados que contam com a cobertura do Fundo Garantidor de Crédito ("FGC"), tais como Certificado de Depósito Bancário (CDB), Letras de Crédito do Agronegócio (LCA), Letras de Crédito Imobiliário (LCI) e Letras de Câmbio (LC). Ressaltamos que as carteiras administradas são compostas estritamente por ativos de alta liquidez, tais como títulos públicos e fundos de índice listados em bolsa ("ETF"), ou de títulos privados com data de vencimento fixa. Não é permitida a aquisição de títulos privados com data de vencimento superior ao prazo máximo estabelecido pelo investidor na contratação dos serviços. O risco operacional é tratado através de procedimentos frequentes de validação dos diferentes sistemas tais como: programas computacionais, sistema de telefonia, internet, entre outros.

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

A área de Gestão de Riscos atua de forma independente, sem qualquer ingerência ou subordinação por parte da área de Gestão de Recursos, principalmente em função da estrutura segregada e dos princípios éticos da Magnetis.

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 Magnetis não irá exercer a atividade de tesouraria, controle e processamento de ativos e escrituração de cotas.

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

N/A

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

0

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

N/A

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

N/A

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

N/A

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

N/A

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

A distribuição não é realizada pela Magnetis Gestora e sim por distribuidores externos, incluindo mas não se limitando à Magnetis DTVM.

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:

Em 2022 a remuneração da Magnetis foi exclusivamente proveniente da cobrança de taxa de administração com base fixa.

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:



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

Não há.

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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

Os prestadores de serviço como os administradores, custodiantes e controladores dos fundos são escolhidos mediante critérios de qualidade, preço e reputação. São feitas diversas cotações e aquelas que se destacam são escolhidas de forma colegiada pelos diretores diretamente envolvidos, que deverão monitorar e avaliar constantemente a prestação dos serviços.

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

Uma vez que, na Magnetis a gestão das carteiras e fundos buscam essencialmente ter uma exposição "passiva" aos principais índices de mercado, a minimização dos custos de transação é um aspecto fundamental dentro do nosso modelo de gestão. Atualmente, para execução de ordens de renda variável utilizamos as corretoras Credit Suisse, BTG Pactual e Nova Futura.

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

A Magnetis não possui acordos de soft dollar. Eventuais acordos envolvendo soft dollars devem ser previamente aprovados pelo Diretor de Risco e Compliance e, somente poderão ser aceitos pelo Diretor de Risco e Compliance se quaisquer benefícios oferecidos (i) possam ser utilizados diretamente para melhorias da tomada de decisão de investimento pela Magnetis; (ii) ser razoável em relação ao valor das comissões pagas; e (iii) não afetar a independência da Magnetis.

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

Plano de Continuidade de Negócios ("PCN") é ativado pelo Diretor de Risco e Compliance sempre verificar que algum dos recursos essenciais para o funcionamento da empresa esteja interrompido. O Diretor de Risco e Compliance irá (i) comunicar todos os Diretores sobre o nível de complexidade do motivo da interrupção (crises econômicas, falhas operacionais e/ou desastres naturais); (ii) direcionar as equipes para os locais definidos, dependendo da gravidade da interrupção; e (iii) garantir que os sistemas e as rotinas que sejam restabelecidas no menor tempo possível.

A Magnetis possui estrutura tecnológica (servidor de dados em nuvem, backups, telefonia e sistema de gestão) preparada para se restabelecer em curto espaço de tempo, a partir de qualquer ponto onde o colaborador tenha acesso à internet, desde que o mesmo seja previamente aprovado pelo Diretor de Risco e Compliance.

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

As carteiras administradas pela Magnetis são compostas exclusivamente por ativos de alta liquidez, tais como títulos públicos, fundos de investimento organizados sob a forma de condomínios abertos, fundos de índice listados em bolsa ("ETF"), ou de títulos privados com data de vencimento fixa. Não é permitida a aquisição de títulos privados com data de vencimento superior ao prazo máximo estabelecido pelo investidor na contratação dos serviços. Dessa forma, consideramos que o risco de liquidez das carteiras é reduzido, na medida em que são compostas por ativos de alta liquidez ou com liquidez em data pré-estabelecida e inferior ao prazo máximo de resgate de cada carteira.

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 Magnetis possui Manual Interno de Custódia, Política de Cadastro, Política de Compliance, Política de PLDCFT e Anticorrupção, e Política de Risco.

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

<https://magnetis.com.br>



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

11. Contingências

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

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

a. Principais fatos *

Não sabemos da existência de processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a Magnetis figure no polo passivo, que sejam relevantes para os negócios da Magnetis.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

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

a. Principais fatos

Não sabemos da existência de 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.

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 no últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que tenha figurado no polo passivo, indicando:

a. Principais fatos

Não sabemos da existência de condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 cinco anos em processos que não estejam sob sigilo, em que a Magnetis tenha figurado no polo passivo.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

11.5. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo e tenha afetado seus negócios ou sua reputação profissional, indicando:

a. Principais fatos



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

Não sabemos da existência de 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.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

12. Declarações

Declaração do administrador, atestando:

Que reviu o formulário de referência

Marcado

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

Marcado

Declarações adicionais do administrador, informando sobre

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



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

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: 31/03/2023 - 21:09:00

Data de impressão: 26/05/2023

Hora de impressão: 12:36:16