Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 15.388.425/0001-97
Nome do Administrador de Carteira: NOVUS CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.
Ano de competência: 2023

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A Novus Capital foi fundada inicialmente em abril de 2012 sob o nome Flag Asset, com o objetivo de oferecer produtos alternativos de investimento que adicionassem valor de forma consistente no longo prazo para os seus clientes. A empresa possui uma equipe de gestão robusta e complementar que atua em diferentes mercados, de acordo com a expertise de cada gestor. Nossa estratégia é baseada na geração de resultado de longo prazo combinado com o foco na preservação de capital.

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 novembro de 2019, Thiago Barbieri entrou na empresa como analista de empresas. Em Julho de 2020, o sócio Maurício Ribeiro se desligou da empresa. Ricardo Kazan deixou a empresa em Agosto de 2020 e a sócia Rachel Melki em Setembro de 2020. Em Janeiro de 2021, o sócio Luis Paulo Perdigão ingressou na equipe como Portfolio Manager da área Internacional e em Abril de 2021 o sócio Thiago Barbieri deixou a empresa.
Em dezembro de 2023, a XP Investimentos absorveu a participação do Banco Modal na estrutura societária da Novus Capital. Esse movimento ocorreu através do veículo XP Managers FIP Multiestratégia, instrumento da instituição que detém participação em diferentes gestoras de recursos. Vale destacar que a sociedade tem como principais focos potencializar o crescimento da gestora nos diferentes canais de distribuição da companhia e agregar inteligência de mercado com objetivo de potencializar o desenvolvimento da asset.

b.Escopo das atividades

Não houve alteração no escopo das atividades.

c. Recursos humanos e computacionais

A Novus Capital possui 17 sócios, 1 funcionário, 2 estagiários e 1 terceirizado.

d.Regras, políticas, procedimentos e controles internos

A Novus Capital mantém atualizadas as regras, políticas, procedimentos e controles internos, fazendo alterações e atualizações sempre que necessário. Novos documentos podem ser criados (alguns confidenciais e/ou para uso exclusivamente interno) com o propósito de melhor prever e regular determinadas situações. Listamos os seguintes documentos:
Formulário de Referência (Anexo 15 - II da Instrução CVM 558);
Manual de regras, procedimentos e controle internos;
Manual de controle de liquidez;
Manual de marcação a mercado (disponibilizado pelo Administrador);
Código de ética e conduta;
Política de Segurança da Informação e Cibersegurança;
Plano de contingência e continuidade de negócios;
Manual de prevenção e combate à lavagem de dinheiro e à corrupção;
Política de gestão de riscos;
Política de treinamento e reciclagem;
Política de investimentos pessoais;
Política de rateio de ordens;
Política de voto;
Política de Tomada de Decisão, Seleção e Alocação de Ativos;
Política de Seleção, Contratação e Monitoramento de Terceiros;
Política de Certificação Continuada;
Política de Aquisição e Monitoramente de Crédito Privado.

3. Recursos Humanos

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

a. Número de sócios:
17

b. Número de empregados:
1

c. Número de terceirizados:
1

CPF	Nome
095.619.247-57	LUIZ EDUARDO MENDES DE ALMEIDA PORTELLA

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

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 destra 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 Novus Capital somente presta serviços de gestão de recursos de terceiros.

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 Novus Capital, em 30/12/2022, fazia a administração de vinte carteiras: 12 fundos de investimento multimercado, 3 fundo de investimento em ações e 4 fundo de investimento em renda fixa.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Os fundos de investimentos geridos pela Novus Capital, dentro dos limites impostos pelas suas políticas de investimentos e pela regulamentação aplicável, podem, conforme o caso, vir a negociar diversos ativos financeiros, dentre estes, os indicados abaixo:
títulos públicos e operações compromissadas lastreadas nestes títulos;
títulos de renda fixa de emissão de empresas e instituições financeiras;
ações, desde que emitidas por companhias abertas, por meio de oferta pública, e sejam negociadas em bolsas de valores e/ou em sistemas eletrônicos;
cotas de fundos de investimentos e cotas de fundos de investimentos em cotas de fundos de investimentos, em especial os regulados pela Instrução CVM nº. 555/15;
derivativos financeiros;
outros ativos financeiros, conforme disposto nas políticas de investimentos dos fundos de investimentos;
outros títulos e valores mobiliários permitidos pela legislação e pelos regulamentos dos fundos de investimentos.
Vale ressalvar que a Novus Capital não tem por foco realizar investimentos em ativos financeiros considerados de "crédito privado", preferindo Risco de Mercado em detrimento à Risco de Crédito.

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 Novus Capital exerce única exclusivamente a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários de fundos de investimentos, e não atua na distribuição de fundos de investimentos. Portanto, não há conflitos de interesses entre 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	113	27396	27509

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	15	87	102
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	0	3	3
iii. Instituições Financeiras	0		0
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0		0
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	37		37
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	0	3	3
vii. Seguradoras	3		3
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	0		0
ix. Clubes de Investimento	0	0	0
x. Fundos de Investimento	52		52
xi. Investidores não Residentes	0		0

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Plataformas de Distribuição	6	27303	27309

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	113	27396	27509

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R$ 1.309.435.894,24	R$ 0,00	R$ 2.578.202.233,90

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

R$ 182.303.384,51

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

Valor	Nome
R$ 218.912.572,05	
R$ 215.287.080,44	
R$ 209.751.564,34	
R$ 142.182.677,73	
R$ 137.740.241,65	
R$ 118.119.024,93	
R$ 112.919.953,38	
R$ 92.160.045,79	
R$ 47.958.301,47	
R$ 47.839.964,13	

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$ 14.494.540,00	R$ 28.530.669,51	R$ 43.025.209,51
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R$ 0,00	R$ 3.541.687,36	R$ 3.541.687,36
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$ 637.626.348,89		R$ 637.626.348,89
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	R$ 0,00	R$ 58.089.867,70	R$ 58.089.867,70
vii. Seguradoras	R$ 261.787.431,69		R$ 261.787.431,69
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$ 294.747.243,42		R$ 294.747.243,42
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
Plataformas de Distribuição	R$ 100.780.330,24	R$ 1.178.604.115,09	R$ 1.279.384.445,33

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R$ 1.309.435.894,24	R$ 0,00	R$ 2.578.202.233,90

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

a. Ações	R$ 54.313.351,88
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$ 5.867.411,09
i. Cotas de outros fundos de investimento	R$ 182.303.384,51
j. Derivativos (valor de mercado)	R$ 11.086.588,95
k. Outros valores mobiliários	R$ 0,00
l. Títulos públicos	R$ 2.325.954.475,91
m. Outros ativos	R$ -1.322.978,44
Total	R$ 2.578.202.233,90

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

Não se aplica.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não se aplica.

7. Grupo Econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
32.676.543/0001-10	Sociedade Novus Participações Ltda
31.624.538/0001-09	Novus Holding Participações Ltda
32.528.586/0001-58	XP MANAGERS FIP MULTIESTRATÉGIA
15.130.862/0001-06	Flag Participações Ltda

b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
-	Não Informado

c. Participações da empresa em sociedade do grupo

CNPJ	Nome
-	Não Informado

d. Participações de sociedades do grupo na empresa

CNPJ	Nome
-	Não Informado

e. Sociedades sob controle comum

CNPJ	Nome
-	Não Informado

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

Nenhum arquivo selecionado.

8. Estrutura Operacional e Administrativa

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

a. Atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico

- Comitê Executivo:

Mensalmente o comitê se reúne com objetivo de analisar o desempenho e tomar decisões em relação ao dia a dia da empresa. Além disso é responsável por todas as decisões estratégicas de curto e longo prazo, balizando as diretrizes da NOVUS como empresa.

- Reunião de Gestão:

São abordados diversos temas relevantes da conjuntura macro e microeconômicos, além de discutidas as posições de curto, médio e longo prazo, o nível de convicção em cada uma delas e as principais notícias que podem influenciá-las. Adicionalmente, há a discussão e planejamento de pesquisas e novos estudos a serem desenvolvidos pelos times técnicos.

- Comitê de Risco & Compliance:

Neste comitê são discutidas as divisões do risco entre os mercados/gestores, limites de risco dos fundos e novas modelagens sobre métricas relativas à gestão de riscos dos fundos. Além do citado, são discutidas questões relacionadas ao compliance como mudanças de políticas e/ou situações que não estejam em acordo com as regras da empresa e alterações de normas dos órgãos reguladores a quem a Novus Capital responde

- Reunião de Risco & Compliance:

São apresentadas e discutidas as principais posições assumidas durante o mês, analisando as métricas de desempenho pertinentes. É realizada uma análise detalhada da carteira de ativos e criado os cenários de stress utilizados nos modelos de risco. Além disto, tem como objetivo verificar a adequação das carteiras administradas aos limites de risco definidos em seus regulamentos ou pelo Comitê de Risco & Compliance

- Departamento de pesquisa econômica:

Tem como objetivo produzir e fornecer projeções econômicas e análises de conjuntura dando suporte para os diversos comitês da empresa.

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

- Comitê Executivo:
Composto por Luis André Oliveira, Rodrigo Galindo e Luiz Eduardo Portella para discussão a respeito do dia-a-dia da empresa e o seu planejamento no longo prazo. A frequência desse comitê é mensal.

- Reunião de Gestão:

Participam desta reunião a equipe de gestão, analistas das equipes de macroeconomia, empresas e derivativos e riscos. Ocorre diariamente pela manhã quando é realizada uma reunião quando são discutidas as posições táticas específicas para o curto prazo e as principais notícias que podem influenciá-las.
Semanalmente onde são analisados os pontos relevantes da conjuntura macro e micro e os ativos com potencial de operação, além de avaliar o nível de convicção em cada um destes. São definidas as estratégias de médio prazo. Adicionalmente, há a discussão e planejamento de pesquisas e novos estudos.

- Comitê de Risco & Compliance:

Participam deste comitê o comitê executivo e o gestor de riscos. Esse comitê se reúne sob demanda

- Reunião de Risco:

Participam deste fórum a equipe de gestão e área de riscos. Esta reunião ocorre semanalmente.

- Reunião de Análise Econômica:

Este comitê ocorre mensalmente quando são apresentados e discutidos temas e pesquisas econômicas desenvolvidos pela nossa equipe. Contado com a presença do nosso consultor econômico, buscamos definir cenários de mais longo prazo e avaliar nossos portfólios neste contexto. Participam os comitês de gestão, riscos e pesquisa

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

Todas as decisões relevantes e estratégicas da Novus Capital passam, obrigatoriamente, pelo Comitê Executivo, que delibera e decide por simples maioria, não tendo os sócios poderes individuais.

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
00.005.205/9357-07	Rodrigo Galindo	44	Administrador	sócio-fundador	03/09/2018	indefinido	
00.008.262/8127-35	Luis Andre de Queiroz Oliveira	48	Economista	sócio-fundador	03/09/2018	indefinido	
00.009.561/9247-57	Luiz Eduardo Mendes de Almeida Portella	41	Economista	sócio-fundador	03/09/2018	indefinido	
00.009.068/5227-79	Gustavo Torrres Cursino de Moura	41	Administrador	Diretor de Risco e Compliance	03/09/2018	indefinido	

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

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	00.005.205/9357-07	Rodrigo Galindo	44	Administrador	Sócio-Diretor	10/08/2012	Indefinido	Não	Administração de Empresas - UFRJ	Sim
8.5 (COMPLIANCE)	00.009.068/5227-79	Gustavo Torrres Cursino de Moura	41	Administrador	Sócio-Diretor	08/02/2018	Indefinido	Não	Administração de Empresas - PUC RJ	Não se aplica
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	00.009.068/5227-79	Gustavo Torrres Cursino de Moura	41	Administrador	Sócio-Diretor	08/02/2018	Indefinido	Não	Administração de Empresas - PUC RJ	Não se aplica

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

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

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

a. Quantidade de profissionais

12

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Dentre as atividades desenvolvidas pela área de gestão, destacam-se:
-análise de ativos financeiros;
-análise diária dos cenários macroeconômicos para busca de oportunidades de investimentos;
-execução de estratégias;
-alocação, rebalanceamento, enquadramento e reenquadramento das carteiras;
-gestão de caixa (aplicação e resgate);
-explanação da evolução dos fundos de investimentos para os clientes; e
-acompanhamento diário dos mercados locais e externos;

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

O Comitê de Gestão é responsável pela gestão dos fundos e tem a palavra final das decisões. As posições são alocadas nos fundos em função de seus perfis de risco e objetivos de rentabilidade, sempre respeitando os mandatos específicos. A equipe de gestão utiliza os softwares de informações Bloomberg, Broadcast, Valor PRO e assinatura de jornais e revistas físicos e on-line, locais e internacionais.

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

Responsável por zelar pela adequação às diretrizes gerais e profissionais de conduta, contidas nos manuais da Novus Capital, esperadas não apenas dentro da empresa, no relacionamento entre as áreas, respectivas equipes e diretoria, mas também nas relações externas com clientes, distribuidores e prestadores de serviços. Além disso, deve promover a conformidade e a adequação da Novus Capital às diversas normas definidas ou que venham a ser estabelecidas pelos órgãos reguladores.

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

Para monitorar o efetivo cumprimento das normas legais e regulamentares às quais estão sujeitos os colaboradores da Novus Capital, a área de Risco & Compliance adota como rotina diária verificar o enquadramento das operações realizadas à mercado, bem como a adequação da Área de Gestão à política de investimento dos fundos. Além disso, verifica aleatoriamente, a conduta dos colaboradores em relação às normas legais, ao Código de Ética e Conduta, aos manuais e políticas da Novus Capital. Eventuais infrações e suas consequentes sanções serão decididas pelo Comitê Executivo da Novus Capital. Quando necessário, a Novus Capital contrata escritórios de advocacia externos para dirimir dúvidas e informar sobre aspectos específicos relacionados com interpretações da legislação e da regulamentação, tanto no Brasil quanto no exterior.
O controle de risco e o gerencial são extraídos dos sistemas externos Lote45 ou são desenvolvidos internamente.

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

O Sócio-Diretor responsável pela área de Risco & Compliance tem total autonomia para promover a adequação às regras e executar as sanções decididas pelo Comitê Executivo, previstas nos manuais e políticas da Novus Capital. Ele atua com completa independência para tomar qualquer decisão quanto às questões de gestão risco e de Compliance, sendo de sua exclusiva responsabilidade a gestão desta área.

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

a. Quantidade de profissionais *

4

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Todo o gerenciamento de risco da empresa é realizado pela área de Risco & Compliance, responsável pelo monitoramento diário dos riscos de mercado, liquidez, preço, contraparte e operacional; pela identificação, mensuração, monitoramento, controle e comunicação desses riscos; pela guarda de eventuais documentos que contém as justificativas sobre as decisões tomadas; pela verificação do atendimento às normas legais; e pela eventual revisão dos parâmetros estabelecidos nesta política.

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

A Novus Capital mantém uma rigorosa política de gerenciamento de risco confrontando duas frentes: (i) o sistema de controle de risco Lote45 que oferece uma tecnologia de ponta como boletador, cálculo de cota e de risco de mercado além de permitir controlar os limites de risco pré-estabelecidos em tempo real e o controle dos riscos de liquidez dos fundos. Diariamente, antes da abertura dos mercados, é disponibilizado para a equipe de gestão um relatório com a exposição dos fundos detalhando a exposição por ativo, classe de ativos e estratégias. Adicionalmente, é feito um controle de alocação de caixa, gerenciamento de liquidez, crédito e de contraparte, desempenho por estratégia/mercado/classe de ativos, VaR paramétrico por fator de risco, VaR via simulação histórica, e testes de stress. Os relatórios são recebidos por todos os sócios da empresa.

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

O Sócio-Diretor responsável pela área de Risco & Compliance tem total autonomia para, uma vez identificada uma exposição ao risco, qualquer que seja, além dos limites expressos no regulamento de determinado fundo, na ausência ou mesmo sem o consentimento do gestor, promover a adequação da mesma aos parâmetros permitidos.

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

a. Quantidade de profissionais

0

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

Não se aplica

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

Não se aplica

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

a. Quantidade de profissionais

0

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Não se aplica

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

Não se aplica

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

Não se aplica

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

Não se aplica

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

Não se aplica

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 Novus Capital presta o serviço de gestão de recursos de terceiros, sendo remunerado através de taxas de administração e performance dos seus fundos.

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 (%):

81,38

b. Taxa de performance (%):
18,62

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:
Nada a comentar.

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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

Conforme descrito no Manual de Seleção de Prestadores de Serviço, todas as atividades que necessitem de apoio de terceiros para a devida manutenção das atividades da Novus Capital, deverão, obrigatoriamente, passar por um processo de aprovação anteriormente a contratação da prestação de serviços. Este processo deverá vir acompanhado de processo de concorrência, em função da necessidade de se obter no mercado os melhores prestadores de serviço para nossa atividade.
A Gestora poderá deixar de aplicar os procedimentos expostos nesta política, a exclusivo critério do Diretor de Risco e Compliance, quando o terceiro: (i) tiver notória capacidade econômico-financeira e técnica para satisfazer o objeto da contratação, (ii) adimplir as responsabilidades contratuais estabelecidas e (iii) tiver reputação ilibada.

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

Os custos de transação com valores mobiliários são checados no início de cada mês, com base nos custos observados mês anterior, para verificar se estão em linha com o custo histórico das operações e se estão de acordo com o que o mercado pratica, de forma geral.

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

Nenhum colaborador deve oferecer ou aceitar presentes, gratificações, itens de valor ou benefícios que possam gerar conflito de interesses com os negócios da Novus Capital, principalmente no relacionamento com clientes, fornecedores, prestadores de serviço ou até mesmo concorrentes. É definido pela área de Compliance o valor limite de U$100 (cem dólares) como valor aceitável para recebimento de presentes e gratificações.
O recebimento de qualquer benefício ou gratificação de cliente, prestador de serviço ou de terceiros acima desse valor estipulado de U$100 (cem dólares) deve ser comunicado ao Diretor de Compliance para aprovação.
A Novus Capital permite a prática de soft dollar, desde que dentro dos limites definidos pelos manuais e códigos internos e de modo que as carteiras administradas não incorram em despesas com corretagem para terceiros além daquelas normalmente e razoavelmente geradas pelas operações diárias nos mercados em que atua. Além disso, vale mencionar que todos os benefícios auferidos com o soft dólar são repassados aos cotistas dos fundos de investimento sob gestão da Novus Capital, e que o soft dólar não poderá sob qualquer aspecto ser o fator determinante para a tomada de decisão por determinado prestador de serviço, isto é, a independência decisória não será afetada pelo soft dólar.

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

A Novus Capital possui uma infraestrutura de TI organizada de forma a garantir alta disponibilidade ao ambiente de negócios, evidenciando o desenvolvimento de um plano de continuidade de negócios eficiente, com a criação de condições para uma rápida restauração do ambiente de produção em caso de acidente, e atendendo às necessidades da empresa. A instalação dessa infraestrutura de TI está localizada no endereço social da empresa, na Av. Ataulfo de Paiva, 1235, 4º andar, no bairro do Leblon, na cidade e estado do Rio de Janeiro.
1) Energia
Em caso de eventual falta de energia, a empresa possui nobreak por um período de vinte minutos, para garantir o funcionamento dos computadores até que possa ser feito o desligamento seguro do sistema operacional, sem correr o risco de perder o trabalho que estava sendo feito ou dos dados que estavam sendo manipulados na memória do computador. Os equipamentos do CPD e os computadores são alimentados simultaneamente pelo nobreak, evitando que falhas no sistema comprometam a operação da empresa.
2) Backup de dados
A Novus Capital possui três servidores DELL, sendo dois no site principal e um no site de contingência, dentre os quais é realizado um espelhamento em tempo real. Cada servidor está preparado para assumir as mesmas funções, mantendo os arquivos e políticas de segurança dos usuários. Além disso, a empresa possui, entre o site de produção e o secundário, dois aparelhos QNAP, um em cada site, que se replicam simultaneamente, permitindo assim o acesso dos dados através de qualquer um dos dois sites.
Todos os dias, no site de produção, na janela das 22hs às 07hs, é executado um backup completo de todos os dados da rede (planilhas, arquivos nos formatos .pdf e .doc, power point, dentre outros), sendo a execução realizada de segunda a sábado e a verificação sempre às 08hs da manhã. Backups diários são feitos entre os equipamentos NAS QNAP TS-212 e replicados a cada 03:30h para o site secundário, permitindo o restore dos dados a qualquer momento.
Além dos processos citados acima, diariamente realizamos um outro backup dos arquivos do NAS QNAP TS-212 no sistema em nuvem da Microsoft - One Drive - o qual possui espaço ilimitado de armazenamento. Adicionalmente, no site de produção há um backup dos últimos 5 dias, em caso de necessidade de restauração dos dados por perda ou erro de processo. E, por fim, todas as segundas-feiras uma cópia do acervo de backup é efetuada, enviada ao site de replicação na nuvem, e testada semanalmente com um site de restore de seu conteúdo como teste.
3) Disaster Recovery
No caso de ocorrência de acidentes graves de segurança ou desastres que possam afetar a infraestrutura tecnológica, os sistemas de informação e consequentemente a segurança física e lógica de toda a informação armazenada, processada e em circulação na rede, os funcionários da Novus Capital podem voltar a sua atividade normal utilizando o escritório de contingência localizado na Rua do Rosário, 173 / subsolo - Centro-RJ com capacidade para 4 pessoas, segundo o Plano de Contingência.
Além disso, os colaboradores possuem acesso ao QNAP do site secundário, podendo utilizar o Bloomberg Anywhere, dentre outros sistemas ou, utilizar acesso via VPN com acesso remoto aos dados.

4) Correio (e-mails)
A estrutura de e-mails da empresa se encontra hospedada e com backup fornecido pela Microsoft. Cada caixa postal é disponibilizada com capacidade de até 100Gb e serviços como agenda, contatos, e one drive também estão disponíveis a todos os usuários.
O acesso aos e-mails é realizado por qualquer dispositivo via internet, e cada usuário possui uma senha pessoal com verificação em duas etapas, tendo como objetivo dar mais segurança aos acessos às caixas de entrada de e-mail.
5) Redundâncias e infraestrutura interna
A arquitetura concebida possui um Firewall Fortigate 60E, em H.A. (alta disponibilidade) e prevê redundância em alguns níveis: (i) um link dedicado de internet de 150 Mbps principal, for

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

A gestão dos fundos prioriza o elevado grau de liquidez dos ativos em carteira. A adoção de um perfil de liquidez elevado oferece dois grandes benefícios: agilidade nas mudanças de posições e a consequente proteção nos períodos de maior volatilidade e o aproveitamento das oportunidades de negócio que surgem em situações de stress. Desta forma, a preocupação com a liquidez dos portfólios é constante.

O risco de liquidez pode ser dividido em: (i) risco de liquidez de fluxo de caixa (passivo), que seria a possibilidade da ocorrência de descasamentos entre os pagamentos e os recebimentos afetando a capacidade de pagamento dos resgates para os cotistas dos fundos; e (ii) risco de liquidez de mercado, ocasionado pela não capacidade de liquidação de uma posição significativa no mercado e/ou pela perda de valor dos ativos que compõem a carteira, consequentemente afetando a capacidade de pagamento dos resgates para os cotistas dos fundos.

O gerenciamento do risco de liquidez do passivo leva em consideração critérios como: (i) regras de aplicação e resgate, ou seja, o número de dias úteis para o recebimento dos recursos e para o pagamento do resgate, respectivamente, estando ambos definidos no regulamento dos fundos; (ii) perfil de concentração de cotistas, que indica o percentual do fundo correspondente à posição de cada cotista, limitando-se, idealmente, a 30% (trinta por cento) por cotista; e (iii) simulação histórica de aplicações e resgates, que considera o maior financeiro do período em análise e o impacto desse fluxo na carteira de ativos dos fundos.

Os ativos que compõem a carteira de um fundo de investimento podem ser classificados em ativos líquidos, aqueles que podem ser vendidos sem nenhuma ou pouca perda em relação ao valor de mercado, e em ativos ilíquidos, que não podem ser vendidos, considerando a não existência de mercado secundário. Qualquer ativo que esteja sendo utilizado como margem, ajuste e/ou garantia de alguma operação, será considerado como ilíquido e o dinheiro em caixa no fundo considerado como um ativo líquido, uma vez que pode ser usado, imediatamente, para pagamento de resgates.

No procedimento de controle de liquidez, a Novus Capital adota uma postura conservadora, considerando apenas os títulos públicos, os títulos privados com resgate antecipado garantido pelo emissor e as cotas dos fundos de investimento abertos como ativos líquidos. Ativos que não possuem essas características são considerados ilíquidos.

Uma análise de stress verifica se a composição/liquidez do portfólio comportaria o volume de vendas associado a eventuais resgates, observando ainda o enquadramento de seus limites regulamentares. A metodologia consiste em atribuir um determinado número de dias para liquidação de cada ativo, adicionando um multiplicador que depende do grau de dispersão dos cotistas. É, então, feita uma simulação do percentual da carteira que estaria disponível para o pagamento do resgate no prazo estipulado pelo regulamento do fundo.

A metodologia de liquidez utilizada pela empresa é o ADTV (Average Daily Traded Volume), método através do qual os ativos são ponderados pelo tempo que o gestor levaria para se desfazer da posição. Para esta análise são utilizadas séries históricas de volume negociado em mercados como ações, títulos públicos e derivativos.

Em resumo, para a aferição dos indicadores de risco de liquidez serão utilizados os seguintes métodos:

Verificação do nível de alocação de títulos públicos depositados em garantia na CBLC e BMFBovespa para identificar eventual necessidade de realocação destes ativos entre as clearings ou determinar diminuição das posições nos ativos que exigem depósito de margem ou garantia;
Para as aplicações em títulos públicos federais será considerado como posição líquida imediata, todo valor que não exceder 30% (trinta por cento) da média diária de negociação referente à última semana de negociações;
Verificação do patrimônio dos 5 e 10 maiores cotista

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

Não se aplica.

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.novuscapital.com.br

11. Contingências

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

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

a. Principais fatos *
Nada consta.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos
Nada consta.

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
Nada consta.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos
Nada consta.

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

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
Nada consta.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos
Nada consta.

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
Nada consta.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos
Nada consta.

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

Nada a declarar

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

Marcado

Data de envio: 28/03/2024 - 17:07:00
Data de impressão: 16/04/2024
Hora de impressão: 11:58:37