

ANEXO 15-II

Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

Gauss Capital Gestora de Recursos Ltda.
("Gauss Capital")

Data da Elaboração: 07.08.2020

Data-Base das informações numéricas: 31.12.2019

1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário

Sr. Fabio Okumura, Diretor responsável pela atividade de gestão de recursos da Gauss Capital ("Diretor de Investimentos").

Sr. Carlos Eduardo de Souza Lara, Diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos da Gauss Capital e da Instrução da Comissão de Valores Mobiliários ("CVM") nº 558 de 26 de março de 2015 ("Instrução CVM 558"), bem como Diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas e procedimentos de controles de risco ("Diretor de Compliance" e/ou "Diretor de risco").

1.1. Declarações dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e desta Instrução, atestando que:

Vide Anexo I.

a. reviram o formulário de referência

b. o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa

2. Histórico da empresa

<p>2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa</p>	<p>A Gauss Capital foi constituída em 22/08/2014, sob a denominação Gauss Investimentos Gestão de Recursos S.A., e tinha como sócios a Book 6 Participações Ltda. ("Book 6 Participações")(99,90%) e Heitor Pereira Braga (0,10%). Em 03/03/2015 a LATAM (Brasil) Investimentos Ltda. ("LATAM Investimentos"), subsidiária integral do Grupo Credit Suisse, adquiriu a participação de Heitor Pereira Braga e promoveu um aumento de capital, se tornando acionista majoritária da empresa, com 55% e a Book 6 Participações ficou com 45% do capital. Na mesma data, foi aprovada a alteração da denominação social da empresa para Credit Suisse Hedging-Griffo Asset Management Partners Gestão de Recursos S.A.</p> <p>Em janeiro de 2019, a LATAM Investimentos e a Book 6 Participações vendem todas as suas ações da Gauss Capital, que se transforma em limitada, configurando nova estrutura societária na qual passam a ser sócias da Gauss Capital: (i) a Gauss Partners Holding Ltda., (ii) a Gauss Associados e Participações Ltda. e (iii) a Vectis Partners Holding S.A. Na nova estrutura, Fabio Okumura, que já era sócio majoritário da Book 6 Participações, passa a ser sócio controlador indireto da Gauss Capital.</p> <p>Em julho de 2020, a Vectis Partners Holding S.A. transferiu a totalidade das quotas que detinha do capital social da Gauss Capital à Gauss Partners Holding Ltda., de modo que a configuração societária atual da Gauss Capital contempla: (i) a Gauss Partners Holding Ltda. e (ii) a Gauss Associados e Participações Ltda.</p> <p>Mesmo com a nova configuração societária, a equipe de gestão da Gauss Capital permaneceu substancialmente inalterada, inclusive com o mesmo Diretor de Investimentos, observado o descrito em 2.2, "c" abaixo.</p>
<p>2.2. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo:</p>	<p>Nos últimos 5 anos, os principais eventos societários pelos quais passou a Gauss Capital foram:</p> <p>2004: Constituição da Gauss Capital como sociedade da LATAM (Brasil) Investimentos Ltda., subsidiária integral do Grupo Credit Suisse e da Book 6 Participações Ltda;</p> <p>2018: Book 6 Participações Ltda. se torna a única acionista, ao adquirir as cotas da LATAM (Brasil) Investimentos Ltda.;</p> <p>2019: a Book 6 Participações vende todas as suas ações da Gauss Capital, que se transforma em limitada, configurando nova estrutura societária na qual passam a ser sócias da Gauss Capital: (i) a Gauss Partners Holding Ltda., (ii) a Gauss Associados e Participações Ltda. e (iii) a Vectis Partners Holding S.A.</p> <p>2020: a Vectis Partners Holding Ltda. vende todas as suas cotas da Gauss Capital à Gauss Partners Holding Ltda., deixando assim de ser integrante do quadro societário da Gauss Capital, que agora contempla apenas: (i) a Gauss Partners Holding Ltda. e (ii) a Gauss Associados e Participações Ltda.</p>

b. escopo das atividades	Desde sua constituição, a Gauss Capital atua como gestora de recursos, fazendo a gestão de ativos em diversos segmentos do mercado de capitais. Desta forma, não passou por quaisquer mudanças relevantes em seu escopo das atividades nos últimos 5 (cinco) anos.
c. recursos humanos e computacionais	<p>Em agosto de 2015, o Sr. Laurence Mello saiu do Credit Suisse Hedging-Griffo Asset Management Partners Gestão de Recursos S.A. ("CSHG AM") e deixou as funções de gestor de Crédito Privado.</p> <p>Em dezembro de 2015, o Sr. Marcelo Kishimoto e o Sr. Ruy Balieiro saíram da CSHG AM e deixaram, respectivamente as funções de gestor de volatilidade e gestor de moedas.</p> <p>Em maio de 2016, o até então gestor de renda fixa, Sr. Ricardo Valente, deixou de fazer parte da CSHG AM.</p> <p>Em março de 2018, o até então gestor de Equities, Sr. Eduardo Biancheri, deixou de fazer parte da CSHG AM.</p> <p>Em abril de 2018, o até então gestor, Sr. Andre Lichtenstein deixou de fazer parte da CSHG AM.</p> <p>Em julho de 2018, o Sr. Felipe Freitas deixou de desempenhar a função de gestor de mercados internacionais.</p> <p>Em agosto de 2018, o Sr. Carlos Rocha e o Sr. Celso Avila saíram da CSHG AM, deixando de desempenhar as funções de gestor de Fundos de Renda Fixa/Passivos e gestor de estratégia de Volatilidade, respectivamente.</p> <p>Em abril de 2018, o Sr. Aurélio Bicalho, até então economista chefe, deixou de fazer parte da CSHG AM.</p> <p>Em novembro de 2018, o Sr. Heitor Braga, até então gestor de mercados de Renda Fixa locais deixou de fazer parte da CSHG AM.</p> <p>Em setembro de 2019, o Sr. Carlos Eduardo de Souza Lara ingressou na Gauss Capital e assumiu as funções de Diretor de Risco antes exercidas pelo Sr. Sergio Campos, que deixou de fazer parte da Gauss Capital.</p> <p>Em fevereiro de 2020, o Sr. Gilberto Paim saiu da Gauss Capital, deixando de desempenhar as funções de gestor de Crédito Privado .</p> <p>Em março de 2020, o Sr. Carlos Eduardo de Souza Lara assumiu as funções de Diretor de Compliance antes exercidas pelo Sr. Téo Bastos</p> <p>Desde sua constituição em 2014, os recursos humanos e computacionais da Gauss Capital foram dimensionados para atender às necessidades de suas atividades.</p>
d. regras, políticas, procedimentos e controles internos	Nos últimos 5 anos, dentre as principais mudanças realizadas em regras, políticas, procedimentos e controles internos destacam-se: (i) as adequações para contemplar as mudanças trazidas pela legislação de prevenção à lavagem de dinheiro, que acarretaram em ajustes nos manuais internos, bem como nos treinamentos oferecidos aos funcionários; (ii) as alterações na regulamentação voltada para fundos de investimento e administração de carteiras, que exigiram a revisão e elaboração de documentos regulatórios e a adoção de procedimentos e políticas internas para adequação aos novos requisitos da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2017 ("Instrução CVM 555") e da Instrução CVM 558; e (iii) as atualizações conforme regras e melhores práticas aplicáveis à administração de recursos de terceiros divulgadas pela ANBIMA, que também resultaram na adaptação dos manuais e políticas da Gauss Capital.

3. Recursos humanos

3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:	
a. número de sócios	A Gauss Capital tem 2 (duas) sócias: a Gauss Partners Holding Ltda. e a Gauss Associados e Participações. Indiretamente, a Gauss Capital possui 18 (dezoito) sócios pessoas físicas.
b. número de empregados	02 (dois) empregados
c. número de terceirizados	Não há terceirização das atividades fim da empresa. São terceirizados serviços como de limpeza, segurança, motoboy, gráfica, aconselhamento jurídico e contábil.
d. lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e que atuem exclusivamente como prepostos, empregados, ou sócios da empresa	Sr. <u>Fabio Massashi Okumura</u> , inscrito no CPF/ME sob nº 063.426.888-00

4. Auditores

4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:	N.A. – A Gauss Capital não conta com auditores independentes.
a. nome empresarial	
b. data de contratação dos serviços	
c. descrição dos serviços contratados	

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	N/A

6. Escopo das atividades

<p>6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo:</p>	<p>Gauss Capital é registrada na CVM como gestora de recursos de terceiros e atua na gestão de fundos de investimento.</p> <p>A atividade de gestão envolve, dentre outros aspectos, a análise fundamentalista macro e microeconômica para a tomada de decisões de investimento de acordo com o perfil da carteira.</p>
<p>a. tipos e características dos serviços prestados (gestão discricionária, planejamento patrimonial, controladoria, tesouraria, etc.)</p>	<p>Atualmente, a Gauss Capital atua na gestão discricionária de fundos de investimento com características diversos, como renda fixa, crédito privado, previdenciário, multimercado e ações.</p>
<p>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.)</p>	<p>Os fundos de investimento sob gestão da Gauss Capital investem em diferentes segmentos no mercado, como renda fixa, crédito privado e ações.</p> <p>Em 31 de dezembro de 2019, havia 12 fundos de investimento sob gestão regidos pela Instrução CVM 555/14.</p>
<p>c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão</p>	<p>A Gauss Capital pode atuar na gestão de quaisquer tipos de ativos financeiros e valores mobiliários admitidos na legislação e regulamentação em vigor.</p> <p>Atualmente, os ativos sob gestão são compostos, sem limitação, majoritariamente por ações, títulos públicos e privados de renda fixa, <i>commodities</i>, derivativos e cotas de outros fundos de investimento, incluindo ativos financeiros no exterior.</p>
<p>d. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor</p>	<p>Não.</p>
<p>6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores</p>	<p>A Gauss Capital atua apenas na atividade de gestão de recursos.</p>

mobiliários, destacando:	
a. os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades; e	<p>N/A. A atuação da Gauss Capital é única e exclusivamente na gestão de recursos.</p>
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.	<p>A Gauss Partners Holding Ltda. é controladora da Gauss Capital e da Gauss Associados e Participações Ltda.</p> <p>As referidas sociedades são <i>holdings</i> e não exercem atividades conflitantes.</p> <p>Para informações adicionais, vide Manual de Compliance da Gauss Capital.</p>
6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos e carteiras administradas geridos pela empresa, fornecendo as seguintes informações:	
a. número de investidores (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)	<p>Fundos: 846 investidores qualificados, 7647 investidores não qualificados, 8493 investidores totais. Carteiras: 0 investidores qualificados, 0 investidores não qualificados, 0 investidores totais.</p>
b. número de investidores, dividido por:	
i. pessoas naturais	<p>34 investidores qualificados 117 investidores não qualificados 151 investidores totais</p>
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)	<p>754 investidores qualificados 7530 investidores não qualificados: 8284 investidores totais</p>
iii. instituições financeiras	<p>0</p>
iv. entidades abertas de previdência complementar	<p>0</p>
v. entidades fechadas de previdência complementar	<p>2</p>

vi. regimes próprios de previdência social	0
vii. seguradoras	4
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil	0
ix. clubes de investimento	0
x. fundos de investimento	52
xi. investidores não residentes	0
xii. outros (especificar)	0
c. recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)	Fundos: 981,707,400.54 investidores qualificados, 633,464,901.63 investidores não qualificados, 1,615,172,302.17 investidores totais. Carteiras: 0.00 investidores qualificados, 0.00 investidores não qualificados, 0.00 investidores totais.
d. recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior	0
e. recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)	1 => 336,655,705.50 2 => 166,766,021.04 3 => 145,163,070.34 4 => 80,508,012.49 5 => 21,384,356.73 6 => 19,974,911.25 7 => 17,350,205.69 8 => 16,472,135.62 9 => 16,246,690.93 10 => 15,025,435.85
f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:	
i. pessoas naturais	Investidores qualificados: 11,797,322.66 Investidores não qualificados: 44,402,700.17 Total: 56,200,022.83

ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)	Investidores qualificados: 61,266,183.18 Investidores não qualificados: 589,062,201.46 Total: 650,328,384.64
iii. instituições financeiras	0
iv. entidades abertas de previdência complementar	0
v. entidades fechadas de previdência complementar	178,506,820.03
vi. regimes próprios de previdência social	0
vii. seguradoras	370,252,602.12
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil	0
ix. clubes de investimento	0
x. fundos de investimento	359,884,472.55
xi. investidores não residentes	0
xii. outros (especificar)	0
6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:	
a. ações	104,936,921.74
b. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras	302,158,784.33
c. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	84,930,160.24
d. cotas de fundos de investimento em ações	0
e. cotas de fundos de investimento em participações	0.00
f. cotas de fundos de investimento imobiliário	0.00
g. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	68,987,759.45

h. cotas de fundos de investimento em renda fixa	3,359,827.87
i. cotas de outros fundos de investimento	51,334,584.68
j. derivativos (valor de mercado)	7,664,600,088.28
k. outros valores mobiliários	0.00
l. títulos públicos	527,816,847.99
m. outros ativos	20,083,717.38 (T-Bills)
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 Gauss Capital 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 Gauss Capital.

7. Grupo econômico

7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:	
a. controladores diretos e indiretos	A Gauss Partners Holding Ltda. é a controladora direta e, indiretamente, o controle é exercido pelo Sr. Fabio Okumura.
b. controladas e coligadas	Não há.
c. participações da empresa em sociedades do grupo	Não há.
d. participações de sociedades do grupo na empresa	A Gauss Associados e Participações Ltda. detém 4% (quatro por cento) de participação na Gauss Capital.
e. sociedades sob controle comum	Gauss Associados e Participações Ltda.
7.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma do grupo econômico em que se insere a empresa, desde	A Gauss Capital entende desnecessária a inclusão de organograma.

que compatível com as informações apresentadas no item 7.1.

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 de Risco:

(i) Atribuições Gerais: neste comitê são apresentados e discutidos eventuais desenquadramentos de limites e as ações tomadas, os principais riscos dos ativos (mercado, liquidez, crédito, operacional).

(ii) Composição: área de risco e principais gestores.

(iii) Frequência e Registro: ocorre mensalmente com registro em ata ou e-mail.

Comitê de Investimento:

(i) Atribuições Gerais: neste comitê são apresentados e discutidos os cenários macro e impacto possível nas posições, bem como teses de investimento, limites e estratégias de alocação quanto à volume e momento de realização, inclusive com base nas teses trazidas a partir dos Comitês de Equities e Crédito.

(ii) Composição: Diretor de Investimentos e membros da equipe de gestão.

(iii) Frequência e Registro: ocorre semanalmente com registro em ata ou e-mail.

Comitê de Compliance:

(i) Atribuições Gerais: definir, divulgar e revisar os procedimentos do Manual de Compliance e demais Políticas da Gauss Capital; fornecer orientação em caso de dúvidas quanto à aplicação das Políticas da Gauss Capital que não puderem ser esclarecidas diretamente pela área de compliance; apurar e tomar determinadas decisões e aprovações de Compliance, Prevenção à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento ao Terrorismo, Anticorrupção e Contingência; apurar denúncias ou indícios de condutas potencialmente contrárias às Políticas internas e normas legais ou regulatórias.

(ii) Composição: Diretor Presidente, Diretor de Compliance e Risco e profissionais da área de compliance.

(iii) Frequência e Registro: ocorre semestralmente ou sempre que necessário, e o registro é realizado mediante ata ou e-mail.

Comitê de Operações:

(i) Atribuições Gerais: tem como função avaliar e mitigar os riscos operacionais.

(ii) Composição: Diretor de Compliance e Risco e membros da equipe de operações.

(iii) Frequência e Registro: sem periodicidade pré-definida e é registrado em ata ou e-mail.

Comitê de Equities:

(i) Atribuições Gerais: tem como função discutir *cases* de equities e cenário macro desse mercado, com a finalidade principal de gerar ideias e teses de investimento para a equipe de gestão e para o Comitê de Investimento.

- (ii) Composição: Diretor de Investimentos, membros da equipe de gestão e da área de risco.
- (iii) Frequência e Registro: ocorre quinzenalmente se houver case e o registro é realizado mediante ata ou e-mail. Não obstante, no Comitê de Equities não são aprovadas decisões de investimento, limites ou reavaliação das principais posições dos fundos, aspectos que devem ser avaliados e definidos pela área de gestão, cabendo ao Diretor de Investimento a tomada de decisão final.

Comitê de Crédito:

- (i) Atribuições Gerais: tem como função discutir cases de crédito e cenário macro desse mercado, com a finalidade principal de gerar ideias e teses de investimento para a equipe de gestão e para o Comitê de Investimento.
- (ii) Composição: membros da equipe de gestão e área de risco.
- (iii) Frequência e Registro: ocorre quinzenalmente se houver case e é registrado em ata ou e-mail. Não obstante, no Comitê de Crédito não são aprovadas decisões de investimento, limites de crédito ou reavaliação das principais posições dos fundos, aspectos que devem ser avaliados e definidos pela área de gestão e área de risco, conforme o caso, cabendo ao Diretor de Investimento a tomada de decisão final.

Os Comitês listados acima poderão contar, ainda, com a participação de indivíduos com notório saber e qualificação técnica, que, na visão da Gauss Capital, contribuirão para o funcionamento dos Comitês. Não obstante, referidos terceiros somente poderão participar de Comitês que não possuam alçada decisória e nos quais não são definidos limites de exposição, volumes ou períodos de negociação, como, por exemplo, os Comitês de Equities e de Crédito, nos quais são discutidas apenas as características macro dos cases apresentados.

Por fim, além dos comitês mencionados, são realizadas reuniões periódicas das equipes de gestão.

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

Vide item "a" acima.

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

A Diretoria da Gauss Capital é composta pelo Diretor de Investimentos, Diretor de Compliance e Risco, bem como outros Diretores sem designação específica eventualmente nomeados, que lhes confere as atribuições e os poderes necessários para assegurar o funcionamento regular da sociedade, sendo que os Diretores poderão acumular funções, desde que permitido pela regulamentação em vigor.

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

A Gauss Capital entende desnecessária a inclusão de organograma.

8.3. Em relação a cada um dos diretores de que tratam os itens 8.4, 8.5, 8.6 e 8.7 e dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar, em forma de tabela:

Seguem abaixo informações. A Gauss Capital identificou como mais relevantes para a atividade de administração de carteiras os Comitês de Investimento, Risco e Compliance.

a. nome

Carlos Eduardo de Souza Lara
Fabio Okumura

b. idade

Carlos Eduardo de Souza Lara : nascido em 1967
Fabio Okumura: nascido em 1965

c. profissão

Carlos Eduardo de Souza Lara : engenheiro
Fabio Okumura: engenheiro

d. CPF, ou número do passaporte

Carlos Eduardo de Souza Lara : 088.531.658-47
Fabio Okumura: 063.426.888-00

e. cargo ocupado	Carlos Eduardo de Souza Lara : Diretor de Compliance e Riscos Fabio Okumura: Diretor de Investimentos
f. data da posse	Carlos Eduardo de Souza Lara : 30/09/2019 Fabio Okumura: 15/05/2015
g. prazo do mandato	Os diretores são eleitos com mandato de prazo indeterminado.
h. outros cargos ou funções exercidas na empresa	Carlos Eduardo de Souza Lara : integrante do Comitê de Risco e Comitê de Compliance. Fabio Okumura: integrante do Comitê de Investimentos e Comitê de Risco.
8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer:	Fabio Okumura (Diretor de Investimentos)
a. currículo, contendo as seguintes informações:	
i. cursos concluídos;	Engenharia de Produção – Escola Politécnica da Universidade de São Paulo (USP)
ii. aprovação em exame de certificação profissional	CGA
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	
nome da empresa	Gauss Capital Gestora de Recursos Ltda.
cargo e funções inerentes ao cargo	Diretor de Investimentos, responsável pela atividade de gestão de recursos.
atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	Gestão de Recursos.
datas de entrada e saída do cargo	Diretor responsável desde 2015
8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e desta Instrução, fornecer:	Vide item 8.6
a. currículo, contendo as seguintes informações:	
i. cursos concluídos;	

ii. aprovação em exame de certificação profissional (opcional)	
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	
nome da empresa	
cargo e funções inerentes ao cargo	
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	
datas de entrada e saída do cargo	
8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:	Carlos Eduardo de Souza Lara (Diretor de Compliance e Risco)
a. currículo, contendo as seguintes informações:	
i. cursos concluídos;	Formado em Engenharia Eletrônica modalidade Telecomunicações - Escola Politécnica da Universidade de São Paulo (USP) Mestrado em Modelagem Matemática aplicada a Finanças pela FEA-USP e IME-USP
ii. aprovação em exame de certificação profissional	CPA-20 (ANBIMA) Agente Autônomo de Investimentos (CVM ANCORD) CGA Módulo I
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:	Diversas experiências na gestão e controle de riscos de investimentos e de tesouraria, compliance, e implementação de projetos de tecnologia. Set/2016 - Ago/2018: Diretor de Riscos de investimentos do Banco Safra e J. Safra Asset Management. Nov/2015 - Jul/2016: Consultor de Integração de Riscos Itaú-Corpbanca em Santiago - Chile Mar/2012-ago/2015: Tesoureiro Unidades Externas Itaú Argentina, Uruguai, IBBA-International. Jul/2008-Fev/2012: Diretor de Riscos (Mercado, Liquidez e Operacional) do Itaú-Unibanco:
nome da empresa	Banco Safra; Banco Itaú-Corpbanca, Banco Itaú-Unibanco
cargo e funções inerentes ao cargo	Diretor de Riscos , Consultor de Riscos, Tesoureiro, Diretor de Riscos
atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram	Banco Safra - Banco múltiplo Safra Asset Management - Gestora de recursos Banco Itaú - Banco múltiplo
datas de entrada e saída do cargo	Vide quadro iii acima
8.7. Em relação ao diretor responsável pela atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento, caso não	N/A. A Gauss Capital não realiza atividades de distribuição.

seja a mesma pessoa indicada no item 8.4, fornecer:

a. currículo, contendo as seguintes informações:

i. cursos concluídos;

ii. aprovação em exame de certificação profissional

iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:

nome da empresa

cargo e funções inerentes ao cargo

atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram

datas de entrada e saída do cargo

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

a. quantidade de profissionais

9 (nove) profissionais.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A equipe de gestão é dividida internamente em: (i) crédito privado, (ii) multimercado, (iii) ações e (iv) renda fixa. Suas atividades são implementações de estratégias e tomada de decisão de investimento embasada pelas equipes de análise.

A equipe de gestão conta com o suporte das seguintes áreas: (i) análise macroeconômica, (ii) análise de empresas, (iii) controle de risco, (iv) middle office e (v) suporte administrativo. As atividades da equipe de gestão propriamente dita é responsável pela implementação das estratégias e pela tomada de decisão de investimento embasada pelas equipes de análise de empresas e macroeconômica. A equipe de gestão de risco calcula os limites diários e monitora o risco de mercado *intraday*, incluindo análises de *stress test* e *Var*. A equipe de *middle office* é responsável pela boletagem e controle de enquadramento das carteiras. A equipe de suporte administrativo atende o administrador dos fundos e faz a interface institucional com as áreas de suporte.

<p>c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>	<p>A área de gestão utiliza principalmente os seguintes sistemas: (i) Sistema de gerenciamento de riscos: sistema Gauss Risk, desenvolvido internamente, (ii) Vendors: Bloomberg, AE Broadcast, Valor Pro, para acompanhamento de notícias e preços de mercado, (iii) Sistema de emissão de ordens: Tradebook e EMSX (ambos da Bloomberg), (iv) Sistema de pós-trade: Tradebook e Gauss Risk, ambos desenvolvido internamente, e (v) Sistema de pré-trade: Gauss Risk desenvolvido internamente.</p> <p>As rotinas da equipe de gestão envolvem: (i) o gerenciamento e monitoramento de riscos de mercado, (ii) precificação dos ativos negociados, (iii) validação de modelos e de análises macroeconômicas e de empresas, (iv) negociação e controle dos ativos pela mesa de operações, (v) validação dos negócios realizados e (vi) enquadramento de carteiras e batimento de cotas com o administrador.</p>
<p>8.9. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:</p>	<p>A área de Compliance da Gauss Capital é responsável pela verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentares, às normas internas e requerimentos de boas práticas de mercado. No manual de Compliance, disponível em nosso website, é possível obter maiores informações.</p>
<p>a. quantidade de profissionais</p>	<p>4 (quatro) profissionais.</p>
<p>b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes</p>	<p>A área de Compliance implementa políticas criadas para ajudar no cumprimento de padrões regulatórios e, posteriormente, monitora o cumprimento de tais políticas. Entre as principais atividades destacam-se: (i) definir e divulgar padrões éticos corporativos que digam respeito ao Código de Conduta e às políticas globais; (ii) implementar procedimentos de monitoramento visando a evitar o uso indevido ou a divulgação imprópria de informações confidenciais ou privilegiadas;</p>
<p>c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>	<p>A área de Compliance da Gauss Capital utiliza-se de controles e sistemas internos para realizar verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentares, às normas internas e requerimentos de boas práticas de mercado. No manual de Compliance, disponível em nosso website, é possível obter maiores informações.</p>
<p>d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor</p>	<p>A área de Compliance reporta-se diretamente ao Board / Diretoria da Gauss Capital.</p>
<p>8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a</p>	

gestão de riscos, incluindo:	
a. quantidade de profissionais	2 (dois) profissionais.
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes	É realizada análise diária detalhada sobre os fatores de risco das carteiras, que inclui VaR, StressTest sensibilidades e performance attribution. Também há o controle de enquadramento aos regulamentos e às imposições e boas práticas dos órgãos reguladores
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	Para os processos e procedimentos descritos no item 8.10(b) acima, são utilizados sistemas desenvolvidos internamente, ferramentas em Excel e em Bloomberg. As rotinas envolvem a importação da composição da carteira e a análise de risco, incluindo volatilidade e liquidez diárias. Adicionalmente, são gerados relatórios para a área de gestão, a fim de discutir o perfil de risco das estratégias.
d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor	A Área de Risco reporta-se diretamente ao Board / Diretoria da Gauss Capital.
8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas, incluindo:	N/A. A Gauss Capital não exerce atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas.
a. quantidade de profissionais	
b. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	
c. a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade	
8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:	N/A. A Gauss Capital não realiza atividades de distribuição.
a. quantidade de profissionais	
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes	
c. programa de treinamento dos	

profissionais envolvidos na distribuição de cotas	
d. infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição	
e. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos	
8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes	Não há outras informações relevantes no entendimento da Gauss Capital.

9. Remuneração da empresa

9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 6.1, indicar as principais formas de remuneração que pratica	Pode ser cobrada: (1) taxa de administração baseada em (i) valor financeiro fixo; ou (ii) alíquota percentual fixa ou variável e incidente sobre patrimônio líquido de fundo de investimento ou carteira sob gestão; e/ou (2) taxa de performance baseada em alíquota percentual incidente sobre o rendimento do fundo de investimento ou carteira gerida, em determinado período e em relação a um "benchmark" pré-estabelecido.
9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total auferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente, durante o mesmo período, dos clientes em decorrência de:	
a. taxas com bases fixas	89,99%
b. taxas de performance	10,01%
c. taxas de ingresso	0%
d. taxas de saída	0%
e. outras taxas	0%
9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes	Não há outras informações relevantes no entendimento da Gauss Capital.

.....

10. Regras, procedimentos e controles internos

<p>10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços</p>	<p>Item facultativo para gestores de recursos.</p>
<p>10.2. Descrever como os custos de transação com valores mobiliários são monitorados e minimizados</p>	<p>No processo de seleção de corretoras a equipe de gestão da Gauss Capital estabelece ranking resultante dos seguintes critérios e processos de avaliação: (i) acesso aos melhores preços de mercado e liquidez; (ii) qualidade dos relatórios de research: conteúdo e recomendações de investimento; (iii) participação em eventos corporativos e de mercado: agendamento de visitas/contatos com as empresas e equipes econômicas; (iv) equipe de atendimento: acesso aos analistas das corretoras; e (v) block/IPO: acesso às informações e alocações em ofertas (para ações). De acordo com a média geral, as corretoras são ranqueadas e os targets de alocação das operações definidos e revistos trimestralmente, visando monitorar e minimizar custos e manter uma boa qualidade de serviços e preços.</p>
<p>10.3. Descrever as regras para o tratamento de soft dollar, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens etc.</p>	<p>A Gauss Capital possui regras e procedimentos em seu Manual de Compliance sobre o recebimento de presentes e entretenimento para os seus funcionários. Tais regras estabelecem que os funcionários não devem dar ou receber presentes, tampouco aceitar ou oferecer entretenimento, de indivíduos ou entidades com os quais a Gauss Capital realiza, ou planeja realizar, negócios, se a oferta ou aceitação de tais presentes ou formas de entretenimento ensejarem a ideia de conflito de interesses ou violação da lei ou da regulamentação. Como princípio básico, um presente ou entretenimento recebido ou concedido não deve configurar um tipo, valor ou frequência que possa ser considerado como estímulo impróprio ou compensação ilegal relacionados aos negócios da Gauss Capital. Um presente é qualquer objeto com valor ou vantagem tangível, incluindo empréstimos, serviços ou utilização de recursos. As formas de entretenimento de negócios, como pagar ou aceitar refeições de negócios ou ingressos para um evento, serão permitidas, desde que o funcionário compareça ao evento oferecido (se não comparecer, a oferta será considerada um presente), o custo do entretenimento seja razoável e aceitável, e o entretenimento seja restrito a pessoas com as quais a Gauss Capital mantém, ou deseja manter de forma sensata, relações diretas de negócios. Os registros de presentes e entretenimento oferecidos ou recebidos pelos funcionários serão mantidos através da ferramenta da Gauss Capital.</p>
<p>10.4. Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados</p>	<p>Foram identificadas as seguintes áreas/atividades que necessitam estar contempladas no Plano de Contingência de forma a garantir o funcionamento da empresa: (i) TI, (ii) Escritório e (iii) Pessoal.</p> <ul style="list-style-type: none"> • O escritório da Gauss Capital possui sistemas redundantes de Firewall, Links Internet, servidores e energia elétrica para garantir a continuidade da operação em caso de falha em algum provedor de serviço. • Backup diário em HD externo de todas as informações armazenadas no servidor de arquivos para minimizar os riscos e buscar garantir a continuidade do negócio e preservação das informações. • Sistema de banco de dados hospedado na nuvem com back-up diário e em premissas com estrutura de alta disponibilidade. • Acesso remoto as contas Bloomberg para os traders, analistas e operadores. • Sistema de e-mail hospedado em cloud com alta disponibilidade e com acesso externo para todas as contas dos usuários. • Sistema de telefonia baseado em software com capacidade de acesso remoto através de smartphones e softphones.

10.5. Descrever as políticas, práticas e controles internos para a gestão do risco de liquidez das carteiras de valores mobiliários	Item facultativo para gestores de recursos.
10.6. Descrever as políticas, as práticas e os controles internos para o cumprimento das normas específicas de que trata o inciso I do art. 30, caso decida atuar na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor	N/A. A Gauss Capital não realiza atividades de distribuição.
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.gausscapital.com.br

11. Contingências

11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, que sejam relevantes para os negócios da empresa, indicando:	N/A - Não há informações a respeito a serem divulgadas.
a. principais fatos	
b. valores, bens ou direitos envolvidos	

11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem sua reputação profissional, indicando:	N/A – Não há informações a respeito a serem divulgadas
a. principais fatos	
b. valores, bens ou direitos envolvidos	
11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores	N/A – Não há informações a respeito a serem divulgadas
11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que a empresa tenha figurado no polo passivo, indicando:	N/A – Não há informações a respeito a serem divulgadas
a. principais fatos	
b. valores, bens ou direitos envolvidos	
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	N/A – Não há informações a respeito a serem divulgadas.

carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo e tenha afetado seus negócios ou sua reputação profissional, indicando:	
a. principais fatos	
b. valores, bens ou direitos envolvidos	
12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, informando sobre:	Vide Anexo II.
a. acusações decorrentes de processos administrativos, bem como punições sofridas, nos últimos 5 (cinco) anos, em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, Banco Central do Brasil, pela Superintendência de Seguros Privados - SUSEP ou pela 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	

b. condenações por crime falimentar, prevaricação, suborno, concussão, peculato, "lavagem" de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores, contra a economia popular, a ordem econômica, as relações de consumo, a fé pública ou a propriedade pública, o sistema financeiro nacional, ou a pena criminal que vede, ainda que temporariamente, o acesso a cargos públicos, por decisão transitada em julgado, ressalvada a hipótese de reabilitação	
c. impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa	
d. inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito	
e. inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado	
f. títulos contra si levados a protesto	
Local e data	São Paulo, 07 de agosto de 2020